

RELATÓRIO DE ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DA AMPREV
CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA - AGOSTO DE 2013

ALOCAÇÃO DOS RECURSOS DIVERSIFICAÇÃO	E G M E N T O	VALOR R\$	RENTABILIDADE DO FUNDO		EM RELAÇÃO					
			NO MES	NO ANO 2013	META ATUARIAL		META GERENCIAL			
					INPC + 6%a.a.		CDI		IBOVESPA	
					NO MES	NO ANO 2013	NO MES	NO ANO 2013	NO MES	NO ANO 2013
				0,65	7,30	0,69	4,88	3,68	-17,95	

PLANO FINANCEIRO

BANCO DO BRASIL S/A										
Carteira Administrada Banco do Brasil - LFT (POS)	R.F.	53.599.074,10								
Carteira Administrada Banco do Brasil - NTN-B (POS)	R.F.	429.017.844,70	1,37	-7,81	212,24	-107,09	197,79	-160,02		
Carteira Administrada Banco do Brasil - LTN (PRE)		1.234.777,26								
BB Previdenciário Renda Fixa IMA-B FI	R.F.	14.851.956,34	1,22	-9,13	188,62	-125,21	175,77	-187,09		
BB RPPS Renda Fixa Fluxo FIC	R.F.	8.448.607,86	0,64	4,37	98,93	59,90	92,19	89,50		
FIDC da Cia de Saneamento Ambiental do D.F - CAESB	R.F.	11.524.375,04	3,34	-22,29	516,48	-305,52	481,31	-456,50		
BB RPPS Renda Fixa Crédito Privado IPCA II	R.F.	15.141.705,58	1,44	9,00	222,52	123,38	207,37	184,34		
Brasil Ações Ibovespa Indexado FIC FI	R.V.	17.556.216,43	1,63	-18,88	251,28				-2,06	-0,93
Brasil Ações IBrX Indexado FIC FI	R.V.	7.623.548,87	1,64	-9,34	254,02	-128,02			-2,04	8,61
TOTAL		558.998.106,18								

CAIXA ECONOMICA FEDERAL										
FI Caixa Brasil IPCA XI Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	18.022.550,00	0,38	5,45	58,32	74,71	54,35	111,63		
FI Caixa Brasil IPCA XII Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	18.268.175,00	0,38	6,98	58,70	95,64	54,70	142,90		
FI Caixa Brasil IPCA XIII Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	17.822.262,50	0,52	7,26	81,16	99,55	75,63	148,75		
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	4.089.218,48	0,72	4,94	110,94	67,75	103,39	101,23		
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	77.173.754,13	1,36	-8,77	210,50	-120,25	196,17	-179,67		
FI Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos RF LP	R.F.	14.473.735,39	0,84	0,02	129,37	0,33	120,57	0,50		
FIDC da Companhia Estadual de Águas e Esgotos-CEDAE	R.F.	2.971.071,48	-1,38	-9,91	-212,90	-135,87	-198,41	-203,02		
Caixa FI em Ações Brasil IBX-50	R.V.	14.796.598,23	1,19	-9,83	184,28	-134,77			-2,49	8,12
Caixa FIC Ações Valor Dividendos RPPS	R.V.	10.187.097,97	1,25	-1,64	193,02	-22,46			-2,44	16,31
Caixa FI em Ações Caixa Small Caps Ativo	R.V.	871.707,99	0,76	-13,44	117,63	-184,22			-2,92	4,51
FI Caixa Brasil IPCA V Multimercado Crédito Privado	M.M.	16.947.362,50	0,57	7,35	88,30	100,75	82,29	150,54		
FI Caixa Brasil IPCA VI Multimercado Crédito Privado	M.M.	6.231.311,80	0,57	7,50	88,60	102,76	82,57	153,54		
FI Caixa Brasil IPCA VIII Multimercado Crédito Privado	M.M.	5.543.191,26	0,56	6,08	86,58	83,35	80,69	124,55		
TOTAL		207.398.036,73								

BANCO BRADESCO S/A										
Bradesco FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	164.073.053,48	1,40	-8,96	216,81	-122,79	202,05	-183,48		
Bradesco FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	88.553.628,90	1,23	-2,89	190,86	-39,58	177,86	-59,14		
Bradesco FI Renda Fixa IMA-B 5+	R.F.	1.283.704,08	1,51	-13,85	233,29	-189,88	217,41	-283,72		
Bradesco FI em Ações Infra-Estrutura	R.V.	16.184.057,32	1,36	-11,17	210,75	-153,10			-2,32	6,78
Bradesco FI em Ações Dividendos	R.V.	2.014.484,81	1,36	-9,20	210,07	-126,14			-2,33	8,75
Bradesco FI em Ações Small Cap Plus	R.V.	936.108,39	1,77	-10,26	273,02	-140,68			-1,92	7,69
Bradesco FI Multimercado Plus I	M.M.	1.245.638,04	0,67	4,45	102,90	60,94	95,9	91,05		
TOTAL		274.290.675,02								

ITAU UNIBANCO S/A										
Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	84.675.773,39	1,25	-9,38	192,82	-128,55	179,70	-192,07		
Itaú Institucional RF Inflação 5 FIC FI	R.F.	13.478.969,00	0,84	-0,39	129,28	-5,37	120,48	-8,02		
Itaú RPI Ações Ibovespa Index FIC FI em Ações	R.V.	35.221.871,50	2,07	-6,65	320,27	-91,10			-1,61	11,30
FIC FIP Kinea Private Equity II	R.V.	1.602.788,82	-1,11	-3,48	-171,79	-47,69			-4,80	14,47
TOTAL		134.979.402,71								

BANCO HSBC BANK BRASIL S/A										
Hsbc FI Renda Fixa Regimes de Previdência Ativo	R.F.	99.695.541,32	0,84	-4,13	130,57	-56,60	121,68	-84,57		
Hsbc FI em Ações Ibovespa Top	R.V.	10.930.436,26	1,46	-18,80	226,05	-257,74			-2,22	-0,85
Hsbc FI Ações Ibovespa Kazan Plus	R.V.	3.394.928,95	2,13	-14,08	328,66	-193,07			-1,56	3,86
Hsbc FI de Ações Small Caps	R.V.	893.253,06	0,12	-10,61	18,42	-145,38			-3,57	7,34
TOTAL		114.914.159,59								

BANCO SANTANDER S/A										
Santander FIC FI IMA-B Títulos Públicos Renda Fixa	R.F.	62.509.577,00	1,38	-9,24	213,17	-126,69	198,65	-189,30		
Santander FIC FI IMA-B Institucional Títulos Públicos RF LP	R.F.	8.444.664,06	1,37	-9,13	212,54	-125,17	198,07	-187,02		
Santander FIC FI Dividendos VIP Ações	R.V.	1.507.126,88	0,99	-7,17	152,57	-98,29			-2,70	10,78
TOTAL		72.461.367,94								

SCHROEDERS INVESTMENT										
Schroder FI em Ações IBrX-50	R.V.	14.610.509,40	0,78	-12,10	120,49	-165,82			-2,91	5,85
TOTAL		14.610.509,40								

GW CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.										
GW1 Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	546.117,96	23,28	6,96	3.599,82	95,43			19,60	24,91
TOTAL		546.117,96								

BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.										
BNP Paribas Grand Prix Fundo de Investimento Ações	R.V.	2.069.638,97	0,72	-17,48	112,09	-239,58			-2,96	0,47
TOTAL		2.069.638,97								

BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A										
FIDC Aberto CPP540 RPPS	R.F.	14.861.382,94	0,53	6,57	81,30	90,05	75,77	134,55		
TOTAL		14.861.382,94								

BANCO BTG PACTUAL										
BTG Pactual FI RF IMA B	R.F.	20.959.046,37	1,40	-8,84	216,19	-121,22	201,47	-181,13		
BTG Pactual IPCA FI Renda Fixa	R.F.	13.660.000,80	0,91	-1,58	140,67	-21,66	131,09	-32,36		
BTG Pactual Dividendos FI de Ações	R.V.	23.460.996,74	0,00	-2,65	0,62	-36,33			-3,68	15,30
TOTAL		58.080.043,91								

GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S.A.										
Geração Futuro Dividendos FIA	R.V.	1.404.769,02	0,66	-8,08	101,92	-110,69			-3,03	9,87
TOTAL		1.404.769,02								

QUELUZ GESTAO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA.										
Queluz Valor Fundo de Investimento em Ações	R.V.	1.646.677,41	0,20	-5,07	30,34	-69,47			-3,49	12,88
TOTAL		1.646.677,41								

PATRIA INVESTIMENTOS LTDA.										
Patria Special Opportunities I FIQ FI	R.V.	2.083.658,10	-0,65	-3,49	-100,32	-47,88			-4,33	14,46
TOTAL		2.083.658,10								

TOTAL APLICADO DO PLANO FINANCEIRO		1.458.344.545,88								DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 30/08/2013
-------------------------------------------	--	-------------------------	--	--	--	--	--	--	--	-------------------------------------------------

PLANO PREVIDENCIÁRIO

CAIXA ECONOMICA FEDERAL										
Carteira Administrada Caixa Economica - NTN-B (POS)	R.F.	141.279.313,55	-3,95	-13,74	-610,80	-188,29	-569,22	-281,34		
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	79.587.848,68	-2,54	-8,77	-393,17	-120,25	-366,40	-179,67		
FI Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos RF LP	R.F.	3.998.955,86	-0,44	0,02	-68,80	0,33	-64,11	0,50		
FI Caixa Brasil IPCA XV Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	5.965.127,04	0,02	6,93	2,80	94,95	2,61	141,88		
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	6.872.271,04	0,66	4,94	102,51	67,75	95,53	101,23		
Caixa FI em Ações Caixa Small Caps Ativo	R.V.	467.279,07	0,10	-13,44	14,74	-184,22			-3,59	4,51
FI Caixa Brasil IPCA VI Multimercado Crédito Privado	M.M.	5.979.704,34	0,32	7,50	49,51	102,76	46,14	153,54		
TOTAL		244.150.499,58								

BANCO DO BRASIL S/A										
BB Previdenciário Renda Fixa IMA-B FI	R.F.	24.710.841,97	-2,60	-9,13	-402,28	-125,21	-374,89	-187,09		
BB RPPS Renda Fixa Fluxo FIC	R.F.	4.198.501,58	0,62	4,37	96,50	59,90	89,93	89,50		
TOTAL		28.909.343,55								

GWJ CONSULTORIA, PARTICIPAÇÕES E SERVIÇOS LTDA.										
GWJ Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	1.575.823,32	-0,07	6,96	-11,42	95,43			-3,76	24,91
TOTAL		1.575.823,32								

BANCO BTG PACTUAL										
BTG Pactual IPCA FI Renda Fixa	R.F.	14.535.960,70	-0,54	-1,58	-83,21	-21,66	-77,54	-32,36		
BTG Pactual FI RF IMA B	R.F.	3.466.764,64	-2,64	-8,84	-408,68	-121,22	-380,86	-181,13		
TOTAL		18.002.725,34								

BANCO BRADESCO S/A										
Bradesco FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	11.372.686,71	-2,57	-8,96	-397,02	-122,79	-369,99	-183,48		
Bradesco FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	5.126.220,41	-1,22	-2,89	-188,56	-39,58	-175,72	-59,14		
Bradesco FI Renda Fixa IMA-B 5+	R.F.	624.089,55	-3,89	-13,85	-602,25	-189,88	-561,24	-283,72		
Bradesco FI em Ações Dividendos	R.V.	695.714,07	-1,66	-9,20	-256,44	-126,14			-5,34	8,75
Bradesco FI em Ações Small Cap Plus	R.V.	499.946,21	0,03	-10,26	4,58	-140,68			-3,65	7,69
TOTAL		18.318.656,95								

ITAU UNIBANCO S/A										
Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	1.796.288,99	-2,66	-9,38	-410,83	-128,55	-382,86	-192,07		
Itaú Institucional RF Inflação 5 FIC FI	R.F.	3.983.266,47	-0,46	-0,39	-71,04	-5,37	-66,20	-8,02		
TOTAL		5.779.555,46								

BANCO SANTANDER S/A										
Santander FIC FI IMA-B Títulos Públicos Renda Fixa	R.F.	2.786.095,45	-2,65	-9,24	-410,00	-126,69	-382,08	-189,30		
Santander FIC FI IMA-B Institucional Títulos Públicos RF LP	R.F.	205.326,27	-2,61	-9,13	-404,07	-125,17	-376,56	-187,02		
Santander FIC FI Dividendos VIP Ações	R.V.	696.686,91	1,12	-7,17	172,86	-98,29			-2,57	10,78
TOTAL		3.688.108,63								

TOTAL APLICADO DO PLANO PREVIDENCIÁRIO 320.424.712,83 DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 30/08/2013

TOTAL GERAL APLICADO - (R\$) 1.778.769.258,71 PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO

RESUMO DA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO DE INVESTIMENTO - EM 30/08/2013

PLANO FINANCEIRO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	483.851.696,06	32,74%	-12.310.436,67
FUNDOS DE RENDA FIXA	774.982.753,14	52,43%	-13.674.683,44
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	169.542.593,08	11,47%	2.485.523,46
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	29.967.503,60	2,03%	-9.728,08
SALDO EM CONTAS CORRENTES	19.737.326,80	1,34%	
TOTAIS	1.478.081.872,68	100,00%	-23.509.324,73

PLANO PREVIDENCIÁRIO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	141.279.313,55	45,22%	-5.923.057,63
FUNDOS DE RENDA FIXA	161.248.023,03	51,61%	-3.269.068,74
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	3.935.449,58	1,26%	-4.601,07
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	5.979.704,34	1,91%	19.082,85
SALDO EM CONTAS CORRENTES	5.577,53	0,00%	
TOTAIS	312.448.068,03	100,00%	-9.177.644,59

CONSOLIDAÇÃO DOS PLANO NA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO - AGOSTO DE 2013
PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO

DESCRIÇÃO	VALOR R\$	%	RENDIMENTO TOTAL NO MÊS (R\$)
CARTEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	625.131.009,61	34,91%	-18.233.494,30
FUNDOS DE RENDA FIXA	936.230.776,17	52,29%	-16.943.752,18
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	173.478.042,66	9,69%	2.480.922,39
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	35.947.207,94	2,01%	9.354,77
SALDO EM CONTAS CORRENTES	19.742.904,33	1,10%	
TOTAIS	1.790.529.940,71	100,00%	-32.686.969,32

SIGLAS

R.F. - Renda Fixa
R.V. - Renda Variável
M.M. - Multimercado
CDI - Certificado de Depósito Interfinanceiro
IBOVESPA - Índice da Bolsa de Valores Est. São Paulo

DISPONIBILIDADE POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA - AGOSTO DE 2013

INSTITUIÇÃO	EM FUNDO	EM CONTA CORRENTE	TOTAL BANCO	% POR INSTITUIÇÃO	QTDE. FUNDOS
BANCO DO BRASIL S/A	587.907.449,73	16.033.786,10	603.941.235,83	33,58%	7
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	451.548.536,31	4.264,30	451.552.800,61	25,11%	15
BANCO BRADESCO S/A	292.609.331,97	0,35	292.609.332,32	16,27%	7
ITAU UNIBANCO S/A	140.758.958,17	849,13	140.759.807,30	7,83%	4
BANCO HSBC BANK BRASIL S/A	114.914.159,59	3.704.004,45	118.618.164,04	6,60%	4
BANCO SANTANDER S/A	76.149.476,57	0,00	76.149.476,57	4,23%	3
SCHROEDERS INVESTIMENT	14.610.509,40	0,00	14.610.509,40	0,81%	1
GWJ CONSULT. PARTICIP. E SERV. LTDA.	2.121.941,28	0,00	2.121.941,28	0,12%	1
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	2.069.638,97	0,00	2.069.638,97	0,12%	1
BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A	14.861.382,94	0,00	14.861.382,94	0,83%	1
BANCO BTG PACTUAL	76.082.769,25	0,00	76.082.769,25	4,23%	3
GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S.A.	1.404.769,02	0,00	1.404.769,02	0,08%	1
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA.	1.646.677,41	0,00	1.646.677,41	0,09%	1
PÁTRIA INVESTIMENTOS LTDA	2.083.658,10	0,00	2.083.658,10	0,12%	1
TOTAIS	1.778.769.258,71	19.742.904,33	1.798.512.163,04	100,00%	50

Em agosto de 2013, os índices para atingimento das metas, atuarial e gerencial, são os seguintes:

SEGMENTO	META ATUARIAL (%)			META GERENCIAL (%)		
	INDICE	JUL/13	2013	INDICE	JUL/13	2013
TITULOS PUBLICOS FEDERAIS	INPC(IBGE) + 6% a.a.	0,65	7,30	C.D.I.	0,69	4,88
RENTA FIXA	INPC(IBGE) + 6% a.a.	0,65	7,30	C.D.I.	0,69	4,88
RENTA VARIÁVEL	INPC(IBGE) + 6% a.a.	0,65	7,30	IBOVESPA	3,68	-17,95
RENTA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	INPC(IBGE) + 6% a.a.	0,65	7,30	C.D.I.	0,69	4,88

A Amapá Previdência, seguindo as diretrizes estabelecidas em sua Política de Investimentos e a Resolução nº 3922/2010 do Conselho Monetário Nacional, aplicou seus recursos de maneira diversificada em agosto de 2013, distribuídos em 02 (duas) Carteira de Administradas de Títulos Públicos Federais e 48 (quarenta e oito) Fundos de Investimentos, sendo estes últimos distribuídos em 23 (vinte e três) fundos de renda fixa, 21 (vinte e um) fundos de renda variável e 04 (quatro) fundos multimercado.