

RELATÓRIO DE ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DA AMPREV

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA - DEZEMBRO DE 2013

ALOCAÇÃO DOS RECURSOS DIVERSIFICAÇÃO	E G M E N T O	VALOR R\$	RENTABILIDADE DO FUNDO		EM RELAÇÃO							
					META ATUARIAL		META GERENCIAL					
					INPC + 6%a.a.		CDI		IBOVESPA			
			NO MÊS	NO ANO 2013	NO MÊS	NO ANO 2013	NO MÊS	NO ANO 2013	NO MÊS	NO ANO 2013	NO MÊS	NO ANO 2013

PLANO FINANCEIRO

BANCO DO BRASIL S/A												
Carteira Administrada Banco do Brasil - LFT (POS)		8.414.083,66										
Carteira Administrada Banco do Brasil - NTN-B (POS)	R.F.	463.540.389,41	1,34	-9,32	111,43	-80,58	172,28	-115,69				
Carteira Administrada Banco do Brasil - LTN (PRE)		4.166.037,80										
BB Previdenciário Renda Fixa IMA-B FI	R.F.	214.549,85	1,25	-10,28	103,88	-88,88	160,61	-127,62				
BB Previdenciário Renda Fixa Perfil	R.F.	5.066.181,30	0,79	8,01	65,49	69,31	101,27	99,51				
BB RPPS Renda Fixa Fluxo FIC	R.F.	11.762.902,19	0,72	7,24	59,33	62,58	91,73	89,86				
FIDC da Cia de Saneamento Ambiental do D.F - CAESB	R.F.	9.723.475,59	-4,55	-34,43	-376,69	-297,79	-582,43	-427,56				
BB RPPS Renda Fixa Crédito Privado IPCA II	R.F.	15.551.466,04	1,07	11,95	88,28	103,35	136,50	148,39				
BB RPPS Renda Fixa Crédito Privado IPCA III	R.F.	7.586.849,17	1,04	0,00	85,88	0,00	132,79	0,00				
Brasil Ações Ibovespa Indexado FIC FI	R.V.	18.050.096,37	-1,84	-16,60	-152,09				0,02	-1,10		
Brasil Ações IBrX Indexado FIC FI	R.V.	7.950.281,69	-3,21	-5,45	-265,67	-47,17			-1,35	10,04		
BB Ações Consumo FIC FI	R.V.	3.804.424,99	-1,90	-0,53	-157,41	-4,61			-0,04	14,96		
BB Ações Cielo FI	R.V.	4.370.790,30	-3,21	42,04	-266,44	363,58			-1,36	57,54		
TOTAL		560.201.528,36										

CAIXA ECONOMICA FEDERAL												
FI Caixa Brasil IPCA XI Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	17.836.287,50	1,11	4,36	92,33	37,71	142,75	54,15				
FI Caixa Brasil IPCA XII Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	18.002.425,00	1,13	5,42	93,64	46,88	144,79	67,31				
FI Caixa Brasil IPCA XIII Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	17.493.687,50	0,95	5,29	78,53	45,71	121,42	65,63				
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	4.212.731,80	0,79	8,11	65,12	70,16	100,69	100,73				
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	76.230.547,37	1,21	-9,89	100,68	-85,51	155,67	-122,77				
FI Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos RF LP	R.F.	14.884.776,19	1,15	2,86	95,48	24,78	147,64	35,57				
FIDC da Companhia Estadual de Águas e Esgotos-CEDAE	R.F.	2.788.380,28	-1,73	-15,45	-143,45	-133,63	-221,80	-191,87				
Caixa FI em Ações Brasil IBX-50	R.V.	15.292.071,48	-3,00	-6,81	-248,71	-58,92			-1,14	8,68		
Caixa FIC Ações Valor Dividendos RPPS	R.V.	10.328.601,92	-3,22	-0,27	-266,96	-2,35			-1,36	15,22		
Caixa FI em Ações Caixa Small Caps Ativo	R.V.	915.045,28	-0,46	-9,14	-38,45	-79,01			1,39	6,36		
FI Caixa Brasil IPCA V Multimercado Crédito Privado	M.M.	16.385.362,50	0,99	3,79	82,04	32,78	126,85	47,07				
FI Caixa Brasil IPCA VI Multimercado Crédito Privado	M.M.	6.023.709,20	0,99	3,92	81,69	33,86	126,31	48,62				
FI Caixa Brasil IPCA VIII Multimercado Crédito Privado	M.M.	5.402.259,27	0,98	3,38	81,24	29,27	125,61	42,02				
TOTAL		205.795.885,29										

BANCO BRADESCO S/A												
Bradesco FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	162.324.394,31	1,25	-9,93	103,66	-85,87	160,28	-123,29				
Bradesco FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	89.637.641,83	0,96	-1,70	79,79	-14,69	123,37	-21,09				
Bradesco FI Renda Fixa IMA-B 5+	R.F.	1.235.679,24	1,39	-17,08	115,44	-147,68	178,50	-212,03				
Bradesco FI em Ações Infra-Estrutura	R.V.	16.647.900,94	-2,00	-8,62	-165,43	-74,57			-0,14	6,87		
Bradesco FI em Ações Dividendos	R.V.	2.132.681,58	-2,92	-3,87	-242,38	-33,51			-1,07	11,62		
Bradesco FI em Ações Small Cap Plus	R.V.	1.000.009,67	-1,82	-4,14	-151,09	-35,78			0,04	11,36		
Bradesco FI Multimercado Plus I	M.M.	1.277.813,26	0,72	7,14	59,86	61,78	92,6	88,70				
TOTAL		274.256.120,83										

ITAU UNIBANCO S/A												
Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	83.664.899,48	1,27	-10,46	105,59	-90,46	163,25	-129,88				
Itaú Institucional RF Inflação 5 FIC FI	R.F.	13.851.972,78	1,14	2,36	94,33	20,45	145,85	29,36				
Itaú RPI Ações Ibovespa Index FIC FI em Ações	R.V.	37.289.839,26	-1,89	-1,17	-156,64	-10,08			-0,03	14,33		
FIC FIP Kinea Private Equity II	R.V.	1.554.982,60	-0,76	-6,36	-63,27	-54,99			1,09	9,14		
Itaú Ações Consumo FI	R.V.	3.829.762,12	-1,71	-2,12	-141,38	-18,34			0,15	13,38		
TOTAL		140.191.456,24										

BANCO HSBC BANK BRASIL S/A												
Hsbc FI Renda Fixa Regimes de Previdência Ativo	R.F.	102.000.041,61	1,30	-1,91	107,95	-16,55	166,90	-23,76				
Hsbc FI em Ações Ibovespa Top	R.V.	15.163.325,95	-2,02	-14,24	-167,07	-123,16			-0,16	1,25		
Hsbc FI Ações Ibovespa Kazan Plus	R.V.	3.510.255,64	-3,49	-11,17	-288,87	-96,57			-1,63	4,33		
Hsbc FI de Ações Small Caps	R.V.	914.694,73	-2,49	-8,46	-206,34	-73,17			-0,63	7,04		
TOTAL		121.588.317,93										

BANCO SANTANDER S/A												
Santander FIC FI IMA-B Títulos Públicos Renda Fixa	R.F.	60.977.292,17	1,27	-10,63	104,88	-91,96	162,16	-132,03				
Santander FIC FI IMA-B Institucional Títulos Públicos RF LP	R.F.	8.320.954,15	1,28	-10,46	106,24	-90,48	164,26	-129,92				
Santander FIC FI Dividendos VIP Ações	R.V.	1.556.634,01	-3,10	-4,12	-256,97	-35,64			-1,24	11,37		
TOTAL		70.854.880,33										

SCHRODERS INVESTMENT												
Schroder FI em Ações IBrX-50	R.V.	15.102.787,25	-3,57	-9,14	-295,83	-79,01			-1,71	6,36		
TOTAL		15.102.787,25										

GWJ CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.												
GWJ Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	501.489,17	-1,65	-1,78	-137,01	-15,39			0,21	13,72		
TOTAL		501.489,17										

BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.												
BNP Paribas Grand Prix Fundo de Investimento Ações	R.V.	2.136.146,28	-2,85	-14,83	-236,35	-128,22			-0,99	0,67		
TOTAL		2.136.146,28										

BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A												
FIDC Aberto CPP540 RPPS	R.F.	12.388.358,59	1,25	11,16	103,46	96,54	159,97	138,61				
TOTAL		12.388.358,59										

BANCO BTG PACTUAL												
BTG Pactual FI RF IMA B	R.F.	20.497.212,67	1,34	-10,85	111,24	-93,86	172,00	-134,76				
BTG Pactual IPCA FI Renda Fixa	R.F.	14.041.944,32	1,11	1,17	92,24	10,13	142,61	14,55				
BTG Pactual Dividendos FI de Ações	R.V.	24.467.355,22	-2,52	1,53	-209,13	13,19			-0,66	17,02		
TOTAL		59.006.512,21										

GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S.A.												
Geração Futuro Dividendos FIA	R.V.	1.538.610,93	-3,44	0,68	-284,87	5,91			-1,58	16,18		
TOTAL		1.538.610,93										

QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA.

Queluz Valor Fundo de Investimento em Ações	R.V.	1.700.341,25	-1,93	-1,97	-159,77	-17,07				-0,07	13,52
TOTAL		1.700.341,25									

PATRIA INVESTIMENTOS LTDA.

Patria Special Opportunities I FIQ FI	R.V.	3.108.018,03	-1,55	14,49	-128,12	125,33				0,31	29,99
TOTAL		3.108.018,03									

QUEST INVESTIMENTOS

Quest Small Fiq Fia	R.V.	3.936.170,62	-0,85	4,62	-70,75	39,94				1,00	20,11
TOTAL		3.936.170,62									

TOTAL APLICADO DO PLANO FINANCEIRO	1.472.306.623,31	DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 31/12/2013
---	-------------------------	---

PLANO PREVIDENCIÁRIO
CAIXA ECONOMICA FEDERAL

Carteira Administrada Caixa Economica - NTN-B (POS)	R.F.	136.284.572,72	0,81	-16,78	67,13	-145,12	103,79	-208,37			
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	78.566.735,56	1,21	-9,89	100,68	-85,51	155,67	-122,77			
FI Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos RF LP	R.F.	4.112.522,53	1,15	2,86	95,48	24,78	147,64	35,57			
FI Caixa Brasil IPCA XV Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	5.857.824,54	0,99	5,00	82,23	43,27	127,14	62,13			
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	7.079.845,43	0,79	8,11	65,12	70,16	100,69	100,73			
Caixa FI em Ações Caixa Small Caps Ativo	R.V.	490.510,02	-0,46	-9,14	-38,45	-79,01				1,39	6,36
FI Caixa Brasil IPCA VI Multimercado Crédito Privado	M.M.	5.780.484,30	0,99	3,92	81,69	33,86	126,31	48,62			
TOTAL		238.172.495,10									

BANCO DO BRASIL S/A

BB Previdenciário Renda Fixa IMA-B FI	R.F.	23.236.169,21	1,25	-10,28	103,88	-88,88	160,61	-127,62			
BB RPPS Renda Fixa Fluxo FIC	R.F.	1.485.333,59	0,72	7,24	59,33	62,58	91,73	89,86			
BB RPPS Renda Fixa Crédito Privado IPCA III	R.F.	4.578.522,03	1,04	0,00	85,88	0,00	132,79	0,00			
TOTAL		29.300.024,83									

GWJ CONSULTORIA, PARTICIPAÇÕES E SERVIÇOS LTDA.

GWJ Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	1.447.046,96	-1,65	-1,78	-137,01	-15,39				0,21	13,72
TOTAL		1.447.046,96									

BANCO BTG PACTUAL

BTG Pactual IPCA FI Renda Fixa	R.F.	14.942.396,68	1,11	1,17	92,24	10,13	142,61	14,55			
BTG Pactual FI RF IMA B	R.F.	3.390.374,29	1,34	-10,85	111,24	-93,86	172,00	-134,76			
TOTAL		18.332.770,97									

BANCO BRADESCO S/A

Bradesco FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	11.251.478,79	1,25	-9,93	103,66	-85,87	160,28	-123,29			
Bradesco FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	5.188.972,08	0,96	-1,70	79,79	-14,69	123,37	-21,09			
Bradesco FI Renda Fixa IMA-B 5+	R.F.	600.741,64	1,39	-17,08	115,44	-147,68	178,50	-212,03			
Bradesco FI em Ações Dividendos	R.V.	736.534,02	-2,92	-3,87	-242,38	-33,51				-1,07	11,62
Bradesco FI em Ações Small Cap Plus	R.V.	534.073,89	-1,82	-4,14	-151,09	-35,78				0,04	11,36
TOTAL		18.311.800,42									

ITAU UNIBANCO S/A

Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	1.774.844,58	1,27	-10,46	105,59	-90,46	163,25	-129,88			
Itaú Institucional RF Inflação 5 FIC FI	R.F.	4.093.495,48	1,14	2,36	94,33	20,45	145,85	29,36			
TOTAL		5.868.340,06									

BANCO SANTANDER S/A

Santander FIC FI IMA-B Títulos Públicos Renda Fixa	R.F.	2.743.413,92	1,27	-10,63	104,88	-91,96	162,16	-132,03			
Santander FIC FI IMA-B Institucional Títulos Públicos RF LP	R.F.	202.318,35	1,28	-10,46	106,24	-90,48	164,26	-129,92			
Santander FIC FI Dividendos VIP Ações	R.V.	719.572,16	-3,10	-4,12	-256,97	-35,64				-1,24	11,37
TOTAL		3.665.304,43									

TOTAL APLICADO DO PLANO PREVIDENCIÁRIO	315.097.782,77	DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 31/12/2013
---	-----------------------	---

TOTAL GERAL APLICADO - (R\$)	1.787.404.406,08	PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO
-------------------------------------	-------------------------	--

RESUMO DA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO DE INVESTIMENTO - EM 31/12/2013
PLANO FINANCEIRO

DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	476.120.510,87	32,33%	6.355.920,35
FUNDOS DE RENDA FIXA	770.294.650,93	52,31%	9.041.067,46
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	196.802.317,28	13,36%	-4.779.057,14
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	29.089.144,23	1,98%	281.013,89
SALDO EM CONTAS CORRENTES	231.697,03	0,02%	
TOTAIS	1.472.538.320,34	100,00%	10.898.944,56

PLANO PREVIDENCIÁRIO

DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	136.284.572,72	43,22%	1.088.358,34
FUNDOS DE RENDA FIXA	169.104.988,70	53,63%	1.954.813,57
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	3.927.737,05	1,25%	-81.745,80
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	5.780.484,30	1,83%	56.423,09
SALDO EM CONTAS CORRENTES	208.043,84	0,07%	
TOTAIS	315.305.826,61	100,00%	3.017.849,20

**CONSOLIDAÇÃO DOS PLANOS NA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO - DEZEMBRO DE 2013
PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO**

DESCRIÇÃO	VALOR R\$	%	RENDIMENTO TOTAL NO MÊS (R\$)
CARTEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	612.405.083,59	34,25%	7.444.278,69
FUNDOS DE RENDA FIXA	939.399.639,63	52,54%	10.995.881,03
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	200.730.054,33	11,23%	-4.860.802,94
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	34.869.628,53	1,95%	337.436,98
SALDO EM CONTAS CORRENTES	439.740,87	0,02%	
TOTAIS	1.787.844.146,95	100,00%	13.916.793,76

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 - DEZEMBRO DE 2013

INSTITUIÇÃO	EM FUNDO	EM CONTA CORRENTE	TOTAL BANCO	% POR INSTITUIÇÃO	QTDE. FUNDOS
BANCO DO BRASIL S/A	589.501.553,19	430.620,04	589.932.173,23	33,00%	11
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	443.968.380,39	4.264,30	443.972.644,69	24,83%	15
BANCO BRADESCO S/A	292.567.921,25	2,95	292.567.924,20	16,36%	7
ITAU UNIBANCO S/A	146.059.796,30	849,13	146.060.645,43	8,17%	5
BANCO HSBC BANK BRASIL S/A	121.588.317,93	4.004,45	121.592.322,38	6,80%	4
BANCO SANTANDER S/A	74.520.184,76	0,00	74.520.184,76	4,17%	3
SCHROEDERS INVESTIMENT	15.102.787,25	0,00	15.102.787,25	0,84%	1
GWÍ CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.	1.948.536,13	0,00	1.948.536,13	0,11%	1
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	2.136.146,28	0,00	2.136.146,28	0,12%	1
BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A	12.388.358,59	0,00	12.388.358,59	0,69%	1
BANCO BTG PACTUAL	77.339.283,18	0,00	77.339.283,18	4,33%	3
GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S.A.	1.538.610,93	0,00	1.538.610,93	0,09%	1
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA.	1.700.341,25	0,00	1.700.341,25	0,10%	1
PÁTRIA INVESTIMENTOS LTDA	3.108.018,03	0,00	3.108.018,03	0,17%	1
QUEST SMALL FIQ FIA	3.936.170,62	0,00	3.936.170,62	0,22%	1
TOTAIS	1.787.404.406,08	439.740,87	1.787.844.146,95	100,00%	56

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

SEGMENTO	META ATUARIAL (%)			META GERENCIAL (%)		
	ÍNDICE	DEZ/13	2013	ÍNDICE	DEZ/13	2013
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	INPC(ÍBGE) + 6% a.a.	1,21	11,56	C.D.I.	0,78	8,05
RENDA FIXA	INPC(ÍBGE) + 6% a.a.	1,21	11,56	C.D.I.	0,78	8,05
RENDA VARIÁVEL	INPC(ÍBGE) + 6% a.a.	1,21	11,56	IBOVESPA	-1,86	-15,50
RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	INPC(ÍBGE) + 6% a.a.	1,21	11,56	C.D.I.	0,78	8,05

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 dezembro de 2013, distribuídos em 02 (duas) Carteira de Administradas de Títulos Públicos Federais e 54 (cinquenta e quatro) Fundos de Investimentos, sendo estes últimos distribuídos em 25 (vinte e cinco) fundos de renda fixa, 25 (vinte e cinco) fundos de renda variável e 04 (quatro) fundos multimercado.