

RELATORIO DE ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DA AMPREV
CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA - JULHO 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
PLANO FINANCEIRO										
BANCO DO BRASIL S/A										
Carteira Administrada Banco do Brasil - LFT (POS)		23.089.811,34								
Carteira Administrada Banco do Brasil - NTN-B (POS)	R.F.	451.839.890,22	1,37	-5,45	384,74	-82,17	194,15	-130,91		
Carteira Administrada Banco do Brasil - LTN (PRE)		1.226.327,78								
BB Previdenciário Renda Fixa IMA-B FI	R.F.	68.704,82	1,22	-6,71	341,92	-101,22	172,54	-161,25		
BB RPPS Renda Fixa Fluxo FIC	R.F.	60.602.142,74	0,64	3,72	179,33	56,18	90,50	89,49		
FIDC da Cia de Saneamento Ambiental do D.F - CAESB	R.F.	11.953.994,55	3,34	-19,39	936,28	-292,63	472,47	-466,18		
BB RPPS Renda Fixa Crédito Privado IPCA II	R.F.	15.394.865,74	1,44	10,82	403,38	163,32	203,56	260,19		
Brasil Ações Ibovespa Indexado FIC FI	R.V.	16.952.753,50	1,63	-21,67	455,52				-0,01	-0,80
Brasil Ações IBR-X Indexado FIC FI	R.V.	7.486.035,92	1,64	-10,97	460,50	-165,61			0,00	9,89
TOTAL		588.614.526,61								
CAIXA ECONOMICA FEDERAL										
FI Caixa Brasil IPCA XI Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	18.201.475,00	0,38	6,50	105,72	98,05	53,35	156,20		
FI Caixa Brasil IPCA XII Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	18.183.225,00	0,38	6,48	106,41	97,78	53,70	155,77		
FI Caixa Brasil IPCA XIII Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	17.757.062,50	0,52	6,87	147,13	103,67	74,25	165,16		
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	63.526,95	0,72	4,25	201,11	64,15	101,49	102,20		
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	79.187.140,57	1,36	-6,39	381,60	-96,46	192,56	-153,67		
FI Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos RF LP	R.F.	10.521.591,60	0,84	0,47	234,53	7,11	118,35	11,33		
FIDC da Companhia Estadual de Águas e Esgotos-CEDAE	R.F.	3.016.052,82	-1,38	-8,55	-385,96	-129,00	-194,76	-205,50		
Caixa FI em Ações Brasil IBX-50	R.V.	14.282.726,91	1,19	-12,96	334,07	-195,62			-0,45	7,90
Caixa FIC Ações Valor Dividendos RPPS	R.V.	10.214.042,10	1,25	-1,38	349,90	-20,80			-0,39	19,49
Caixa FI em Ações Caixa Small Caps Ativo	R.V.	870.877,58	0,76	-13,52	213,24	-204,05			-0,88	7,34
FI Caixa Brasil IPCA V Multimercado Crédito Privado	M.M.	16.923.700,00	0,57	7,20	160,07	108,66	80,77	173,10		
FI Caixa Brasil IPCA VI Multimercado Crédito Privado	M.M.	6.211.426,00	0,57	7,15	160,62	107,95	81,05	171,98		
FI Caixa Brasil IPCA VIII Multimercado Crédito Privado	M.M.	5.603.923,17	0,56	7,24	156,96	109,30	79,20	174,13		
TOTAL		201.036.770,20								
BANCO BRADESCO S/A										
Bradesco FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	168.396.632,76	1,40	-6,56	393,03	-98,98	198,33	-157,68		
Bradesco FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	85.640.711,21	1,23	-1,69	345,99	-25,48	174,59	-40,60		
Bradesco FI Renda Fixa IMA-B 5+	R.F.	1.335.726,11	1,51	-10,36	422,91	-156,36	213,41	-249,09		
Bradesco FI em Ações Infra-Estrutura	R.V.	16.483.963,86	1,36	-9,52	382,05	-143,70			-0,28	11,34
Bradesco FI em Ações Dividendos	R.V.	2.048.456,15	1,36	-7,67	380,82	-115,76			-0,28	13,19
Bradesco FI em Ações Small Cap Plus	R.V.	935.831,01	1,77	-10,29	494,94	-155,27			0,13	10,58
Bradesco FI Multimercado Plus I	M.M.	1.238.182,51	0,67	3,82	186,53	57,65	94,1	91,85		
TOTAL		276.079.503,61								
ITAU UNIBANCO S/A										
Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	86.986.828,62	1,25	-6,90	349,56	-104,19	176,40	-165,99		
Itaú Institucional RF Inflação 5 FIC FI	R.F.	9.539.528,86	0,84	0,07	234,36	1,03	118,26	1,63		
Itaú RPI Ações Ibovespa Index FIC FI em Ações	R.V.	34.423.655,55	2,07	-8,76	580,58	-132,22			0,43	12,10
FIC FIP Kinea Private Equity II	R.V.	1.615.042,43	-1,11	-2,74	-311,42	-41,37			-2,75	18,12
TOTAL		132.565.055,46								
BANCO HSBC BANK BRASIL S/A										
Hsbc FI Renda Fixa Regimes de Previdência Ativo	R.F.	100.665.377,43	0,84	-3,20	236,69	-48,24	119,44	-76,85		
Hsbc FI em Ações Ibovespa Top	R.V.	17.694.790,97	1,46	-21,56	409,79	-325,34			-0,18	-0,69
Hsbc FI Ações Ibovespa Kazan Plus	R.V.	3.286.818,22	2,13	-16,82	595,80	-253,83			0,49	4,04
Hsbc FI de Ações Small Caps	R.V.	894.572,34	0,12	-10,47	33,40	-158,06			-1,52	10,39
TOTAL		122.541.558,96								
BANCO SANTANDER S/A										
Santander FIC FI IMA-B Títulos Públicos Renda Fixa	R.F.	64.212.103,39	1,38	-6,77	386,43	-102,17	195,00	-162,77		
Santander FIC FI IMA-B Institucional Títulos Públicos RF LP	R.F.	8.671.251,44	1,37	-6,69	385,30	-101,00	194,43	-160,90		
Santander FIC FI Dividendos VIP Ações	R.V.	1.490.465,25	0,99	-8,20	276,58	-123,69			-0,65	12,67
TOTAL		74.373.820,08								
SCHROEDERS INVESTIMENT										
Schroder FI em Ações IBR-X-50	R.V.	26.160.667,35	0,78	-13,89	218,42	-209,65			-0,86	6,97
TOTAL		26.160.667,35								
GWI CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.										
GWI Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	546.521,42	23,28	7,04	6.525,80	106,25			21,64	27,91
TOTAL		546.521,42								
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.										
BNP Paribas Grand Prix Fundo de Investimento Ações	R.V.	2.058.987,12	0,72	-17,90	203,20	-270,16			-0,91	2,96
TOTAL		2.058.987,12								
BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A										
FIDC Aberto CPP540 RPPS	R.F.	15.094.685,56	0,53	5,76	147,39	86,88	74,37	138,40		
TOTAL		15.094.685,56								
BANCO BTG PACTUAL										
BTG Pactual FI RF IMA B	R.F.	21.528.008,29	1,40	-6,37	391,91	-96,11	197,77	-153,11		
BTG Pactual IPCA FI Renda Fixa	R.F.	9.716.781,91	0,91	-1,05	255,01	-15,81	128,68	-25,18		
BTG Pactual Dividendos FI de Ações	R.V.	23.842.754,07	0,00	-1,07	1,12	-16,09			-1,63	19,80
TOTAL		55.087.544,27								
GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S.A.										
Geração Futuro Dividendos FIA	R.V.	1.413.766,45	0,66	-7,49	184,75	-112,97			-0,98	13,38
TOTAL		1.413.766,45								
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA.										
Queluz Valor Fundo de Investimento em Ações	R.V.	1.657.244,09	0,20	-4,46	55,00	-67,28			-1,44	16,41
TOTAL		1.657.244,09								
PATRIA INVESTIMENTOS LTDA.										
Patria Special Opportunities I FIQ FI	R.V.	2.097.097,33	-0,65	-2,87	-181,86	-43,32			-2,29	17,99
TOTAL		2.097.097,33								
TOTAL APLICADO DO PLANO FINANCEIRO		1.499.327.748,51								
DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 31/07/2013										

PLANO PREVIDENCIÁRIO

CAIXA ECONOMICA FEDERAL										
Carteira Administrada Caixa Economica - NTN-B (POS)	R.F.	149.992.718,39	1,88	-10,19	527,01	-153,75	265,94	-244,94		
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	78.833.517,18	1,36	-6,39	381,60	-96,46	192,56	-153,67		
FI Caixa Brasil IPCA XV Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	5.964.047,31	0,51	6,91	142,21	104,24	71,76	166,06		
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	2.828.250,91	0,72	4,25	201,11	64,15	101,49	102,20		
Caixa FI em Ações Caixa Small Caps Ativo	R.V.	466.833,92	0,76	-13,52	213,24	-204,05			-0,88	7,34
FI Caixa Brasil IPCA VI Multimercado Crédito Privado	M.M.	5.960.621,49	0,57	7,15	160,62	107,95	81,05	171,98		
TOTAL		244.045.989,20								

BANCO DO BRASIL S/A										
BB Previdenciário Renda Fixa IMA-B FI	R.F.	21.032.174,71	1,22	-6,71	341,92	-101,22	172,54	-161,25		
BB RPPS Renda Fixa Fluxo FIC	R.F.	25.352.793,35	0,64	3,72	179,33	56,18	90,50	89,49		
TOTAL		46.384.968,06								

GWJ CONSULTORIA, PARTICIPAÇÕES E SERVIÇOS LTDA.										
GWJ Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	1.576.987,51	23,28	7,04	6.525,80	106,25			21,64	27,91
TOTAL		1.576.987,51								

BANCO BTG PACTUAL										
BTG Pactual IPCA FI Renda Fixa	R.F.	10.597.480,81	0,91	-1,05	255,01	-15,81	128,68	-25,18		
BTG Pactual FI RF IMA B	R.F.	3.560.874,70	1,40	-6,37	391,91	-96,11	197,77	-153,11		
TOTAL		14.158.355,51								

BANCO BRADESCO S/A										
Bradesco FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	11.672.374,62	1,40	-6,56	393,03	-98,98	198,33	-157,68		
Bradesco FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	1.183.442,27	1,23	-1,69	345,99	-25,48	174,59	-40,60		
Bradesco FI Renda Fixa IMA-B 5+	R.F.	649.380,74	1,51	-10,36	422,91	-156,36	213,41	-249,09		
Bradesco FI em Ações Dividendos	R.V.	707.446,27	1,36	-7,67	380,82	-115,76			-0,28	13,19
Bradesco FI em Ações Small Cap Plus	R.V.	499.798,07	1,77	-10,29	494,94	-155,27			0,13	10,58
TOTAL		14.712.441,97								

ITAU UNIBANCO S/A										
Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	1.845.315,09	1,25	-6,90	349,56	-104,19	176,40	-165,99		
TOTAL		1.845.315,09								

BANCO SANTANDER S/A										
Santander FIC FI IMA-B Títulos Públicos Renda Fixa	R.F.	2.861.978,25	1,38	-6,77	386,43	-102,17	195,00	-162,77		
Santander FIC FI IMA-B Institucional Títulos Públicos RF LP	R.F.	210.835,59	1,37	-6,69	385,30	-101,00	194,43	-160,90		
Santander FIC FI Dividendos VIP Ações	R.V.	688.984,88	0,99	-8,20	276,58	-123,69			-0,65	12,67
TOTAL		3.761.798,72								

TOTAL APLICADO DO PLANO PREVIDENCIÁRIO 326.485.856,06 DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 31/07/2013

TOTAL GERAL APLICADO - (R\$) 1.825.813.604,57 PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO

RESUMO DA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO DE INVESTIMENTO - EM 31/07/2013

PLANO FINANCEIRO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	476.156.029,34	31,75%	6.489.454,64
FUNDOS DE RENDA FIXA	806.737.417,87	53,80%	8.971.322,24
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	186.457.069,62	12,43%	2.297.356,89
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	29.977.231,68	2,00%	170.862,16
SALDO EM CONTAS CORRENTES	285.114,71	0,02%	
TOTAIS	1.499.612.863,22	100,00%	17.928.995,93

PLANO PREVIDENCIÁRIO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	149.992.718,39	45,94%	2.811.553,33
FUNDOS DE RENDA FIXA	166.592.465,53	51,02%	1.905.877,66
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	3.940.050,65	1,21%	326.201,35
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	5.960.621,49	1,83%	33.958,92
SALDO EM CONTAS CORRENTES	17.894,57	0,01%	
TOTAIS	326.503.750,63	100,00%	5.077.591,26

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

DESCRIÇÃO	VALOR R\$	%	RENDIMENTO TOTAL NO MÊS (R\$)
CARTEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	626.148.747,73	34,29%	9.301.007,97
FUNDOS DE RENDA FIXA	973.329.883,40	53,30%	10.877.199,90
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	190.397.120,27	10,43%	2.623.558,24
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	35.937.853,17	1,97%	204.821,08
SALDO EM CONTAS CORRENTES	303.009,28	0,02%	
TOTAIS	1.826.116.613,85	100,00%	23.006.587,19

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 - JULHO DE 2013

INSTITUIÇÃO	EM FUNDO	EM CONTA CORRENTE	TOTAL BANCO	% POR INSTITUIÇÃO	QTDE. FUNDOS
BANCO DO BRASIL S/A	634.999.494,67	293.888,55	635.293.383,22	34,79%	7
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	445.082.759,40	4.264,30	445.087.023,70	24,37%	15
BANCO BRADESCO S/A	290.791.945,58	0,35	290.791.945,93	15,92%	7
ITAU UNIBANCO S/A	134.410.370,55	851,63	134.411.222,18	7,36%	4
BANCO HSBC BANK BRASIL S/A	122.541.558,96	4.004,45	122.545.563,41	6,71%	4
BANCO SANTANDER S/A	78.135.618,80	0,00	78.135.618,80	4,28%	3
SCHROEDERS INVESTIMENT	26.160.667,35	0,00	26.160.667,35	1,43%	1
GWJ CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.	2.123.508,93	0,00	2.123.508,93	0,12%	1
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	2.058.987,12	0,00	2.058.987,12	0,11%	1
BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A	15.094.685,56	0,00	15.094.685,56	0,83%	1
BANCO BTG PACTUAL	69.245.899,78	0,00	69.245.899,78	3,79%	3
GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S.A.	1.413.766,45	0,00	1.413.766,45	0,08%	1
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA.	1.657.244,09	0,00	1.657.244,09	0,09%	1
PÁTRIA INVESTIMENTOS LTDA	2.097.097,33	0,00	2.097.097,33	0,11%	1
TOTAIS	1.825.813.604,57	303.009,28	1.826.116.613,85	100,00%	50

Em julho 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.	0,36	6,63	C.D.I.	0,71	4,16
RENTA FIXA	INPC(IBGE) + 6% a.a.	0,36	6,63	C.D.I.	0,71	4,16
RENTA VARIÁVEL	INPC(IBGE) + 6% a.a.	0,36	6,63	IBOVESPA	1,64	-20,86
RENTA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	INPC(IBGE) + 6% a.a.	0,36	6,63	C.D.I.	0,71	4,16

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 julho 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.