

RELATÓRIO DE ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DA AMPREV
CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA - JUNHO 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 MES	NO ANO 2013	NO MES	NO ANO 2013	NO MES	NO ANO 2013	NO MES	NO ANO 2013
PLANO FINANCEIRO										
BANCO DO BRASIL S/A										
Carteira Administrada Banco do Brasil - LFT (POS)		22.925.002,47								
Carteira Administrada Banco do Brasil - NTN-B (POS)	R.F.	438.421.991,25	-3,92	-6,73	-510,77	-107,44	-661,70	-196,16		
Carteira Administrada Banco do Brasil - LTN (PRE)		8.319.258,36								
BB Previdenciário Renda Fixa IMA-B FI	R.F.	67.876,89	-2,77	-7,83	-361,60	-125,11	-468,45	-228,43		
BB RPPS Renda Fixa Fluxo FIC	R.F.	57.111.807,32	0,53	3,06	69,34	48,93	89,84	89,35		
FIDC da Cia de Saneamento Ambiental do D.F - CAESB	R.F.	12.370.725,62	3,34	-16,58	435,54	-264,89	564,24	-483,64		
BB RPPS Renda Fixa Crédito Privado IPCA II	R.F.	15.176.478,07	3,49	9,25	455,44	147,78	590,02	269,82		
Brasil Ações Ibovespa Indexado FIC FI	R.V.	16.811.676,19	-11,35	-22,92	-1.479,91				-0,04	-0,78
Brasil Ações IBR Indexado FIC FI	R.V.	7.365.046,79	-9,13	-12,41	-1.190,91	-198,30			2,17	9,73
TOTAL		578.439.862,96								
CAIXA ECONOMICA FEDERAL										
FI Caixa Brasil IPCA XI Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	18.133.087,50	0,56	6,10	73,30	97,40	94,96	177,84		
FI Caixa Brasil IPCA XII Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	18.114.462,50	0,56	6,08	73,33	97,07	95,00	177,24		
FI Caixa Brasil IPCA XIII Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	17.664.350,00	0,60	6,31	78,89	100,84	102,20	184,11		
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	63.074,44	0,60	3,51	78,16	56,05	101,26	102,34		
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	78.123.661,80	-2,93	-7,65	-381,60	-122,20	-494,36	-223,11		
FI Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos RF LP	R.F.	10.434.292,61	-0,52	-0,36	-67,48	-5,79	-87,43	-10,57		
FIDC da Companhia Estadual de Águas e Esgotos-CEDAE	R.F.	3.058.158,46	-1,38	-7,27	-180,25	-116,16	-233,52	-212,09		
Caixa FI em Ações Valor IBX-50	R.V.	14.114.518,68	-8,55	-13,99	-1.115,18	-223,46			2,75	8,15
Caixa FIC Ações Valor Dividendos RPPS	R.V.	10.088.120,81	-5,74	-2,59	-748,50	-41,44			5,57	19,55
Caixa FI em Ações Caixa Small Caps Ativo	R.V.	864.302,99	-10,18	-14,17	-1.326,94	-226,44			1,13	7,97
FI Caixa Brasil IPCA V Multimercado Crédito Privado	M.M.	16.827.612,50	0,60	6,59	78,69	105,30	101,94	192,26		
FI Caixa Brasil IPCA VI Multimercado Crédito Privado	M.M.	6.176.038,20	0,60	6,54	78,67	104,53	101,91	190,85		
FI Caixa Brasil IPCA VIII Multimercado Crédito Privado	M.M.	5.572.720,87	0,59	6,65	77,04	106,17	99,81	193,85		
TOTAL		199.234.401,36								
BANCO BRADESCO S/A										
Bradesco FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	166.068.244,29	-3,03	-7,85	-394,82	-125,42	-511,49	-228,99		
Bradesco FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	84.596.576,32	-1,61	-2,89	-210,01	-46,12	-272,07	-84,21		
Bradesco FI Renda Fixa IMA-B 5+	R.F.	1.315.873,86	-4,08	-11,69	-532,51	-186,80	-689,87	-341,07		
Bradesco FI em Ações Infra-Estrutura	R.V.	16.262.325,21	-8,18	-10,74	-1.066,50	-171,56			3,13	11,40
Bradesco FI em Ações Dividendos	R.V.	2.021.000,47	-7,20	-8,91	-938,79	-142,31			4,11	13,23
Bradesco FI em Ações Small Cap Plus	R.V.	919.594,64	-7,96	-11,85	-1.038,27	-189,24			3,34	10,29
Bradesco FI Multimercado Plus I	M.M.	1.229.997,95	0,44	3,13	56,88	50,07	73,7	91,42		
TOTAL		272.413.612,74								
ITAU UNIBANCO S/A										
Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	85.915.481,78	-2,91	-8,05	-379,22	-128,62	-491,27	-234,83		
Itaú Institucional RF Inflação 5 FIC FI	R.F.	9.460.437,50	-0,69	-0,76	-89,35	-12,17	-115,76	-22,22		
Itaú RPI Ações Ibovespa Index FIC FI em Ações	R.V.	33.725.162,69	-7,88	-10,61	-1.027,49	-169,54			3,43	11,53
FIC FIP Kinea Private Equity II	R.V.	1.633.185,83	6,97	-1,65	908,92	-26,34			18,28	20,49
TOTAL		130.734.267,80								
BANCO HSBC BANK BRASIL S/A										
Hsbc FI Renda Fixa Regimes de Previdência Ativo	R.F.	99.822.508,37	-1,38	-4,01	-179,30	-64,01	-232,28	-116,88		
Hsbc FI em Ações Ibovespa Top	R.V.	17.439.845,32	-11,27	-22,69	-1.469,76	-362,46			0,03	-0,55
Hsbc FI Ações Ibovespa Kazan Plus	R.V.	3.218.413,99	-11,53	-18,55	-1.503,10	-296,36			-0,22	3,59
Hsbc FI de Ações Small Caps	R.V.	893.507,85	-8,74	-10,58	-1.140,15	-169,02			2,56	11,56
TOTAL		121.374.275,53								
BANCO SANTANDER S/A										
Santander FIC FI IMA-B Títulos Públicos Renda Fixa	R.F.	63.338.959,96	-2,98	-8,04	-388,47	-128,41	-503,25	-234,45		
Santander FIC FI IMA-B Institucional Títulos Públicos RF LP	R.F.	8.553.683,12	-2,97	-7,96	-387,12	-127,13	-501,51	-232,12		
Santander FIC FI Dividendos VIP Ações	R.V.	1.475.903,43	-7,39	-9,09	-964,18	-145,27			3,91	13,05
TOTAL		73.368.546,51								
SCHRODERS INVESTIMENT										
Schroder FI em Ações IBR-X-50	R.V.	25.958.406,89	-9,13	-14,56	-1.190,18	-232,58			2,18	7,58
TOTAL		25.958.406,89								
GWÍ CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.										
GWÍ Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	443.318,38	-7,00	-13,17	-912,35	-210,42			4,31	8,97
TOTAL		443.318,38								
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.										
BNP Paribas Grand Prix Fundo de Investimento Ações	R.V.	2.044.169,05	-10,30	-18,49	-1.342,91	-295,43			1,01	3,65
TOTAL		2.044.169,05								
BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A										
FIDC Aberto CPP540 RPPS	R.F.	16.894.157,25	0,61	5,20	79,93	83,13	103,55	151,78		
TOTAL		16.894.157,25								
BANCO BTG PACTUAL										
BTG Pactual FI RF IMA B	R.F.	21.231.180,25	-2,75	-7,66	-358,43	-122,37	-464,34	-223,42		
BTG Pactual IPCA FI Renda Fixa	R.F.	9.629.185,75	-1,11	-1,94	-144,37	-30,98	-187,03	-56,57		
BTG Pactual Dividendos FI de Ações	R.V.	23.841.798,30	-5,82	-1,07	-759,18	-17,09			5,48	21,07
TOTAL		54.702.164,30								
GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S.A.										
Geração Futuro Dividendos FIA	R.V.	1.385.866,38	-5,48	-8,09	-714,73	-129,27			5,82	14,05
TOTAL		1.385.866,38								
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA.										
Queluz Valor Fundo de Investimento em Ações	R.V.	1.653.998,79	-4,62	-4,65	-602,73	-74,22			6,68	17,49
TOTAL		1.653.998,79								
PÁTRIA INVESTIMENTOS LTDA.										
Pátria Special Opportunities I FIQ FI	R.V.	2.110.790,92	0,94	-2,24	123,09	-35,73			12,25	19,90
TOTAL		2.110.790,92								
TOTAL APLICADO DO PLANO FINANCEIRO		1.480.757.838,86								
DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 28/06/2013										

PLANO PREVIDENCIÁRIO

CAIXA ECONOMICA FEDERAL										
Carteira Administrada Caixa Economica - NTN-B (POS)	R.F.	149.475.181,01	-3,52	-11,85	-459,01	-189,24	-594,65	-345,52		
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	75.501.056,16	-2,93	-7,65	-381,60	-122,20	-494,36	-223,11		
FI Caixa Brasil IPCA XV Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	5.933.943,76	0,58	6,37	76,20	101,73	98,72	185,74		
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	2.808.104,76	0,60	3,51	78,16	56,05	101,26	102,34		
Caixa FI em Ações Caixa Small Caps Ativo	R.V.	463.309,62	-10,18	-14,17	-1.326,94	-226,44			1,13	7,97
FI Caixa Brasil IPCA VI Multimercado Crédito Privado	M.M.	5.926.662,57	0,60	6,54	78,67	104,53	101,91	190,85		
TOTAL		240.108.257,88								

BANCO DO BRASIL S/A										
BB Previdenciário Renda Fixa IMA-B FI	R.F.	20.983.367,20	-2,77	-7,83	-361,60	-125,11	-468,45	-228,43		
BB RPPS Renda Fixa Fluxo FIC	R.F.	24.207.212,96	0,53	3,06	69,35	48,94	89,84	89,35		
TOTAL		45.190.580,16								

GWJ CONSULTORIA, PARTICIPAÇÕES E SERVIÇOS LTDA.										
GWJ Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	1.279.195,15	-7,00	-13,17	-912,35	-210,42			4,31	8,97
TOTAL		1.279.195,15								

BANCO BTG PACTUAL										
BTG Pactual IPCA FI Renda Fixa	R.F.	10.501.945,23	-1,11	-1,94	-144,37	-30,98	-187,03	-56,57		
BTG Pactual FI RF IMA B	R.F.	3.511.777,37	-2,75	-7,66	-358,43	-122,37	-464,34	-223,42		
TOTAL		14.013.722,60								

BANCO BRADESCO S/A										
Bradesco FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	11.510.982,89	-3,03	-7,85	-394,82	-125,42	-511,49	-228,99		
Bradesco FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	1.169.013,70	-1,61	-2,89	-210,01	-46,12	-272,07	-84,21		
Bradesco FI Renda Fixa IMA-B 5+	R.F.	639.729,31	-4,08	-11,69	-532,51	-186,80	-689,87	-341,07		
Bradesco FI em Ações Dividendos	R.V.	697.964,29	-7,20	-8,91	-938,79	-142,31			4,11	13,23
Bradesco FI em Ações Small Cap Plus	R.V.	491.126,73	-7,96	-11,85	-1.038,27	-189,24			3,34	10,29
TOTAL		14.508.816,92								

ITAU UNIBANCO S/A										
Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	1.822.587,83	-2,91	-8,05	-379,22	-128,62	-491,27	-234,83		
TOTAL		1.822.587,83								

BANCO SANTANDER S/A										
Santander FIC FI IMA-B Títulos Públicos Renda Fixa	R.F.	2.823.061,64	-2,98	-8,04	-388,47	-128,41	-503,25	-234,45		
Santander FIC FI IMA-B Institucional Títulos Públicos RF LP	R.F.	207.977,00	-2,97	-7,96	-387,12	-127,13	-501,51	-232,12		
Santander FIC FI Dividendos VIP Ações	R.V.	682.253,51	-7,39	-9,09	-964,18	-145,27			3,91	13,05
TOTAL		3.713.292,15								

TOTAL APLICADO DO PLANO PREVIDENCIÁRIO 320.636.452,69 DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 28/06/2013

TOTAL GERAL APLICADO - (R\$) 1.801.394.291,55 PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO

RESUMO DA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO DE INVESTIMENTO - EM 28/06/2013

PLANO FINANCEIRO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	469.666.252,08	31,71%	-12.050.995,00
FUNDOS DE RENDA FIXA	797.144.263,66	53,82%	-14.669.555,85
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	184.140.953,60	12,43%	-16.846.487,09
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	29.806.369,52	2,01%	176.045,11
SALDO EM CONTAS CORRENTES	257.439,86	0,02%	
TOTAIS	1.481.015.278,72	100,00%	-43.390.992,83

PLANO PREVIDENCIÁRIO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	149.475.181,01	46,62%	-5.453.318,56
FUNDOS DE RENDA FIXA	161.620.759,81	50,40%	-3.495.465,45
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	3.613.849,30	1,13%	-299.824,78
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	5.926.662,57	1,85%	35.539,22
SALDO EM CONTAS CORRENTES	11.690,86	0,00%	
TOTAIS	320.648.143,55	100,00%	-9.213.069,57

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

DESCRIÇÃO	VALOR R\$	%	RENDIMENTO TOTAL NO MÊS (R\$)
CARTEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	619.141.433,09	34,36%	-17.504.313,56
FUNDOS DE RENDA FIXA	958.765.023,47	53,22%	-18.165.021,30
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	187.754.802,90	10,42%	-17.146.311,87
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	35.733.032,09	1,98%	211.584,33
SALDO EM CONTAS CORRENTES	269.130,72	0,01%	
TOTAIS	1.801.663.422,27	100,00%	-52.604.062,40

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 - JUNHO DE 2013

INSTITUIÇÃO	EM FUNDO	EM CONTA CORRENTE	TOTAL BANCO	% POR INSTITUIÇÃO	QTDE. FUNDOS
BANCO DO BRASIL S/A	623.630.443,12	260.010,34	623.890.453,46	34,63%	7
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	439.342.659,24	4.264,30	439.346.923,54	24,39%	15
BANCO BRADESCO S/A	286.922.429,66	0,00	286.922.429,66	15,93%	7
ITAU UNIBANCO S/A	132.556.855,63	851,63	132.557.707,26	7,36%	4
BANCO HSBC BANK BRASIL S/A	121.374.275,53	4.004,45	121.378.279,98	6,74%	4
BANCO SANTANDER S/A	77.081.838,66	0,00	77.081.838,66	4,28%	3
SCHROEDERS INVESTIMENT	25.958.406,89	0,00	25.958.406,89	1,44%	1
GWJ CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.	1.722.513,53	0,00	1.722.513,53	0,10%	1
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	2.044.169,05	0,00	2.044.169,05	0,11%	1
BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A	16.894.157,25	0,00	16.894.157,25	0,94%	1
BANCO BTG PACTUAL	68.715.886,90	0,00	68.715.886,90	3,81%	3
GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S.A.	1.385.866,38	0,00	1.385.866,38	0,08%	1
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA.	1.653.998,79	0,00	1.653.998,79	0,09%	1
PÁTRIA INVESTIMENTOS LTDA	2.110.790,92	0,00	2.110.790,92	0,12%	1
TOTAIS	1.801.394.291,55	269.130,72	1.801.663.422,27	100,00%	50

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

SEGMENTO	META ATUARIAL (%)			META GERENCIAL (%)		
	INDICE	JUN/13	2013	INDICE	JUN/13	2013
TITULOS PUBLICOS FEDERAIS	INPC(IBGE) + 6% a.a.	0,77	6,26	C.D.I.	0,59	3,43
RENTA FIXA	INPC(IBGE) + 6% a.a.	0,77	6,26	C.D.I.	0,59	3,43
RENTA VARIÁVEL	INPC(IBGE) + 6% a.a.	0,77	6,26	IBOVESPA	-11,31	-22,14
RENTA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	INPC(IBGE) + 6% a.a.	0,77	6,26	C.D.I.	0,59	3,43

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 junho de 2013, distribuídos em 02 (duas) Carteira de Administradas de Títulos Públicos Federais e 48 (quarenta e seis) 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.