

RELATÓRIO DE ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DA AMPREV
CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA - JUNHO 2014

ALOCACAO DOS RECURSOS DIVERSIFICACAO	E G M E N T O	VALOR R\$	RENTABILIDADE DO FUNDO		EM RELAÇÃO					
					META ATUARIAL		META GERENCIAL			
					INPC + 6%a.a.		CDI		IBOVESPA	
					0,75	6,74	0,82	4,97	3,76	3,22
			NO MÊS	NO ANO 2014	NO MÊS	NO ANO 2014	NO MÊS	NO ANO 2014	NO MÊS	NO ANO 2014

PLANO FINANCEIRO

BANCO DO BRASIL S/A										
Carteira Administrada Banco do Brasil - LFT (POS)	R.F.	10.926.990,48								
Carteira Administrada Banco do Brasil - NTN-B (POS)	R.F.	544.789.212,45	-0,16	10,31	-21,73	152,85	-19,85	207,42		
Carteira Administrada Banco do Brasil - LTN (PRE)	R.F.	19.274.019,79								
BB Previdenciário Renda Fixa IMA-B FI	R.F.	234.799,14	-0,02	9,44	-2,97	139,95	-2,72	189,91		
BB Previdenciário Renda Fixa Perfil	R.F.	5.781.980,07	0,82	5,06	110,23	75,04	100,72	101,83		
BB RPPS Renda Fixa Fluxo FIC	R.F.	60.172.941,63	0,75	4,56	100,71	67,68	92,02	91,85		
BB RPPS Renda Fixa Crédito Privado IPCA II	R.F.	16.817.198,41	1,26	8,14	169,20	120,69	154,59	163,77		
BB RPPS Renda Fixa Crédito Privado IPCA III	R.F.	8.253.914,96	0,83	8,79	110,86	130,38	101,29	176,92		
Brasil Ações Ibovespa Indexado FIC FI	R.V.	18.436.493,84	3,50	2,14	468,45				-0,27	-1,08
Brasil Ações IBRX Indexado FIC FI	R.V.	8.130.867,58	3,26	2,27	436,25	33,68			-0,51	-0,95
BB Ações Consumo FIC FI	R.V.	4.013.999,93	4,47	5,51	598,76	81,68			0,71	2,28
BB Ações Cielo FI	R.V.	12.513.943,67	13,48	39,73	1.805,52	589,08			9,72	36,50
BB Ações BB Seguridade FI em Ações	R.V.	15.478.842,21	13,60	6,74	1.820,51	100,00			9,83	3,52
TOTAL		724.825.204,16								
CAIXA ECONOMICA FEDERAL										
FI Caixa Brasil IPCA XI Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	18.855.387,50	0,95	5,71	127,11	84,72	116,14	114,97		
FI Caixa Brasil IPCA XII Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	18.983.337,50	0,85	5,45	113,66	80,80	103,85	109,64		
FI Caixa Brasil IPCA XIII Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	18.476.662,50	0,87	5,62	116,56	83,32	106,50	113,06		
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	11.858.355,69	0,83	5,00	110,85	74,19	101,28	100,67		
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	83.422.923,72	0,23	9,44	31,40	139,90	28,69	189,85		
FI Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos RF LP	R.F.	15.907.998,03	1,06	6,87	142,40	101,93	130,10	138,32		
FIDC da Companhia Estadual de Águas e Esgotos-CEDAE	R.F.	2.553.890,76	-1,70	-8,41	-227,82	-124,70	-208,15	-169,21		
FIDC Casan Saneamento	R.F.	20.224.516,74	1,07	6,74	142,92	100,00	130,58	135,70		
Caixa FI em Ações Brasil IBX-50	R.V.	15.622.608,95	4,45	2,16	595,42	32,05			0,68	-1,06
Caixa FIC Ações Valor Dividendos RPPS	R.V.	10.969.254,87	3,48	6,20	465,74	91,97			-0,29	2,98
Caixa FI em Ações Caixa Small Caps Ativo	R.V.	893.456,48	2,50	-2,36	335,06	-34,98			-1,26	-5,58
Caixa FI Ações Institucional BRD Nível I	R.V.	2.891.484,77	0,30	-3,13	40,01	-46,47			-3,47	-6,36
FI Caixa Brasil IPCA V Multimercado Crédito Privado	M.M.	17.339.662,50	0,98	5,82	131,11	86,36	119,79	117,19		
FI Caixa Brasil IPCA VI Multimercado Crédito Privado	M.M.	6.371.708,40	0,96	5,78	128,16	85,66	117,10	116,25		
FI Caixa Brasil IPCA VIII Multimercado Crédito Privado	M.M.	5.729.851,70	1,10	6,06	147,79	89,92	135,03	122,02		
TOTAL		250.101.100,11								
BANCO BRADESCO S/A										
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	177.209.320,09	0,07	9,17	9,99	135,97	9,12	184,51		
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	96.128.925,95	0,54	7,24	71,64	107,38	65,45	145,71		
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B 5+	R.F.	1.370.826,30	-0,61	10,94	-82,28	162,18	-75,17	220,07		
Bradesco FI em Ações Infra-Estrutura	R.V.	15.507.299,35	2,18	-6,85	291,56	-101,59			-1,59	-10,08
Bradesco FI em Ações Dividendos	R.V.	2.208.030,00	4,69	3,53	627,80	52,39			0,92	0,31
Bradesco FI em Ações Small Cap Plus	R.V.	1.012.728,11	4,53	1,27	606,90	18,86			0,77	-1,95
Bradesco FI Multimercado Plus I	M.M.	1.339.987,22	0,75	4,87	100,28	72,15	91,6	97,90		
TOTAL		294.777.117,02								
ITAU UNIBANCO S/A										
Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	91.439.157,05	0,03	9,29	3,78	137,79	3,45	186,97		
Itaú Institucional RF Inflação 5 FIC FI	R.F.	11.680.616,99	1,07	6,82	143,49	101,19	131,11	137,31		
Itaú FOF RPI Ações Ibovespa Ativo - FIC FI	R.V.	38.256.110,62	3,01	2,59	402,92	38,42			-0,76	-0,63
FIC FIP Kinea Private Equity II	R.V.	4.498.840,58	-0,23	6,48	-30,92	96,07			-4,00	3,25
Itaú Ações Consumo FI	R.V.	4.042.579,04	4,44	5,56	594,93	82,40			0,68	2,33
Itaú Institucional Multimercado Juros e Moedas	M.M.	4.168.896,09	0,79	5,13	106,33	76,00	97,1	103,14		
TOTAL		154.086.200,37								
BANCO HSBC BANK BRASIL S/A										
Hsbc FI Renda Fixa Regimes de Previdência Ativo	R.F.	110.521.853,59	0,81	8,35	107,95	123,89	98,63	168,11		
Hsbc FI em Ações Ibovespa	R.V.	15.752.742,19	3,52	2,04	471,79	30,23			-0,24	-1,19
Hsbc FI Ações Ibovespa Valuation	R.V.	3.467.942,06	2,32	-1,21	311,29	-17,87			-1,44	-4,43
Hsbc FI de Ações Small Caps	R.V.	890.908,88	3,57	-2,60	478,02	-38,56			-0,19	-5,83
TOTAL		130.633.446,72								
BANCO SANTANDER S/A										
Santander FIC FI IMA-B Títulos Públicos Renda Fixa	R.F.	66.101.213,25	0,06	9,26	7,83	137,25	7,16	186,24		
Santander FIC FI IMA-B Institucional Títulos Públicos RF LP	R.F.	9.100.306,97	0,07	9,37	9,93	138,88	9,07	188,46		
Santander FIC FI Dividendos VIP Ações	R.V.	1.578.338,55	3,91	1,39	523,31	20,68			0,14	-1,83
TOTAL		76.779.858,77								
SCHRODERS INVESTIMENT										
Schroder FI em Ações IBRX-50	R.V.	0,00	3,01	1,20	402,60	17,83			-0,76	-2,02
TOTAL		0,00								
GW CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.										
GW Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	570.919,18	-0,16	13,84	-21,90	205,29			-3,93	10,62
TOTAL		570.919,18								
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.										
BNP Paribas Grand Prix Fundo de Investimento Ações	R.V.	2.160.404,68	1,89	1,14	253,55	16,84			-1,87	-2,09
TOTAL		2.160.404,68								
BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A										
FIDC Aberto CPP540 RPPS	R.F.	10.504.415,49	0,94	7,50	126,36	111,23	115,45	150,94		
TOTAL		10.504.415,49								
BANCO BTG PACTUAL										
BTG Pactual FI RF IMA B	R.F.	22.425.052,42	0,01	9,41	1,70	139,46	1,55	189,25		
BTG Pactual IPCA FI Renda Fixa	R.F.	15.015.230,22	1,09	6,93	146,15	102,78	133,53	139,47		
BTG Pactual Dividendos FI de Ações	R.V.	26.291.762,85	3,60	7,46	482,27	110,57			-0,16	4,23
BTG Pactual Absoluto Institucional FIQ de FI de Ações	R.V.	3.415.443,76	5,23	9,65	699,94	143,13			1,46	6,43
TOTAL		67.147.489,25								

GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S.A.										
Geração Futuro Dividendos FIA	R.V.	2.901.365,68	6,88	17,95	921,52	266,20			3,12	14,73
TOTAL		2.901.365,68								
QUELUZ GESTAO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA.										
Queluz Valor Fundo de Investimento em Ações	R.V.	1.771.850,63	3,79	4,21	507,47	62,36			0,03	0,98
TOTAL		1.771.850,63								
PATRIA INVESTIMENTOS LTDA.										
Patria Special Opportunities I FIO FI	R.V.	3.556.617,46	-0,54	-2,35	-72,09	-34,82			-4,30	-5,57
TOTAL		3.556.617,46								
QUEST INVESTIMENTOS										
Quest Small Fiq Fia	R.V.	4.078.038,91	3,89	3,60	520,87	53,44			0,13	0,38
TOTAL		4.078.038,91								
BRZ INVESTIMENTOS LTDA										
Terras Brasil - FIP	R.V.	5.010.472,11	0,21	0,00	28,04	0,00			0,00	0,00
TOTAL		5.010.472,11								
TOTAL APLICADO DO PLANO FINANCEIRO		1.728.904.500,54	DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 30/06/2014							

PLANO PREVIDENCIARIO										
CAIXA ECONOMICA FEDERAL										
Carteira Administrada Caixa Economica - NTN-B (POS)	R.F.	171.218.746,98	0,67	11,49	89,44	170,40	81,72	231,23		
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	80.994.465,72	0,23	9,44	31,40	139,90	28,69	189,85		
FI Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos RF LP	R.F.	4.395.229,03	1,06	6,87	142,40	101,93	130,10	138,32		
FI Caixa Brasil IPCA XV Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	6.185.715,77	0,90	5,60	120,98	83,00	110,54	112,63		
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	11.397.001,53	0,83	5,00	110,85	74,19	101,28	100,67		
Caixa FI em Ações Caixa Small Caps Ativo	R.V.	478.937,35	2,50	-2,36	335,06	-34,98			-1,26	-5,58
FI Caixa Brasil IPCA VI Multimercado Crédito Privado	M.M.	6.114.432,02	0,96	5,78	128,16	85,66	117,10	116,25		
TOTAL		280.784.528,40								
BANCO DO BRASIL S/A										
BB Previdenciário Renda Fixa IMA-B FI	R.F.	24.783.077,50	-0,02	9,44	-2,97	139,95	-2,72	189,91		
BB RPPS Renda Fixa Fluxo FIC	R.F.	23.498.160,99	0,75	4,56	100,71	67,68	92,02	91,85		
BB RPPS Renda Fixa Crédito Privado IPCA III	R.F.	4.981.083,80	0,83	8,79	110,86	130,38	101,29	176,92		
BB Previdenciário Renda Fixa Perfil	R.F.	6.958.631,71	0,82	6,74	110,23	100,00	100,72	135,70		
BB Ações Cielo FI	R.V.	6.074.931,28	13,48	39,73	1.805,52	589,08			9,72	36,50
TOTAL		66.295.885,28								
GWI CONSULTORIA, PARTICIPAÇÕES E SERVIÇOS LTDA.										
GWI Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	1.647.387,26	-0,16	13,84	-21,90	205,29			-3,93	10,62
TOTAL		1.647.387,26								
BANCO BTG PACTUAL										
BTG Pactual IPCA FI Renda Fixa	R.F.	15.978.095,40	1,09	6,93	146,15	102,78	133,53	139,47		
BTG Pactual FI RF IMA B	R.F.	3.709.251,72	0,01	9,41	1,70	139,46	1,55	189,25		
TOTAL		19.687.347,12								
BANCO BRADESCO S/A										
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	12.283.224,07	0,07	9,17	9,99	135,97	9,12	184,51		
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	5.564.741,58	0,54	7,24	71,64	107,38	65,45	145,71		
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B 5+	R.F.	666.445,16	-0,61	10,94	-82,28	162,18	-75,17	220,07		
Bradesco FI em Ações Dividendos	R.V.	762.556,03	4,69	3,53	627,80	52,39			0,92	0,31
Bradesco FI em Ações Small Cap Plus	R.V.	540.866,41	4,53	1,27	606,90	18,86			0,77	-1,95
TOTAL		19.817.833,25								
ITAU UNIBANCO S/A										
Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	1.939.765,58	0,03	9,29	3,78	137,79	3,45	186,97		
Itaú Institucional RF Inflação 5 FIC FI	R.F.	4.372.829,92	1,07	6,82	143,49	101,19	131,11	137,31		
TOTAL		6.312.595,50								
BANCO SANTANDER S/A										
Santander FIC FI IMA-B Títulos Públicos Renda Fixa	R.F.	2.993.294,62	0,06	9,26	7,83	137,25	7,16	186,24		
Santander FIC FI IMA-B Institucional Títulos Públicos RF LP	R.F.	221.267,79	0,07	9,37	9,93	138,88	9,07	188,46		
Santander FIC FI Dividendos VIP Ações	R.V.	729.605,33	3,91	1,39	523,31	20,68			0,14	-1,83
TOTAL		3.944.167,74								
TOTAL APLICADO DO PLANO PREVIDENCIÁRIO		398.489.744,55	DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 30/06/2014							
TOTAL GERAL APLICADO - (R\$)		2.127.394.245,09	PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO							

RESUMO DA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO DE INVESTIMENTO - EM 30/06/2014			
PLANO FINANCEIRO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	574.990.222,72	33,26%	-888.706,43
FUNDOS DE RENDA FIXA	893.040.824,97	51,65%	3.917.680,73
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	225.923.346,94	13,07%	8.210.869,33
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	34.950.105,91	2,02%	333.925,55
SALDO EM CONTAS CORRENTES	14.902,32	0,00%	
TOTAIS	1.728.919.402,86	100,00%	11.573.769,18

PLANO PREVIDENCIARIO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	171.218.746,98	42,97%	1.284.703,99
FUNDOS DE RENDA FIXA	210.922.281,89	52,93%	840.658,27
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	10.234.283,66	2,57%	815.901,45
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	6.114.432,02	1,53%	57.972,50
SALDO EM CONTAS CORRENTES	12.197,35	0,00%	
TOTAIS	398.501.941,90	100,00%	2.999.236,21

CONSOLIDAÇÃO DOS PLANO NA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO - JUNHO DE 2014			
PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO			
DESCRIÇÃO	VALOR R\$	%	RENDIMENTO TOTAL NO MÊS (R\$)
CARTEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	746.208.969,70	35,08%	395.997,56
FUNDOS DE RENDA FIXA	1.103.963.106,86	51,89%	4.758.339,00
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	236.157.630,60	11,10%	9.026.770,78
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	41.064.537,93	1,93%	391.898,05
SALDO EM CONTAS CORRENTES	27.099,67	0,00%	

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	

TOTALS	2.127.421.344,76	100,00%	14.573.005,39
---------------	-------------------------	----------------	----------------------

DISPONIBILIDADE POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA - JUNHO DE 2014					
INSTITUIÇÃO	EM FUNDO	EM CONTA CORRENTE	TOTAL BANCO	% POR INSTITUIÇÃO	QTDE. FUNDOS
BANCO DO BRASIL S/A	791.121.089,44	18.830,92	791.139.920,36	37,19%	11
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	530.885.628,51	4.264,30	530.889.892,81	24,95%	17
BANCO BRADESCO S/A	314.594.950,27	0,00	314.594.950,27	14,79%	7
ITAU UNIBANCO S/A	160.398.795,87	0,00	160.398.795,87	7,54%	6
BANCO HSBC BANK BRASIL S/A	130.633.446,72	4.004,45	130.637.451,17	6,14%	4
BANCO SANTANDER S/A	80.724.026,51	0,00	80.724.026,51	3,79%	3
SCHROEDERS INVESTIMENT	0,00	0,00	0,00	0,00%	1
GWI CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.	2.218.306,44	0,00	2.218.306,44	0,10%	1
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	2.160.404,68	0,00	2.160.404,68	0,10%	1
BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A	10.504.415,49	0,00	10.504.415,49	0,49%	1
BANCO BTG PACTUAL	86.834.836,37	0,00	86.834.836,37	4,08%	4
GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S.A.	2.901.365,68	0,00	2.901.365,68	0,14%	1
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA.	1.771.850,63	0,00	1.771.850,63	0,08%	1
PÁTRIA INVESTIMENTOS LTDA	3.556.617,46	0,00	3.556.617,46	0,17%	1
QUEST SMALL FIQ FIA	4.078.038,91	0,00	4.078.038,91	0,19%	1
BRZ INVESTIMENTOS LTDA	5.010.472,11	0,00	5.010.472,11	0,24%	1
TOTALS	2.127.394.245,09	27.099,67	2.127.421.344,76	100,00%	61

Em junho de 2014, os índices para atingimento das metas, atuarial e gerencial, são os seguintes:

SEGMENTO	META ATUARIAL (%)			META GERENCIAL (%)		
	INDICE	JUN/14	2014	INDICE	JUN/14	2014
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	INPC(IBGE) + 6% a.a.	0,75	6,74	C.D.I.	0,82	4,97
RENTA FIXA	INPC(IBGE) + 6% a.a.	0,75	6,74	C.D.I.	0,82	4,97
RENTA VARIÁVEL	INPC(IBGE) + 6% a.a.	0,75	6,74	IBOVESPA	3,76	3,22
RENTA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	INPC(IBGE) + 6% a.a.	0,75	6,74	C.D.I.	0,82	4,97

A Amapa 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 2014, distribuídos em 02 (duas) Carteira de Administradas de Títulos Públicos Federais e 58 (cinquenta e oito) Fundos de Investimentos, sendo estes últimos distribuídos em 25 (vinte e cinco) fundos de renda fixa, 28 (vinte e oito) fundos de renda variável e 05 (cinco) fundos multimercado.