

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

ALOCACAO DOS RECURSOS DIVERSIFICACAO	E G M E N T O	VALOR R\$	RENTABILIDADE DO FUNDO		EM RELAÇÃO					
					META ATUARIAL		META GERENCIAL			
			NO MÊS	NO ANO 2014	INPC + 6%a.a. NO MÊS	NO ANO 2014	CDI NO MÊS	NO ANO 2014	IBOVESPA NO MÊS	NO ANO 2014
					1,09	5,98	0,86	4,12	-0,75	-0,52

PLANO FINANCEIRO

BANCO DO BRASIL S/A										
Carteira Administrada Banco do Brasil - LFT (POS)	R.F.	10.838.193,29								
Carteira Administrada Banco do Brasil - NTN-B (POS)	R.F.	545.930.871,47	5,17	10,49	476,12	175,50	602,84	254,64		
Carteira Administrada Banco do Brasil - LTN (PRE)	R.F.	19.109.864,39								
BB Previdenciário Renda Fixa IMA-B FI	R.F.	234.851,32	4,33	9,46	398,05	158,34	503,99	229,74		
BB Previdenciário Renda Fixa Perfil	R.F.	5.734.765,16	0,89	4,20	81,71	70,32	103,46	102,04		
BB RPPS Renda Fixa Fluxo FIC	R.F.	44.222.540,56	0,79	3,78	73,04	63,32	92,48	91,87		
BB RPPS Renda Fixa Crédito Privado IPCA II	R.F.	16.607.333,56	1,86	6,79	171,50	113,61	217,14	164,85		
BB RPPS Renda Fixa Crédito Privado IPCA III	R.F.	8.186.137,32	2,70	7,90	248,67	132,18	314,86	191,79		
Brasil Ações Ibovespa Indexado FIC FI	R.V.	17.813.262,23	-1,00	-1,31	-91,69				-0,25	-0,79
Brasil Ações IBRX Indexado FIC FI	R.V.	7.874.304,47	-1,32	-0,96	-121,68	-15,99			-0,57	-0,44
BB Ações Consumo FIC FI	R.V.	3.842.178,71	2,00	0,99	183,85	16,61			2,75	1,51
BB Ações Cielo FI	R.V.	11.026.966,10	1,23	23,12	113,25	386,95			1,98	23,64
TOTAL		691.421.268,58								

CAIXA ECONOMICA FEDERAL

FI Caixa Brasil IPCA XI Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	18.678.062,50	1,00	4,72	91,93	78,97	116,39	114,59		
FI Caixa Brasil IPCA XII Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	18.823.550,00	0,91	4,56	83,47	76,33	105,68	110,74		
FI Caixa Brasil IPCA XIII Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	18.317.200,00	1,11	4,71	101,99	78,77	129,14	114,30		
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	11.760.989,10	0,84	4,14	77,07	69,29	97,59	100,54		
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	83.227.758,83	4,20	9,18	386,56	153,60	489,45	222,86		
FI Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos RF LP	R.F.	15.740.595,08	1,47	5,75	135,35	96,21	171,37	139,60		
FIDC da Companhia Estadual de Águas e Esgotos-CEDAE	R.F.	2.598.098,03	-1,45	-6,82	-133,47	-114,19	-168,99	-165,69		
FIDC Casan Saneamento	R.F.	20.010.919,86	0,05	5,98	5,02	100,00	6,36	145,09		
Caixa FI em Ações Brasil IBX-50	R.V.	14.957.443,42	-0,78	-2,19	-71,98	-36,62			-0,03	-1,67
Caixa FIC Ações Valor Dividendos RPPS	R.V.	10.600.521,36	1,09	2,63	100,70	44,05			1,84	3,15
Caixa FI em Ações Caixa Small Caps Ativo	R.V.	871.644,11	1,14	-4,74	105,10	-79,37			1,89	-4,22
Caixa FI Ações Institucional BRD Nivel I	R.V.	2.882.869,15	1,61	-3,42	147,96	-57,28			2,36	-2,90
FI Caixa Brasil IPCA V Multimercado Crédito Privado	M.M.	17.171.512,50	1,13	4,80	104,18	80,29	131,91	116,49		
FI Caixa Brasil IPCA VI Multimercado Crédito Privado	M.M.	6.311.296,60	1,13	4,77	103,54	79,89	131,10	115,92		
FI Caixa Brasil IPCA VIII Multimercado Crédito Privado	M.M.	5.667.295,05	1,07	4,91	98,18	82,10	124,31	119,12		
TOTAL		247.619.755,59								

BANCO BRADESCO S/A

Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	177.077.258,35	4,20	9,09	386,16	152,09	488,94	220,67		
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	95.617.349,09	2,49	6,67	229,28	111,63	290,31	161,97		
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B 5+	R.F.	1.379.302,12	6,10	11,62	561,16	194,50	710,52	282,20		
Bradesco FI em Ações Infra-Estrutura	R.V.	15.176.817,53	-1,11	-8,84	-102,00	-147,87			-0,36	-8,32
Bradesco FI em Ações Dividendos	R.V.	2.109.135,91	-0,22	-1,10	-19,95	-18,47			0,53	-0,58
Bradesco FI em Ações Small Cap Plus	R.V.	968.814,03	4,30	-3,12	395,44	-52,20			5,05	-2,60
Bradesco FI Multimercado Plus I	M.M.	1.330.025,65	0,92	4,09	84,22	68,38	106,6	99,21		
TOTAL		293.658.702,68								

ITAU UNIBANCO S/A

Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	91.413.370,40	4,22	9,26	388,32	154,98	491,67	224,86		
Itaú Institucional RF Inflação 5 FIC FI	R.F.	11.556.763,22	1,43	5,69	131,81	95,23	166,89	138,18		
Itaú RPI Ações Ibovespa Index FIC FI em Ações	R.V.	37.138.489,72	-0,05	-0,41	-4,19	-6,79			0,70	0,11
FIC FIP Kinea Private Equity II	R.V.	4.509.252,45	3,99	6,73	367,13	112,54			4,74	7,25
Itaú Ações Consumo FI	R.V.	3.870.595,31	2,01	1,07	185,37	17,84			2,76	1,59
Itaú Institucional Multimercado Juros e Moedas	M.M.	4.136.050,56	0,93	4,30	85,46	71,91	108,2	104,34		
TOTAL		152.624.521,66								

BANCO HSBC BANK BRASIL S/A

Hsbc FI Renda Fixa Regimes de Previdência Ativo	R.F.	109.637.873,19	2,64	7,49	242,61	125,30	307,19	181,81		
Hsbc FI em Ações Ibovespa	R.V.	14.945.834,00	-0,95	-1,43	-87,50	-24,00			-0,20	-0,91
Hsbc FI Ações Ibovespa Valuation	R.V.	3.389.145,42	-1,18	-3,45	-108,61	-57,73			-0,43	-2,93
Hsbc FI de Ações Small Caps	R.V.	860.197,95	2,34	-5,96	215,59	-99,70			3,09	-5,44
TOTAL		128.833.050,56								

BANCO SANTANDER S/A

Santander FIC FI IMA-B Títulos Públicos Renda Fixa	R.F.	66.357.566,26	4,16	9,19	382,55	153,81	484,37	223,18		
Santander FIC FI IMA-B Institucional Títulos Públicos RF LP	R.F.	9.093.563,93	4,17	9,29	384,13	155,38	486,36	225,44		
Santander FIC FI Dividendos VIP Ações	R.V.	1.518.970,60	-1,58	-2,42	-145,44	-40,49			-0,83	-1,90
TOTAL		76.970.100,79								

SCHRODERS INVESTIMENT

Schroder FI em Ações IBRX-50	R.V.	14.838.197,62	-1,84	-1,75	-168,90	-29,32			-1,09	-1,23
TOTAL		14.838.197,62								

GWJ CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.

GWJ Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	571.854,58	16,33	14,03	1.503,03	234,80			17,08	14,55
TOTAL		571.854,58								

BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.

BNP Paribas Grand Prix Fundo de Investimento Ações	R.V.	2.120.253,16	-1,30	-0,74	-119,47	-12,45			-0,55	-0,22
TOTAL		2.120.253,16								

BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A

FIDC Aberto CPP540 RPPS	R.F.	10.709.898,36	0,97	6,50	88,93	108,71	112,60	157,73		
TOTAL		10.709.898,36								

BANCO BTG PACTUAL

BTG Pactual FI RF IMA B	R.F.	22.422.206,53	4,23	9,39	389,41	157,16	493,06	228,02		
BTG Pactual IPCA FI Renda Fixa	R.F.	14.853.101,10	1,45	5,78	133,14	96,67	168,57	140,26		
BTG Pactual Dividendos FI de Ações	R.V.	25.377.678,92	0,89	3,72	81,49	62,26			1,64	4,24
BTG Pactual Absoluto Institucional FIQ de FI de Ações	R.V.	3.245.765,38	1,01	4,20	93,32	70,36			1,76	4,72
TOTAL		65.898.751,93								

GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S.A.										
Geração Futuro Dividendos FIA	R.V.	2.714.534,97	4,25	10,36	391,21	173,31			5,00	10,88
TOTAL		2.714.534,97								
QUELUZ GESTAO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA.										
Queluz Valor Fundo de Investimento em Ações	R.V.	1.707.147,23	1,39	0,40	127,88	6,70			2,14	0,92
TOTAL		1.707.147,23								
PATRIA INVESTIMENTOS LTDA.										
Patria Special Opportunities I FQ FI	R.V.	3.271.864,41	-0,39	-1,82	-36,25	-30,45			0,36	-1,30
TOTAL		3.271.864,41								
QUEST INVESTIMENTOS										
Quest Small Fiq Fia	R.V.	3.925.335,36	2,67	-0,28	245,52	-4,61			3,42	0,24
TOTAL		3.925.335,36								
BRZ INVESTIMENTOS LTDA										
Terras Brasil - FIP	R.V.	250.000,00	0,00	0,00	0,00	0,00			0,00	0,00
TOTAL		250.000,00								
TOTAL APLICADO DO PLANO FINANCEIRO		1.697.135.237,48	DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 30/05/2014							

PLANO PREVIDENCIARIO										
CAIXA ECONOMICA FEDERAL										
Carteira Administrada Caixa Economica - NTN-B (POS)	R.F.	169.934.042,99	3,14	10,75	288,68	179,92	365,51	261,05		
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	80.818.549,46	4,20	9,18	386,56	153,60	489,45	222,86		
FI Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos RF LP	R.F.	4.348.977,18	1,47	5,75	135,35	96,21	171,37	139,60		
FI Caixa Brasil IPCA XV Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	6.130.322,31	1,07	4,65	98,25	77,84	124,40	112,95		
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	11.303.423,02	0,84	4,14	77,07	69,29	97,59	100,54		
Caixa FI em Ações Caixa Small Caps Ativo	R.V.	467.244,83	1,14	-4,74	105,10	-79,37			1,89	-4,22
FI Caixa Brasil IPCA VI Multimercado Crédito Privado	M.M.	6.056.459,52	1,13	4,77	103,54	79,89	131,10	115,92		
TOTAL		279.059.019,31								
BANCO DO BRASIL S/A										
BB Previdenciário Renda Fixa IMA-B FI	R.F.	24.788.584,74	4,33	9,46	398,05	158,34	503,99	229,74		
BB RPPS Renda Fixa Fluxo FIC	R.F.	7.177.240,92	0,79	3,78	73,04	63,32	92,48	91,87		
BB RPPS Renda Fixa Crédito Privado IPCA III	R.F.	4.940.181,25	2,70	7,90	248,67	132,18	314,86	191,79		
BB Previdenciário Renda Fixa Perfil	R.F.	6.901.808,40	0,89	5,98	81,71	100,00	103,46	145,09		
BB Ações Cielo FI	R.V.	5.353.073,58	1,23	23,12	113,25	386,95			1,98	23,64
TOTAL		49.160.888,89								
GTW CONSULTORIA, PARTICIPAÇÕES E SERVIÇOS LTDA.										
GTW Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	1.650.086,34	16,33	14,03	1.503,03	234,80			17,08	14,55
TOTAL		1.650.086,34								
BANCO BTG PACTUAL										
BTG Pactual IPCA FI Renda Fixa	R.F.	15.805.569,60	1,45	5,78	133,14	96,67	168,57	140,26		
BTG Pactual FI RF IMA B	R.F.	3.708.780,97	4,23	9,39	389,41	157,16	493,06	228,02		
TOTAL		19.514.350,57								
BANCO BRADESCO S/A										
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	12.274.070,24	4,20	9,09	386,16	152,09	488,94	220,67		
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	5.535.127,27	2,49	6,67	229,28	111,63	290,31	161,97		
Bradesco Institucional FIC FI Renda Fixa IMA-B 5+	R.F.	670.565,78	6,10	11,62	561,16	194,50	710,52	282,20		
Bradesco FI em Ações Dividendos	R.V.	728.402,38	-0,22	-1,10	-19,95	-18,47			0,53	-0,58
Bradesco FI em Ações Small Cap Plus	R.V.	517.413,27	4,30	-3,12	395,44	-52,20			5,05	-2,60
TOTAL		19.725.578,94								
ITAU UNIBANCO S/A										
Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	1.939.218,55	4,22	9,26	388,32	154,98	491,67	224,86		
Itaú Institucional RF Inflação 5 FIC FI	R.F.	4.326.463,24	1,43	5,69	131,81	95,23	166,89	138,18		
TOTAL		6.265.681,79								
BANCO SANTANDER S/A										
Santander FIC FI IMA-B Títulos Públicos Renda Fixa	R.F.	2.995.584,71	4,16	9,19	382,55	153,81	484,37	223,18		
Santander FIC FI IMA-B Institucional Títulos Públicos RF LP	R.F.	221.103,83	4,17	9,29	384,13	155,38	486,36	225,44		
Santander FIC FI Dividendos VIP Ações	R.V.	702.161,81	-1,58	-2,42	-145,44	-40,49			-0,83	-1,90
TOTAL		3.918.850,35								
TOTAL APLICADO DO PLANO PREVIDENCIARIO		379.294.456,19	DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 30/05/2014							
TOTAL GERAL APLICADO - (R\$)		2.076.429.693,67	PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIARIO							

RESUMO DA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO DE INVESTIMENTO - EM 30/05/2014			
PLANO FINANCEIRO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	575.878.929,15	33,74%	27.946.700,78
FUNDOS DE RENDA FIXA	874.261.053,87	51,22%	25.836.208,83
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	212.379.074,10	12,44%	-90.771,83
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	34.616.180,36	2,03%	372.395,72
SALDO EM CONTAS CORRENTES	9.703.309,46	0,57%	
TOTAIS	1.706.838.546,94	100,00%	54.064.533,50

PLANO PREVIDENCIARIO			
DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	169.934.042,99	44,80%	4.866.591,94
FUNDOS DE RENDA FIXA	193.885.571,47	51,12%	6.066.919,89
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	9.418.382,21	2,48%	367.742,78
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	6.056.459,52	1,60%	67.388,12
SALDO EM CONTAS CORRENTES	9.872,17	0,00%	
TOTAIS	379.304.328,36	100,00%	11.368.642,73

CONSOLIDAÇÃO DOS PLANO NA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO - MAIO DE 2014			
PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIARIO			
DESCRIÇÃO	VALOR R\$	%	RENDIMENTO TOTAL NO MÊS (R\$)
CARTEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	745.812.972,14	35,75%	32.813.292,72
FUNDOS DE RENDA FIXA	1.068.146.625,34	51,20%	31.903.128,72
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	221.797.456,31	10,63%	276.970,95
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	40.672.639,88	1,95%	439.783,84
SALDO EM CONTAS CORRENTES	9.713.181,63	0,47%	
TOTAIS	2.086.142.875,30	100,00%	65.433.176,23

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 - MAIO DE 2014					
INSTITUIÇÃO	EM FUNDO	EM CONTA CORRENTE	TOTAL BANCO	% POR INSTITUIÇÃO	QTDE. FUNDOS
BANCO DO BRASIL S/A	740.582.157,47	9.656.093,74	750.238.251,21	35,96%	10
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	526.678.774,90	4.264,30	526.683.039,20	25,25%	17
BANCO BRADESCO S/A	313.384.281,62	-28,90	313.384.252,72	15,02%	7
ITAU UNIBANCO S/A	158.890.203,45	48.848,04	158.939.051,49	7,62%	6
BANCO HSBC BANK BRASIL S/A	128.833.050,56	4.004,45	128.837.055,01	6,18%	4
BANCO SANTANDER S/A	80.888.951,14	0,00	80.888.951,14	3,88%	3
SCHRODERS INVESTIMENT	14.838.197,62	0,00	14.838.197,62	0,71%	1
GWI CONSULT. PARTICIP. E SERV. LTDA.	2.221.940,92	0,00	2.221.940,92	0,11%	1
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	2.120.253,16	0,00	2.120.253,16	0,10%	1
BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A	10.709.898,36	0,00	10.709.898,36	0,51%	1
BANCO BTG PACTUAL	85.413.102,50	0,00	85.413.102,50	4,09%	4
GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S.A.	2.714.534,97	0,00	2.714.534,97	0,13%	1
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA.	1.707.147,23	0,00	1.707.147,23	0,08%	1
PÁTRIA INVESTIMENTOS LTDA	3.271.864,41	0,00	3.271.864,41	0,16%	1
QUEST SMALL FIQ FIA	3.925.335,36	0,00	3.925.335,36	0,19%	1
BRZ INVESTIMENTOS LTDA	250.000,00	0,00	250.000,00	0,01%	1
T O T A I S	2.076.429.693,67	9.713.181,63	2.086.142.875,30	100,00%	60

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

SEGMENTO	META ATUARIAL (%)			META GERENCIAL (%)		
	INDICE	MAI/14	2014	INDICE	MAI/14	2014
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	INPC(IBGE) + 6% a.a.	1,09	5,98	C.D.I.	0,86	4,12
RENTA FIXA	INPC(IBGE) + 6% a.a.	1,09	5,98	C.D.I.	0,86	4,12
RENTA VARIÁVEL	INPC(IBGE) + 6% a.a.	1,09	5,98	IBOVESPA	-0,75	-0,52
RENTA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	INPC(IBGE) + 6% a.a.	1,09	5,98	C.D.I.	0,86	4,12

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 maio 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.