

Relatório de Carteira Diária - Fechamento

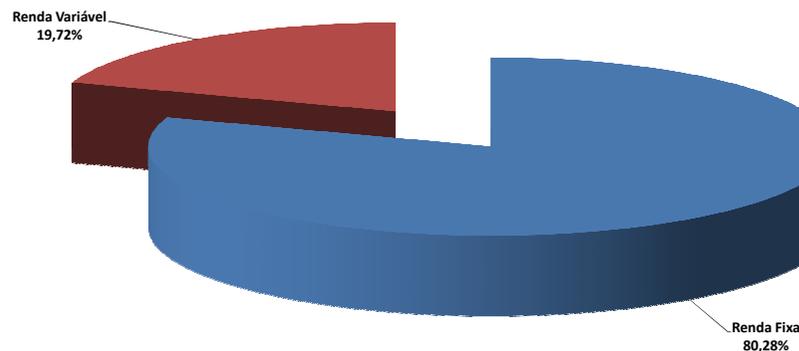
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores
Data da Posição: 31/01/2014

FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV

Composição da Carteira RECIPREV (Gestores)

FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV	
RENDA FIXA	
Banco do Brasil	R\$ 229.253.263,45
Caixa Econômica	R\$ 163.483.387,73
Tesouro Nacional	R\$ 108.355.897,36
Integral	R\$ 39.052.650,44
Gradual	R\$ 6.075.886,54
S.R.M.	R\$ 4.051.028,53
Multinvest Capital	R\$ 3.104.171,28
TOTAL	R\$ 553.376.285,33
RENDA VARIÁVEL	
Caixa Econômica	R\$ 25.041.408,35
Ático	R\$ 15.930.158,42
BTG Pactual	R\$ 13.691.855,17
Franklin Templeton	R\$ 11.946.235,22
Quest	R\$ 10.591.819,88
Xp	R\$ 9.619.054,87
Banco do Brasil	R\$ 9.413.020,22
Set Investimentos	R\$ 8.439.983,20
Perfin	R\$ 7.691.458,94
Riviera	R\$ 6.191.962,00
Humaitá	R\$ 5.639.841,93
NSG Capital	R\$ 2.993.087,41
CRPC	R\$ 2.990.033,84
Votorantim	R\$ 2.018.388,84
Geração Futuro	R\$ 1.917.587,65
ARX	R\$ 927.065,64
RB Capital	R\$ 854.685,00
TOTAL	R\$ 135.897.646,56
PATRIMÔNIO	R\$ 689.273.931,89

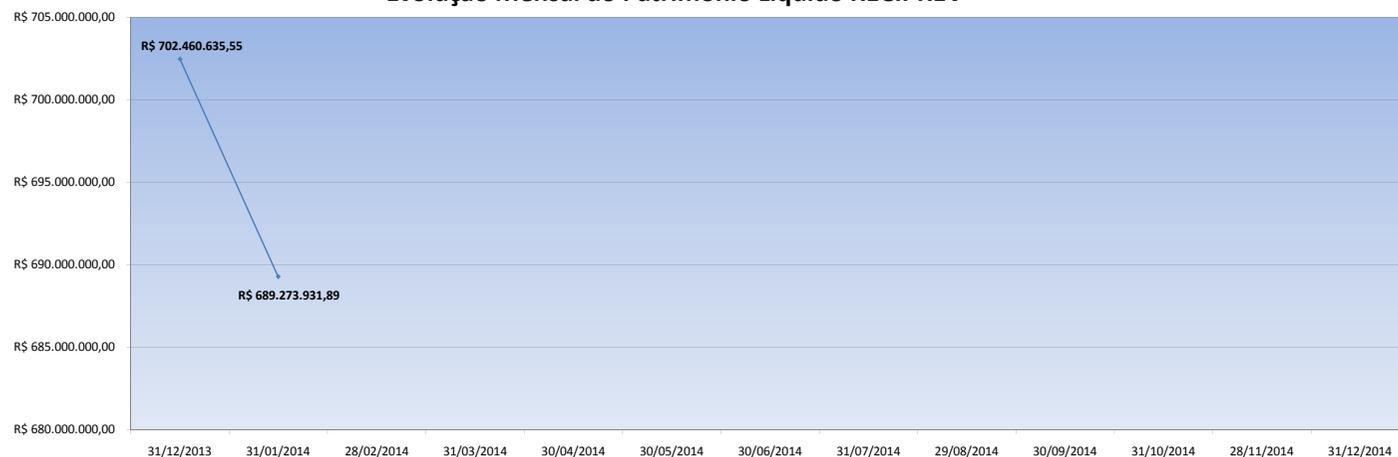
Composição - Renda Fixa X Renda Variável



Composição da Carteira RECIPREV (Administradores)

FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV	
RENDA FIXA	
Banco do Brasil	R\$ 229.253.263,45
Caixa Econômica	R\$ 202.536.038,17
Tesouro Nacional	R\$ 108.355.897,36
Gradual	R\$ 10.126.915,07
BNY Mellon	R\$ 3.104.171,28
TOTAL RF	R\$ 553.376.285,33
RENDA VARIÁVEL	
BNY Mellon	R\$ 53.244.351,91
BTG Pactual	R\$ 31.975.133,98
Caixa Econômica	R\$ 25.041.408,35
Banco do Brasil	R\$ 9.413.020,22
Concórdia	R\$ 8.439.983,20
NSG Capital	R\$ 2.993.087,41
Votorantim	R\$ 2.873.073,84
Geração Futuro	R\$ 1.917.587,65
TOTAL RV	R\$ 135.897.646,56
PATRIMÔNIO	R\$ 689.273.931,89

Evolução Mensal do Patrimônio Líquido RECIPREV



Evolução PL RECIPREV

FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV	
Data da posição	Patrimônio
31/12/2013	R\$ 702.460.635,55
31/01/2014	R\$ 689.273.931,89

Com a finalidade de controlar a inflação, o COPOM - Comitê de Política Monetária vem aumentando sucessivamente a taxa básica de juros, passando de 7,25% a.a em janeiro de 2013 para 10,50% a.a em janeiro de 2014, segundo reunião do COPOM realizada no mês de janeiro. Deste modo as NTN-B (Títulos do Governo) componentes diretos da carteira RECIPREV e papéis mais seguros do mercado, foram bastante penalizados visto que são marcados a mercado. No entanto esses papéis quando levados aos seus vencimentos cumprirão o acordado no ato da compra. Sendo assim, essas oscilações não afetam a solvência e o patrimônio do instituto, dado que os papéis em carteira, cujo vencimento se dará em 2045, pagam cupom de juros de IPCA + 6%, aderente com a meta atuarial.