

Relatório de Carteira Diária - Fechamento

Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores

Data da posição: 28/06/13

FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV

Composição da Carteira RECIPREV

FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV

RENDA FIXA

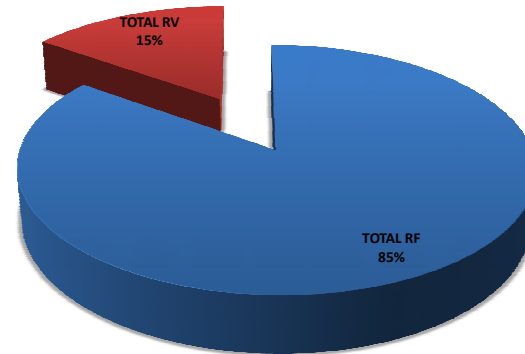
Caixa Econômica	R\$	210.263.497,66
Banco do Brasil	R\$	188.255.879,41
Tesouro Nacional	R\$	129.399.792,91
Banco Cruzeiro do Sul	R\$	6.519.791,14
TOTAL RF	R\$	534.438.961,12

RENDA VARIÁVEL

Caixa	R\$	22.042.587,03
BTG Pactual	R\$	13.936.132,14
Franklin Templeton	R\$	12.227.234,46
Quest	R\$	10.305.009,88
Perfin	R\$	7.832.462,84
Banco do Brasil	R\$	6.700.093,75
Humaitá Hedge FIM	R\$	5.426.719,82
XP Long Short FIM	R\$	4.338.287,13
Concórdia Set FIA	R\$	5.985.655,85
Ático Florestal FIM	R\$	2.998.954,31
CRPC	R\$	2.731.853,66
TOTAL RV	R\$	94.524.990,87

PATRIMÔNIO	R\$	628.963.951,99
-------------------	------------	-----------------------

Composição Renda Fixa X Renda Variável

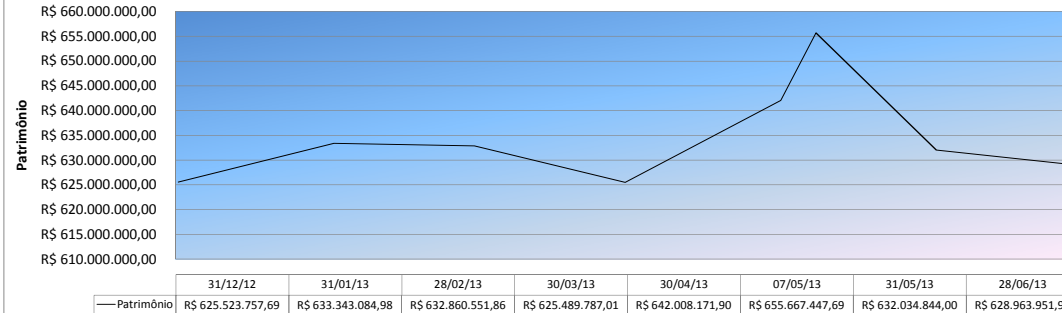


Evolução PL RECIPREV

FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV

Data da posição	Patrimônio
31/12/12	R\$ 625.523.757,69
31/01/13	R\$ 633.343.084,98
28/02/13	R\$ 632.860.551,86
30/03/13	R\$ 625.489.787,01
30/04/13	R\$ 642.008.171,90
07/05/13	R\$ 655.667.447,69
31/05/13	R\$ 632.034.844,00
28/06/13	R\$ 628.963.951,99

Patrimônio



Banco Cruzeiro do Sul: Recursos aplicados em 2010. Intervenção do Banco Central do Brasil em 2012. Recursos estão sendo amortizados mensalmente, com previsão de retorno total em Janeiro/2014.

Com a finalidade de controlar a inflação, o COMPOM - Comitê de Política Monetária vêm aumentando sucessivamente a taxa básica de juros, passando de 7,25% a em abril de 2013 para 8,5% a segundo reunião do COPOM realizada no mês de julho. Deste modo as NTN-Bs (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 cumprião o acordado no ato da compra. Sendo assim, essas oscilações não afetam a solvência e o patrimônio do instituto, já que os papéis em carteira, cujo vencimento se dará em 2045, pagam cupom de juros de IPCA + 6%, aderente com a meta atuarial.