

Relatório de Carteira Diária - Fechamento

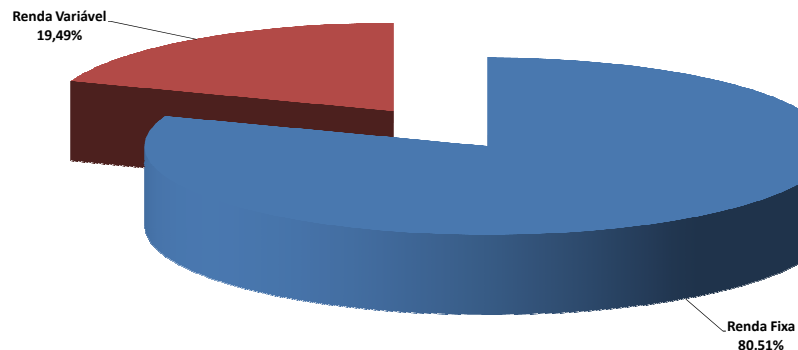
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores
Data da Posição: 31/03/2014

FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV

Composição da Carteira RECIPREV (Gestores)

FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV		
REDA FIXA		
Banco do Brasil	R\$	244.492.693,82
Caixa Econômica	R\$	169.238.956,47
Tesouro Nacional	R\$	115.441.696,41
Integral	R\$	40.010.031,40
Gradual	R\$	6.115.999,61
S.R.M.	R\$	4.126.371,32
Multinvest Capital	R\$	3.156.622,37
SulAmérica Investimentos	R\$	6.034.731,59
TOTAL	R\$	588.617.102,98
REDA VARIÁVEL		
Caixa Econômica	R\$	25.457.005,87
Ático	R\$	15.911.291,21
BTG Pactual	R\$	14.596.139,73
Franklin Templeton	R\$	12.148.425,57
Quest	R\$	10.933.004,89
Xp	R\$	9.900.308,78
Banco do Brasil	R\$	9.816.025,20
Set Investimentos	R\$	8.980.920,08
Perfin	R\$	7.843.592,22
Riviera	R\$	6.206.601,68
Humaitá	R\$	5.638.995,39
NSG Capital	R\$	5.985.748,97
CRPC	R\$	2.901.397,94
Votorantim	R\$	2.095.582,28
Geração Futuro	R\$	2.122.681,88
ARX	R\$	986.266,99
RB Capital	R\$	931.095,00
TOTAL	R\$	142.455.083,67
PATRIMÔNIO	R\$	731.072.186,65

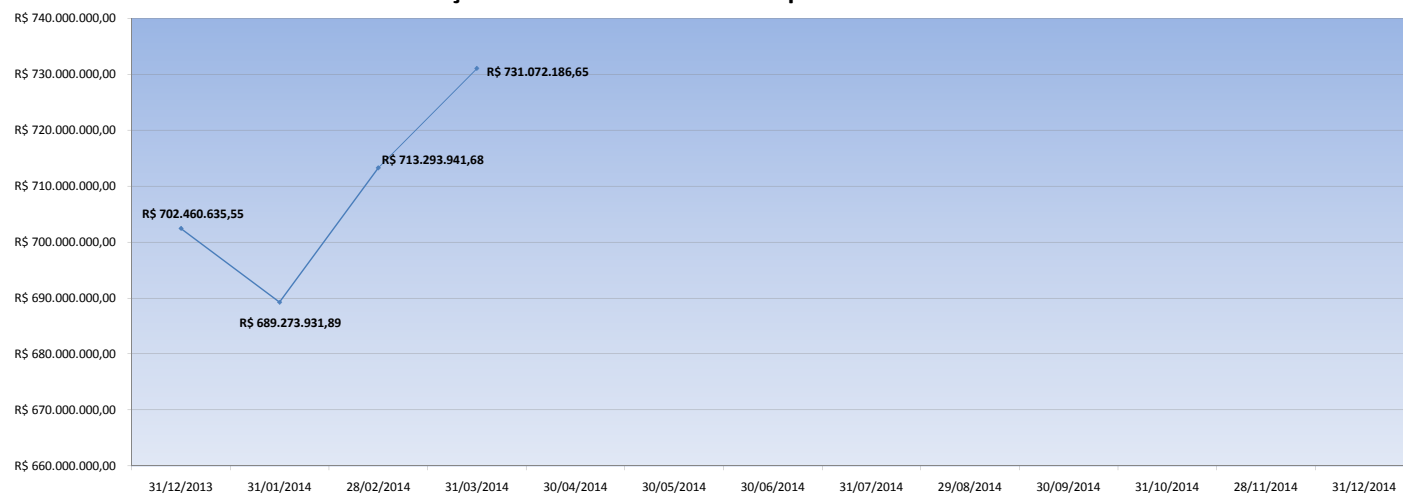
Composição - Renda Fixa X Renda Variável



Composição da Carteira RECIPREV (Administradores)

FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV		
REDA FIXA		
Banco do Brasil	R\$	244.492.693,82
Caixa Econômica	R\$	209.248.987,87
Tesouro Nacional	R\$	115.441.696,41
Gradual	R\$	10.242.370,93
BNY Mellon	R\$	3.156.622,37
SulAmérica Investimentos	R\$	6.034.731,59
TOTAL RF	R\$	588.617.102,98
REDA VARIÁVEL		
BNY Mellon	R\$	53.693.287,56
BTG Pactual	R\$	33.372.736,84
Caixa Econômica	R\$	25.457.005,87
Banco do Brasil	R\$	9.816.025,20
Concórdia	R\$	8.980.920,08
NSG Capital	R\$	5.985.748,97
Votorantim	R\$	3.026.677,28
Geração Futuro	R\$	2.122.681,88
TOTAL RV	R\$	142.455.083,67
PATRIMÔNIO	R\$	731.072.186,65

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
28/02/2014	R\$	713.293.941,68
31/03/2014	R\$	731.072.186,65

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 em janeiro de 2013 para 11%.a em abril de 2014, segundo reunião do COPOM realizada no mês de abril. 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.