

Relatório de Carteira Diária - Fechamento

Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores
Data da Posição: 31/12/2013

FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV

Composição da Carteira RECIPREV (Gestores)

FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV		
RENDA FIXA		
Banco do Brasil	R\$	238.350.127,02
Caixa Econômica	R\$	164.571.013,72
Tesouro Nacional	R\$	114.487.724,05
Integral	R\$	38.500.945,40
S.R.M.	R\$	4.008.887,35
Multinvest Capital	R\$	3.081.365,23
TOTAL	R\$	563.000.062,78
RENDA VARIÁVEL		
Caixa Econômica	R\$	26.196.288,11
Ático	R\$	15.946.099,74
BTG Pactual	R\$	14.551.207,06
Franklin Templeton	R\$	12.817.436,31
Quest	R\$	11.659.156,18
Banco do Brasil	R\$	10.241.442,79
Xp	R\$	9.616.949,48
Set Investimentos	R\$	9.431.779,83
Perfin	R\$	8.223.911,85
Riviera	R\$	6.149.283,90
Humaitá	R\$	5.638.987,36
CIPC	R\$	3.013.182,69
NSG Capital	R\$	2.996.492,44
Votorantim	R\$	2.033.355,01
RB Capital	R\$	945.000,00
TOTAL	R\$	139.460.572,76
PATRIMÔNIO	R\$	702.460.635,54

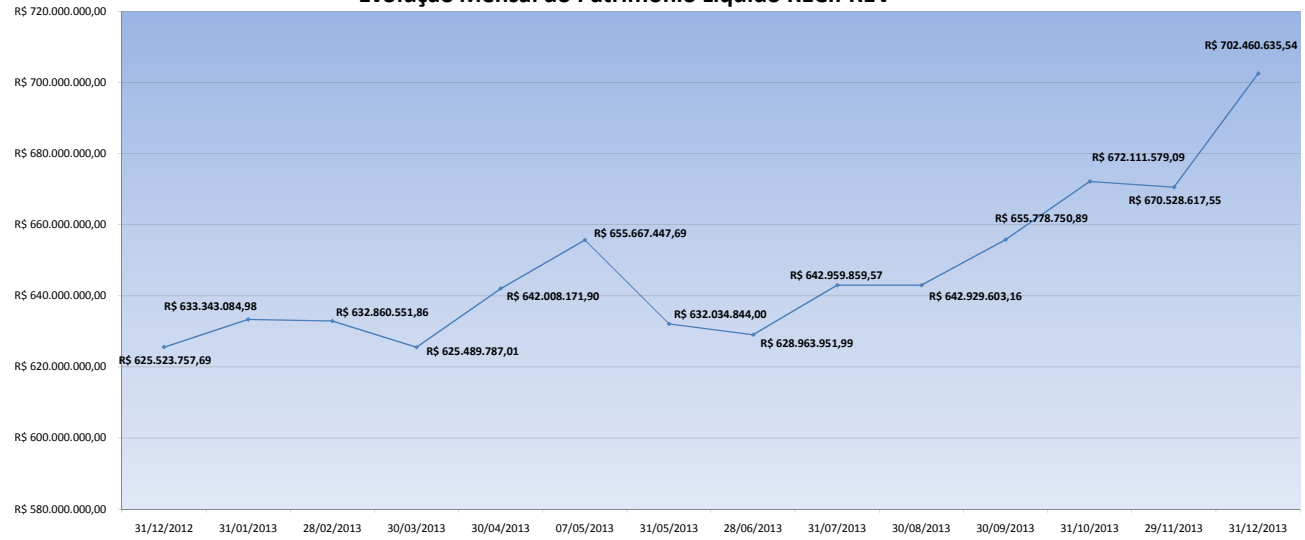
Composição - Renda Fixa X Renda Variável



Composição da Carteira RECIPREV (Administradores)

FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV		
RENDA FIXA		
Banco do Brasil	R\$	238.350.127,02
Caixa Econômica	R\$	203.071.959,12
Tesouro Nacional	R\$	114.487.724,05
Gradual	R\$	4.008.887,35
BNY Mellon	R\$	3.081.365,23
TOTAL RF	R\$	563.000.062,78
RENDA VARIÁVEL		
BNY Mellon	R\$	53.181.939,48
BTG Pactual	R\$	34.434.275,09
Caixa Econômica	R\$	26.196.288,11
Banco do Brasil	R\$	10.241.442,79
Concórdia	R\$	9.431.779,83
Votorantim	R\$	2.978.355,01
NSG Capital	R\$	2.996.492,44
TOTAL RV	R\$	139.460.572,76
PATRIMÔNIO	R\$	702.460.635,54

Evolução Mensal do Patrimônio Líquido RECIPREV



Evolução PL RECIPREV

FUNDO PREVIDENCIÁRIO RECIPREV		
Data da posição		Patrimônio
31/12/2012	R\$	625.523.757,69
31/01/2013	R\$	633.343.084,98
28/02/2013	R\$	632.860.551,86
30/03/2013	R\$	625.489.787,01
30/04/2013	R\$	642.008.171,90
07/05/2013	R\$	655.667.447,69
31/05/2013	R\$	632.034.844,00
28/06/2013	R\$	628.963.951,99
31/07/2013	R\$	642.959.859,57
30/08/2013	R\$	642.929.603,16
30/09/2013	R\$	655.778.750,89
31/10/2013	R\$	672.111.579,09
29/11/2013	R\$	670.528.617,55
31/12/2013	R\$	702.460.635,54

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%a.a em novembro de 2013, segundo reunião do COPOM realizada no mês de novembro. 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.