

MANUAL NORMATIVO DO MONITORAMENTO DE RISCO

SUMARIO

1	OBJETIVO.....	3
2	DEFINIÇÕES.....	3
2.1	DEFINIÇÕES DE TERMOS UTILIZADOS	3
2.1.1	PLANO ANUAL DE INVESTIMENTOS....	3
2.1.2	OPERAÇÃO COMPROMISSADA.....	3
2.1.3	FUNDO DE INVESTIMENTO.....	3
3	SIGLAS UTILIZADAS.....	3
4	NORMAS.....	4
4.1	DISPOSIÇÕES GERAIS.....	4
4.2	ENQUADRAMENTOS À RESOLUÇÃO DO CMN E DO PAI.....	4
4.2.4	DEMONSTRATIVO DA POLÍTICA DE INVESTIMENTOS-DPIN	4
4.2.17	DEMONSTRATIVO DAS APLICAÇÕES E INVESTIMENTOS DOS RECURSOS	5
4.3	MONITORAMENTO DO RISCO NOS INVESTIMENTOS	6
4.4	ANÁLISE DE CONFORMIDADE DAS APR – PADRONIZAÇÃO DO PROCESSO MENSAL.....	7
5	MODELAGEM BIZAGI.....	9
5.1	GRÁFICO - DPIN.....	9
5.2	GRÁFICO – DAIR.....	10
5.3	GRÁFICO – MONITORAR RISCOS NOS INVESTIMENTOS.....	11
5.3	GRÁFICO – ANÁLISE DE CONFORMIDADE DAS APRs	12
5.4	DEMONSTRATIVO DA POLÍTICA DE INVESTIMENTOS – (cópia anexa).....	13
5.5	DEMONSTRATIVO DAS APLICAÇÕES E INVESTIMENTOS DOS RECURSOS - DAIR – (cópia anexa).....	16

PREFÁCIO

TÍTULO

MANUAL NORMATIVO DE MONITORAMENTO DE RISCO

UNIDADES GESTORAS

ARI – ASSESSORIA DE RISCO DA DIRETORIA DE INVESTIMENTOS

GOP – GERÊNCIA DE OPERAÇÕES E PLANEJAMENTO

PÚBLICO ALVO

Diretorias

Assessorias

Gerências

Coordenadorias

LEGISLAÇÃO UTILIZADA

Resolução CMN 3.922 de 25 de Novembro de 2010.

Lei Estadual nº 3.189 de 22 de Fevereiro de 1999.

Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011.

Portaria MPS nº 170 de 25 de Abril de 2012.

Portaria MPS nº 347 de 30 de julho de 2012.

Plano Anual de Investimentos

1. OBJETIVO

- 1.1 Estabelecer e normatizar procedimentos para o monitoramento dos riscos quanto ao enquadramento dos investimentos do RPPS diante da resolução vigente do Conselho Monetário Nacional – CMN, e o envio dos informativos periódicos à SPS/MPS.
- 1.2 Normatizar procedimentos para avaliação do desempenho e a composição dos fundos de investimento em que o Rioprevidência possua recursos aplicados, considerando os aspectos, cenário econômico, volatilidade, rentabilidade acumulada dos investimentos comparada com a meta atuarial e perfil de risco do Fundo.
- 1.3 Estabelecer normas para a padronização da análise de conformidade na elaboração do Processo Mensal de Análise de Risco das APR – Autorização de Aplicação e Resgate na GOP – Gerência de Operações e Planejamento/Diretoria de Investimentos.

2. DEFINIÇÕES

2.1 DEFINIÇÕES DOS TERMOS UTILIZADOS

2.1.1. PLANO ANUAL DE INVESTIMENTOS

Relatório que estabelece as diretrizes, metas e limites à gestão de investimentos do Fundo com base na Resolução vigente do Conselho Monetário Nacional – CMN.

2.1.2. OPERAÇÃO COMPROMISSADA

É uma aplicação financeira onde o Banco vende ao cliente títulos públicos ou privados, com o compromisso de recompra.

2.1.3. FUNDO DE INVESTIMENTO

É uma comunhão de recursos financeiros, constituída sob a forma de condomínio, destinado à aplicação em títulos e valores mobiliários, bem como em quaisquer outros ativos disponíveis no mercado financeiro e de capitais, observadas as disposições legais.

3. SIGLAS UTILIZADAS

GOP – Gerência de Operações e Planejamento

CPJ – Coordenação de Planejamento

DIN – Diretoria de Investimentos

ARI – Assessoria de Risco

Rioprevidência – Fundo Único de Previdência Social do Estado do Rio de Janeiro.

CDI – Certificado de Depósito Interfinanceiro

IDkA – Índice de duração constante ANBIMA

IMA – Índice de Mercado ANBIMA

ATE – Assessoria de Tesouraria

FI/FIC – Fundo de Investimento / Fundo de Investimento em cotas do Fundo de Investimento

RPPS – Regime Próprio de Previdência Social

DPIN – Demonstrativo da Política de Investimentos

4. NORMAS

4.1. DISPOSIÇÕES GERAIS

4.1.1 O monitoramento do risco nos investimentos, é exercido pela ARI-Assessoria de Risco, subordinada à Diretoria de Investimentos do Rioprevidência, tendo como função, mitigar, monitorar e controlar riscos, por meio da revisão e mapeamento de todos os processos da área de investimentos, do mapeamento de riscos, da definição e melhoria dos controles gerenciais, do monitoramento diário de indicadores de risco, da análise das regulamentações e seus impactos sobre o Fundo.

4.1.2 Para atender os objetivos do Manual Normativo, o processo de monitoramento de risco nos investimentos do Rioprevidência, está apresentado em três tópicos:

4.1.2.1 Enquadramento aos Limites Definidos e Política de Exposição aos Riscos Envolvidos;

4.1.2.2 Monitoramento de Risco nos Investimentos e Acompanhamento Diário das Aplicações e Resgates;

4.1.2.3 Análise de Conformidade nas Aplicações e Resgates.

4.2. Enquadramentos à Resolução do CMN e do PAI, e Informes à SPS/MPS.

4.2.1. O Art. 1º da Resolução 3.922 de 25/11/2010, estabelece que os recursos dos regimes próprios de previdência social instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios, nos termos da Lei nº 9.717 de 27 de novembro de 1998, devem ser aplicados conforme as disposições desta Resolução, tendo presentes as condições de segurança, rentabilidade, solvência, liquidez e transparência.

4.2.2. Antes do encerramento de cada exercício financeiro, a DIN elabora a política anual de investimentos para o próximo ano, de que trata a Resolução do CMN, mediante envio à Secretaria de Políticas de Previdência Social – SPS do Demonstrativo da Política de Investimentos – DPIN.

4.2.2.1 As instruções de preenchimento dos demonstrativos devem ser acessadas em:

<http://previdencia.gov.br> (Previdência no Serviço Público/Elaboração de Demonstrativos/

CADPREV Ente Local / Baixar/Instalar/Ajuda/Manual do Usuário-Internet/DPIN-DAIR)

4.2.3. A comprovação da condução da política de investimentos, ocorrerá mediante o preenchimento dos campos específicos do DPIN enviado anualmente, e do Demonstrativo das Aplicações e Investimentos dos Recursos – DAIR enviado a cada bimestre, à SPS/MPS, ambos em formato de arquivo eletrônico (Portaria MPS nº 204 de 10/07/2008 e nº 347 de 30/07/2012)

4.2.4. **Demonstrativo da Política de Investimentos (DPIN)** – o Rioprevidência, na qualidade de RPPS irá preencher os dados cadastrais solicitados pelo sistema, relativos ao Ente Federativo, seu representante legal e o Gestor de Recursos, que deve estar certificado por entidade autônoma reconhecida.

4.2.5. Com relação a meta de rentabilidade dos investimentos, o Rioprevidência irá informar a sua meta atuarial.

4.2.6. Irá informar os limites máximos de alocação dos recursos entre os diversos segmentos e carteiras, de acordo com a estratégia adotada na política de investimentos do

Rioprevidência, em consonância com o perfil de suas obrigações, visando à consecução e manutenção do equilíbrio financeiro e atuarial.

- 4.2.7. Deverá descrever sucintamente o entendimento do Rioprevidência em relação aos cenários macroeconômicos futuros, indicando a forma de análise para escolha dos segmentos selecionados para investimentos.
- 4.2.8. Informar os objetivos e modelo de gestão adotado, a meta de rentabilidade que será perseguida, a tolerância de risco para os diferentes segmentos de aplicação e metas para os custos administrativos.
- 4.2.9. Com relação a estratégia de formação de preços, o Rioprevidência irá informar os critérios e metodologias adotadas nas análises que orientem as decisões de compra e venda de ativos.
- 4.2.10. Para o RPPS com um patrimônio superior a R\$ 5 milhões, é obrigatória a criação de um Comitê de Investimentos como órgão auxiliar no processo decisório quanto a execução da política de investimentos.
- 4.2.11. Caso haja contratação de Administração de Carteiras de renda fixa e renda variável, serão informados os critérios para escolha e a contratação de pessoas jurídicas autorizadas ou credenciadas, nos termos da legislação em vigor (Portaria MPS nº 170 de 25/04/2012 Art. 3º "I", e Art 3º A e B) .
- 4.2.12. Deverá ser informado como será avaliado o desempenho dos gestores externos de ativos, a periodicidade dessa avaliação e a diversificação da gestão.
- 4.2.13. No item Observações do DPIN, deverão ser inseridos os comentários julgados relevantes, desde que não tenham sido citados nos itens anteriores.
- 4.2.14. Com a confirmação dos dados do DPIN, é acessado o módulo CADPREV-Ente Local e gerado o arquivo eletrônico XML . Esse arquivo será enviado à SPS através do módulo CADPREV-WEB e irá compor o banco de dados do sistema CADPREV-SPS/MPS. Através do CADPREV-WEB o arquivo DPIN será acessado e impresso para receber a assinatura dos responsáveis.
- 4.2.15. O documento será digitalizado e o arquivo gerado, enviado por via eletrônica através do CADPREV-WEB. Essa documentação ficará à disposição dos órgãos de controle e supervisão competentes pelo prazo de 10 (dez) anos.
- 4.2.16. A estrutura do DPIN será disponibilizada pela SPS na página do MPS até 31 de dezembro de cada exercício em relação ao exercício seguinte.
- 4.2.17. **Demonstrativo das Aplicações e Investimentos dos Recursos – DAIR** – o Rioprevidência, como gestor do RPPS, envia no mês seguinte ao encerramento de cada bimestre específico, o arquivo eletrônico para compor o Sistema de Informações dos Regimes Públicos de Previdência Social – CADPREV na Secretaria de Políticas de Previdência Social (SPS) do Ministério da Previdência Social (MPS).
- 4.2.18. O módulo DAIR deverá ser instalado por via eletrônica, o que irá permitir a sua atualização a cada período, conforme a especificação do sistema . Para o acesso as funcionalidades do DAIR e composição dos dados para informação é necessário o acesso a página inicial de manutenção (cadastro, alteração, visualização e geração de XML).

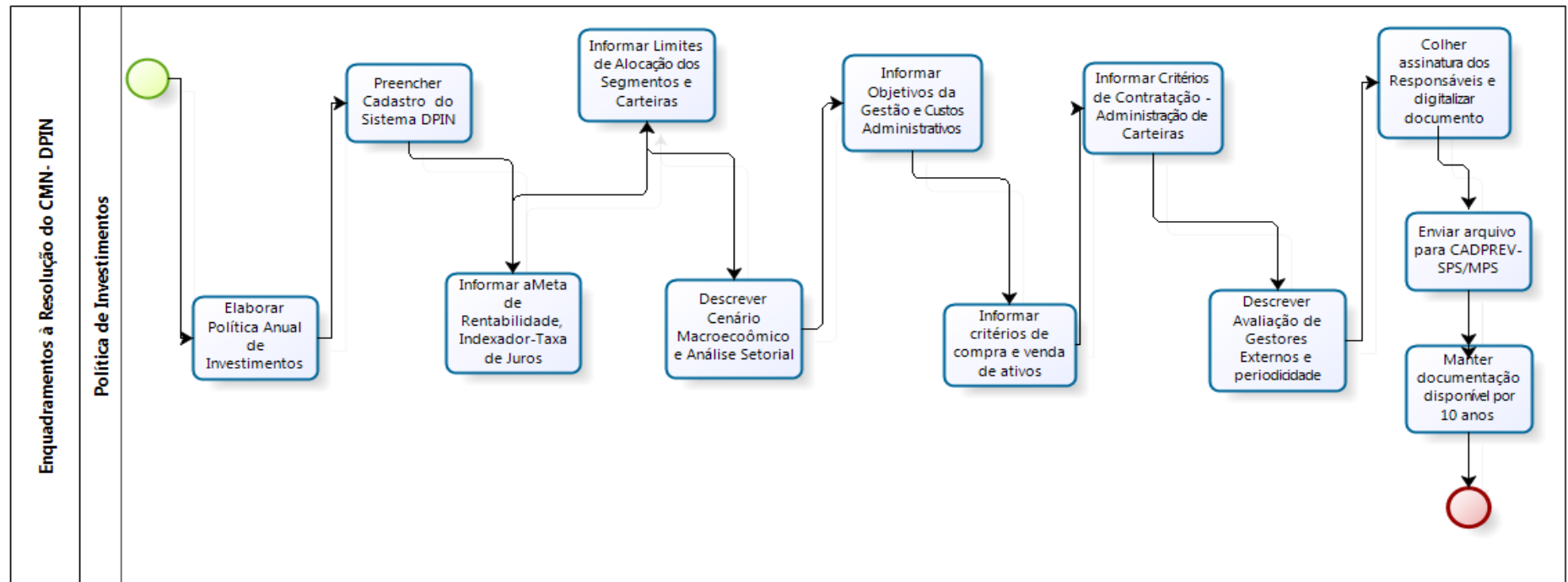
- 4.2.19. É feito o cadastro inicial, cuja rotina é a mesma do DPIN, conforme descrito no item 4.2.4. Deve ser especificado o exercício financeiro e o bimestre de referência, o nome da entidade credenciada a que se refere o demonstrativo, o tipo de gestão, o CNPJ da mesma, e a existência ou não de Operação com Títulos do Tesouro Nacional no bimestre..
- 4.2.20. Registro das Informações – nesse item é feito o registro da posição dos recursos correntes e ativos que o Rioprevidência possui no encerramento do bimestre, de acordo com o segmento listado no sistema informatizado, com base na Resolução vigente do CMN.
- 4.2.21. De acordo com a composição dos ativos e as operações realizadas pelo Rioprevidência, são disponibilizadas as informações relativas aos segmentos: Fundos de Investimento, Operação Compromissada, Ativos vinculados por lei ao RPPS, demais bens, direitos e ativos (Certificado Financeiro, Bens Imóveis, etc) e Disponibilidades Financeiras.
- 4.2.22. No registro da posição do investimento em cada Fundo de Investimento, deve ser informado o segmento, Renda Fixa ou Variável, o tipo de ativo que se enquadra conforme disposto na Res. 3.922/2010, a Instituição Financeira e o CNPJ, o nome do Fundo e CNPJ, a quantidade de cotas possuídas, o valor atual da cota, o índice de referência, (se é CDI, IMA ou outro) e o patrimônio líquido do fundo.
- 4.2.23. As informações geradas irão compor o arquivo DAIR do bimestre, permitindo a sua visualização e impressão através do acesso à página inicial do sistema CADPREV-Ente Local.
- 4.2.24. Para o envio do DAIR é necessário gerar o arquivo eletrônico XML, o que é executado de forma automática, marcando o bimestre correspondente na página inicial do CADPREV-Ente Local.
- 4.2.25. No envio do arquivo, é necessário acessar www.previdencia.gov.br- [Previdência no Serviço Público – Cadprev-Web-Envio e Consulta de Demonstrativos](#).
- 4.2.26. A regularidade nas informações do DPIN e DAIR e o cumprimento das normas é um dos itens exigidos para o recebimento do Certificado de Regularidade Previdenciária – CRP, emitido semestralmente pela SPS-Secretaria de Políticas de Previdência Social.
- 4.3. **Monitoramento de Risco nos Investimentos – Avaliação de Desempenho e Composição dos Fundos.**
- 4.3.1. Para o cumprimento da Política de Investimento e as decisões do Comitê de Investimento realizado mensalmente, a ARI diariamente verifica a conformidade da APR-Autorização de Aplicação e Resgate emitido pela GOP, e se a mesma está respeitando a regulamentação da Resolução vigente.
- 4.3.2. Todo o detalhamento do movimento das aplicações e resgates nos fundos de investimento através das APRs está disponível no Manual Específico – **NORMATIZAÇÃO DO PROCESSO DE APLICAÇÃO E/RESGATE EM FUNDOS DE INVESTIMENTO**, versão 1.1 de 19/09/2011.
- 4.3.3. Entretanto, algumas rotinas acessórias são executadas pela ARI, e estão enumeradas a seguir:
- 4.3.4. **Padronização de Processos** - implementar, acompanhar e fiscalizar o mapeamento dos processos relativos a elaboração dos Manuais Normativos da DIN.

- 4.3.5. **Limites das Aplicações** – Verificar os valores e percentuais máximos de alocação em cada fundo de investimento em relação ao seu patrimônio líquido, conforme a legislação vigente e o enquadramento aos limites definidos.
- 4.3.6. **Análise da Carteira por Tipo de Risco** - com base na posição do ativo total do Fundo em cada mês, analisar diariamente o percentual que está sendo comprometido em relação à legislação vigente e ao PAI, para os segmentos nas aplicações de subíndices do IMA ou do IDKA, das aplicações vinculadas ao índice CDI, das Operações Compromissadas, dos FI/FIC RF ou Referenciado (Crédito Privado), Renda Variável, FI Multimercado e FI Imobiliário.
- 4.3.7. **Análise da Rentabilidade** – acompanhar diariamente a rentabilidade alcançada por cada tipo de Fundo de Investimento nas instituições financeiras credenciadas, e ainda, o acumulado no mês, no ano e em doze meses, e o índice de volatilidade. Justificar o enquadramento das operações diárias nas APRs.
- 4.3.8. **Aderência às Normas** – analisar com base na legislação vigente, o lastro dos ativos dos fundos de investimento, através das carteiras emitidas pelas Instituições Financeiras.
- 4.3.9. Nesses últimos itens, a ARI acompanha e decide num trabalho conjunto com a Coordenação de Planejamento da GOP.
- 4.4. **Análise de Conformidade das APR - Padronização do Processo Mensal.**
- 4.4.1. Após a confirmação de cada execução de Aplicação/ou Resgate em Fundos de Investimento pelas Instituições Financeiras, a ATE anexa à APR, os extratos bancários que comprovem a realização do processo de Aplicação e/ou Resgate em Fundos de Investimento e encaminha à Gerência de Controladoria. (item 3.2.7.1 do Processo de Aplicação e/ou Resgate em Fundos de Investimento).
- 4.4.2. A Gerência de Controladoria deverá registrar a Aplicação e/ou Resgate em Fundos de Investimento no Sistema Computacional SIAFEM, e fazer a juntada das impressões dos registros contábeis que comprovem a Aplicação e/ou Resgate em Fundos de Investimento executadas e encaminha à Assessoria de Risco da DIN até o dia 20 (vinte) do mês seguinte a que se referem as movimentações.
- 4.4.3. A ARI ao receber a documentação do Processo da Gerência de Controladoria, deverá conferir se constam todas as APRs emitidas no mês em referência, e verificar se a Aplicação e/ou Resgate em Fundos de Investimento foi contabilizada de acordo com o Plano de Contas definido por norma específica do setor público.
- 4.4.4. Caso o processo não contenha os registros e/ou não tenha sido realizado conforme solicitado, e/ou não contenha toda a documentação necessária, a ARI deverá solicitar ao Setor responsável, mediante Comunicação Interna, a complementação desses documentos, no que deverá ser atendido dentro do prazo de 10 (dez) dias da emissão da mesma.
- 4.4.5. Caso a Aplicação e/ou Resgate em Fundos de Investimento não tenha sido realizada conforme o requisitado, a ARI deverá verificar o motivo da ocorrência e comunicar ao Diretor de Investimentos, anexando as causas das inconsistências.
- 4.4.6. Após verificar toda a documentação do processo, a ARI deverá dar visto a mesma, atestando a conformidade e elaborar um Processo Mensal de Aplicação e/ou Resgate, composto das APRs diárias, e juntando na abertura do mesmo, a Ata da Reunião e a apresentação impressa do Comitê de Investimentos do mês em referência. E encaminhar ao Diretor de Investimentos.

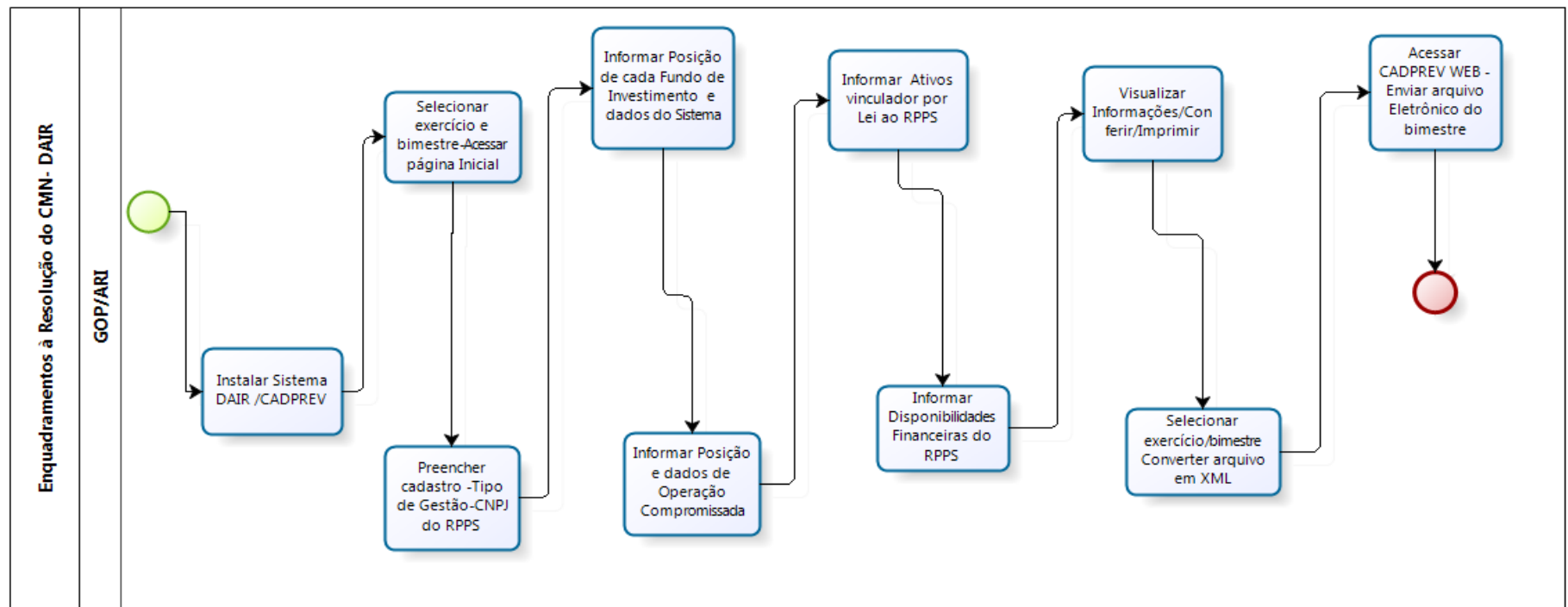
- 4.4.7. Após receber o Processo proveniente da ARI, o Diretor de Investimentos verifica se as movimentações ocorreram com aderência às normas e as aprova através da assinatura em cada APR , em caso contrário deverá retornar à ARI para cumprir exigências.
- 4.4.8. A ARI deverá arquivar o Processo com toda documentação na própria área, mantendo-o disponível pelo período de 12 (doze) meses, caso haja solicitação do mesmo por parte do Tribunal de Contas do Estado, Auditoria Interna ou Externa.
- 4.4.9. Após decorrido os 12 (doze) meses, o Processo de Aplicação e/ou Resgate deverá ser encaminhado ao Arquivo Geral do Rioprevidência.

5 – MODELAGEM BIZAGI

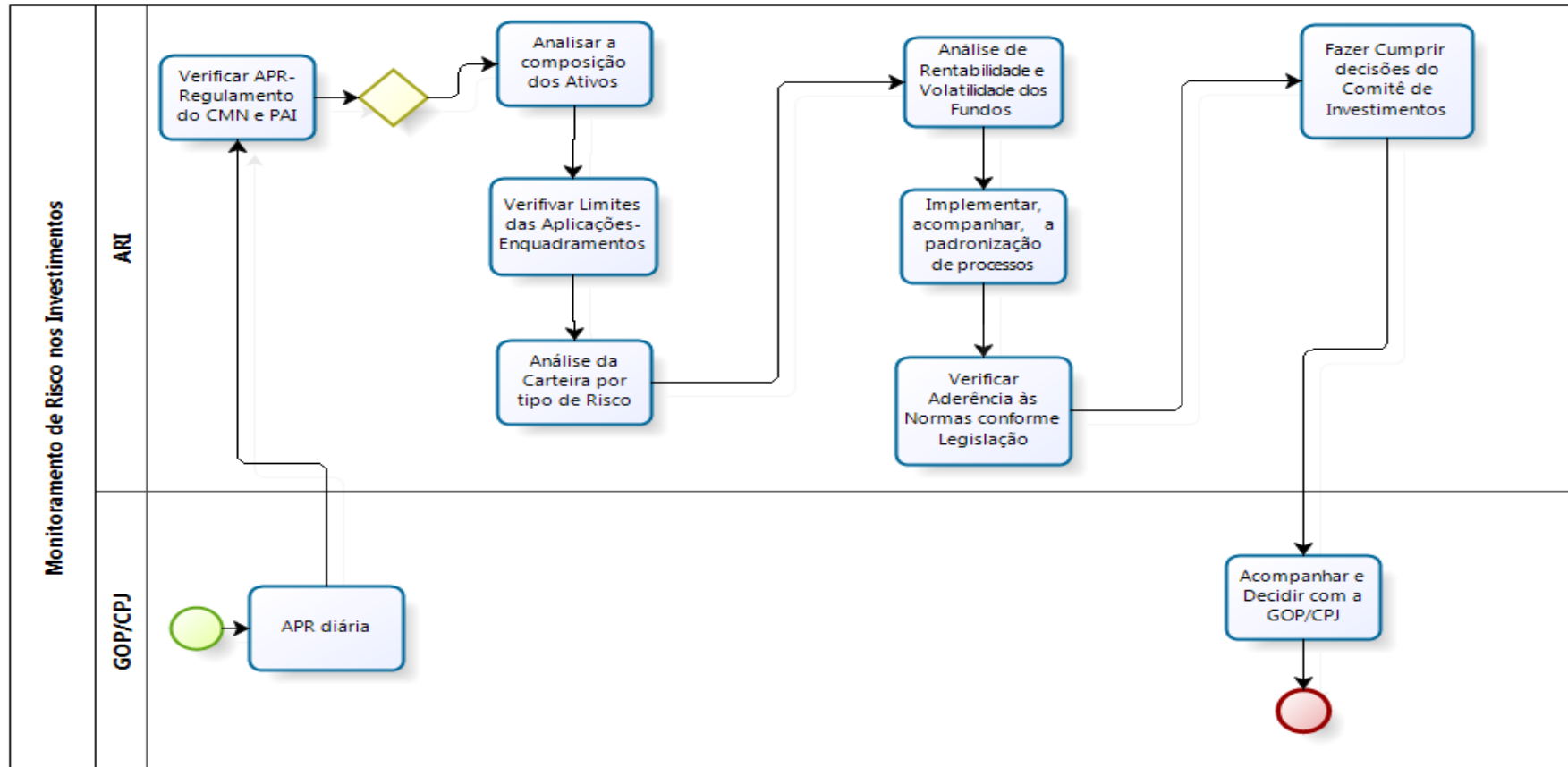
5.1 – GRÁFICO - DPIN



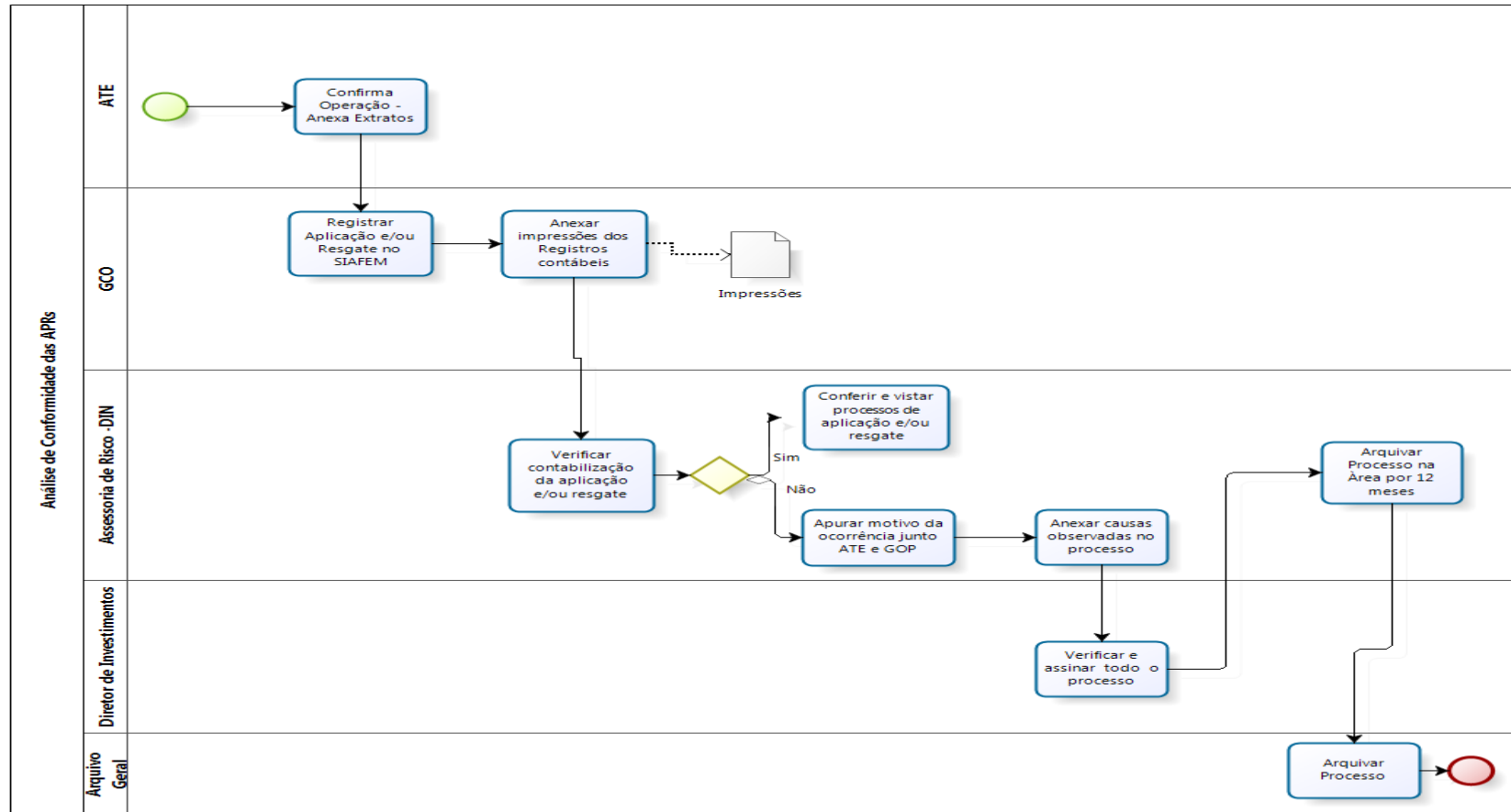
5.2 – GRÁFICO - DAIR



5.3 – GRÁFICO - MONITORAR RISCOS



5.4 – GRÁFICO – ANÁLISE DE CONFORMIDADE DAS APRs





DEMONSTRATIVO DA POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

1. ENTE

Nome: Governo do Estado do Rio de Janeiro / RJ
Endereço: Rua Pinheiro Machado S/n
Bairro: Laranjeiras
Telefone: (021) 2334-3773 **Fax:** (021) 2334-3559
CNPJ: 42.498.600/0001-71
Complemento: Rio de Janeiro
CEP: 22231-009
E-mail: telmaoliveira@gabgovernador.rj.gov.br

2. REPRESENTANTE LEGAL DO ENTE

Nome: Sergio de Oliveira Cabral Santos Filho
Cargo: Governador
E-mail: sergiocabral@governador.rj.gov.br
CPF: 744.636.597-87
Complemento do Cargo: Governador
Data Início de Gestão: 01/01/2007

3. REGIME PRÓPRIO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL/MUNICÍPIO/UF

Nome: Rioprevidência - Fundo Único de Previdência Social do Estado do Rio de Janeiro
Endereço: Rua da Quitanda nº 106
Bairro: Centro
Telefone: (021) 2332-5338 **Fax:** (021) 2332-5337
CNPJ: 03.066.219/0001-81
Complemento: Rio de Janeiro - RJ
CEP: 20091-005
E-mail: investimentos@rioprevidencia.rj.gov.br

4. REPRESENTANTE LEGAL DA UNIDADE GESTORA

Nome: Gustavo de Oliveira Barbosa
Cargo: Diretor
Telefone: (021) 2332-5338 **Fax:** (021) 2332-5337
Complemento do Cargo: Diretor Presidente
E-mail: gustavo.barbosa@rioprevidencia.rj.gov.br
CPF: 494.126.476-20
Data Início de Gestão: 06/10/2010

5. GESTOR DE RECURSOS

Nome: Antonio Paulo Vogel de Medeiros
Cargo: Diretor
Telefone: (021) 2332-5356 **Fax:** (021) 2332-5337
Entidade Certificadora: ANBIMA - CPA 20
Complemento do Cargo: Diretor de Investimentos
E-mail: antonio.medeiros@rioprevidencia.rj.gov.br
CPF: 012.085.237-32
Data Início de Gestão: 15/06/2007
Validade Certificação: 01/05/2014

6. RESPONSÁVEL PELO ENVIO

Nome: Carlos Augusto Bastos Fernandes
Telefone: (021) 2332-5210 **Fax:** (021) 2332-5337
Data de envio: 21/12/2012
CPF: 101.723.007-20
E-mail: carlosfernandes@rioprevidencia.rj.gov.br

26/12/12 09:29 v2.0

Página 1 de 3

7. DEMONSTRATIVO		
Exercício: 2013		
Responsável pela Elaboração da Política de Investimentos: Antonio Paulo Vogel de Medeiros		CPF: 012.085.237-32
Data da Elaboração: 13/12/2012	Data da ata de aprovação: 13/12/2012	
Órgão superior competente: CONAD		
Meta de Rentabilidade dos Investimentos		
Indexador: INPC	Taxa de Juros: 6,00 %	
Divulgação/Publicação: (X) Meio Eletrônico () Impresso		
RESUMO DA POLÍTICA DE INVESTIMENTOS		
Alocação dos Recursos/Diversificação	Alocação dos recursos	
	Limite da Resolução %	Estratégia de Alocação %
Renda Fixa - Art. 7º		
Títulos Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I, "a"	100,00	100,00
FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b"	100,00	100,00
Operações Compromissadas - Art. 7º, II	15,00	2,80
FI Renda Fixa/Referenciados RF - Art. 7º, III	80,00	80,00
FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV	30,00	4,00
Poupança - Art. 7º, V	20,00	0,00
FI em Direitos Creditórios - Aberto - Art. 7º, VI	15,00	0,00
FI em Direitos Creditórios - Fechado - Art. 7º, VII, "a"	5,00	0,00
FI Renda Fixa "Crédito Privado" - Art. 7º, VII, "b"	5,00	1,50
Renda Variável - Art. 8º		
FI Ações referenciados - Art. 8º, I	30,00	0,15
FI de Índices Referenciados em Ações - Art. 8º, II	20,00	0,01
FI em Ações - Art. 8º, III	15,00	0,01
FI Multimercado - aberto - Art. 8º, IV	5,00	0,30
FI em Participações - fechado - Art. 8º, V	5,00	0,30
FI Imobiliário - cotas negociadas em bolsa - Art. 8º, VI	5,00	0,44
Total		289,51
Declaro que o valor excedido do limite do somatório dos Segmentos "Renda Fixa" e "Renda Variável", está compatível com a Política de Investimentos aprovada pelas instâncias competentes e consolidada neste Demonstrativo, conforme documentos arquivados		
Cenário Macroeconômico e Análise Setorial para Investimentos		
O ano de 2013 deverá ainda ser um período de continuidade da recuperação econômica no mundo, ainda com períodos de volatilidade nos mercados. A expectativa para o cenário doméstico é de um crescimento menos expressivo do PIB, com redução ou manutenção da taxa de juros. A fim de manter a segurança dos investimentos o Rioprevidência deve buscar aplicações em fundos de investimento com baixa volatilidade, especialmente para o Fundo Financeiro. Consideramos a possibilidade de diversificação em fundos de mais longo prazo na busca de maior rentabilidade, principalmente no Fundo Previdenciário.		
Objetivos da gestão		
Buscar ações de otimização de rentabilidade dos ativos e do fluxo de caixa, acompanhadas de medidas de mitigação de riscos de mercado, crédito, e liquidez, tendo como medida de comparação a meta atuarial (taxa de juros de 6% a.a + INPC). Com relação aos custos administrativos, será obedecido o limite máximo estabelecido em legislação específica sempre em um processo competitivo de técnica e/ou preço		

26/12/12 09:29 v2.0

Página 2 de 3

Estratégia de formação de preços - investimentos e desinvestimentos			
Para o ano de 2013, o foco para o Fundo Financeiro será realizar movimentações predominantemente em Fundos de Investimento e Operações Compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais. A obtenção de resultados otimizados no longo prazo compatível com o perfil do Passivo Atuarial serão direcionadores para os investimentos do Fundo Previdenciário.			
Critérios de Contratação - Administração de carteiras de renda fixa e renda variável			
Em caso de contratação, a mesma será realizada por procedimento competitivo de credenciamento nos termos da Portaria Rioprevidência em vigor, publicado no site da Internet do RPPS.			
Testes Comparativos e de Avaliação para acompanhamento dos resultados dos gestores e da diversificação da gestão externa dos ativos			
Nos termos da Portaria RIOPREVIDÊNCIA em vigor conforme o retorno e a volatilidade dos ativos, publicado no site do RPPS (http://www.rioprevidencia.rj.gov.br)			
Observações			
Sem observações			
Declaração: A Política de Investimentos completa e a documentação que a suporta, encontra-se à disposição dos órgãos de controle e supervisão competentes			
Representante Legal do Ente:	744.636.597-87 - Sergio de Oliveira Cabral Santos Filho	Data: 24/12/2012	Assinatura: 
Representante Legal da Unidade Gestora:	494.126.476-20 - Gustavo de Oliveira Barbosa	Data: 27/02/2012	Assinatura: 
Gestor de Recurso RPPS:	012.085.237-32 - Antonio Paulo Vogel de Medeiros	Data: 26/12/2012	Assinatura: 
Responsável:	101.723.007-20 - Carlos Augusto Bastos Fernandes	Data: 26/12/2012	Assinatura: 



DEMONSTRATIVO DAS APLICAÇÕES E INVESTIMENTOS DOS RECURSOS

1. ENTE

Nome: Governo do Estado do Rio de Janeiro / RJ
Endereço: Rua Pinheiro Machado S/n
Bairro: Laranjeiras
Telefone: (021) 2334-3773 **Fax:** (021) 2334-3559
CNPJ: 42.498.600/0001-71
Complemento: Rio de Janeiro
CEP: 22231-009
E-mail: telmaoliveira@gabgovernador.rj.gov.br

2. REPRESENTANTE LEGAL DO ENTE

Nome: Sergio de Oliveira Cabral Santos Filho
Cargo: Governador
E-mail: sergiocabral@governador.rj.gov.br
CPF: 744.636.597-87
Complemento do Cargo: Governador
Data Início de Gestão: 01/01/2007

3. REGIME PRÓPRIO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL/MUNICÍPIO/UF

Nome: Rioprevidência - Fundo Único de Previdência Social do Estado do Rio de Janeiro
Endereço: Rua da Quitanda nº 106
Bairro: Centro
Telefone: (021) 2332-5338 **Fax:** (021) 2332-5337
CNPJ: 03.066.219/0001-81
Complemento: Rio de Janeiro - RJ
CEP: 20091-005
E-mail: investimentos@rioprevidencia.rj.gov.br

4. REPRESENTANTE LEGAL DA UNIDADE GESTORA

Nome: Gustavo de Oliveira Barbosa
Cargo: Diretor
Telefone: (021) 2332-5338 **Fax:** (021) 2332-5337
Complemento do Cargo: Diretor Presidente
CPF: 494.126.476-20
Data Início de Gestão: 05/10/2010
E-mail: gustavo.barbosa@rioprevidencia.rj.gov.br

5. GESTOR DE RECURSOS

Nome: Antonio Paulo Vogel de Medeiros
Cargo: Diretor
Telefone: (021) 2332-5356 **Fax:** (021) 2332-5337
Entidade Certificadora: ANBIMA - CPA 20
Complemento do Cargo: Diretor de Investimentos
CPF: 012.085.237-32
Data Início de Gestão: 15/07/2007
E-mail: antonio.medeiros@rioprevidencia.rj.gov.br
Validade Certificação: 01/05/2014

6. RESPONSÁVEL PELO ENVIO

Nome: Carlos Augusto Bastos Fernandes
Telefone: (021) 2332-5210 **Fax:** (021) 2332-5337
CPF: 101.723.007-20
E-mail: carlosfernandes@rioprevidencia.rj.gov.br

7. DEMONSTRATIVO - RECURSOS APLICADOS			
Exercício:	2012	Bimestre:	NOV/DEZ
Gestão:	Entidade Credenciada		
Entidade Credenciada:	Rioprevidência-Fundo Único de Previdência Social do Estado do Rio de Janeiro	CNPJ da Entidade Credenciada:	03.066.219/0001-81
7.1. DEMONSTRATIVO - OPERAÇÕES COM TÍTULOS DO TN NO BIMESTRE			
Não existe Operação com Títulos do TN neste bimestre.			
7.2. DEMONSTRATIVO - CARTEIRA			
Aplicação Nº:	001		
Segmento:	Renda Fixa	Tipo de Ativo:	FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV
Data da Posição Atual:	31/12/2012		
Instituição Financeira:	BANCO ITAÚ S/A		CNPJ da Instituição Financeira: 60.701.190/0001-04
Fundo:	ITAÚ INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI		CNPJ do Fundo: 00.832.435/0001-00
Quantidade de Cotas:	24.368,2659700000	Valor Atual da Cota:	1.624,0870330000
Índice de Referência:	CDI		Valor Total Atual: 39.576.184,78
Patrimônio Líquido do Fundo:	439.557.489,94		
% dos Recursos do RPPS:	0,04 %		% do Patrimônio Líquido do Fundo: 9,00 %
Aplicação Nº:	002		
Segmento:	Renda Fixa	Tipo de Ativo:	FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV
Data da Posição Atual:	31/12/2012		
Instituição Financeira:	BANCO ITAÚ S/A		CNPJ da Instituição Financeira: 60.701.190/0001-04
Fundo:	UNIBANCO INSTITUCIONAL DI FI REF.		CNPJ do Fundo: 00.902.484/0001-64
Quantidade de Cotas:	3.448,2499800000	Valor Atual da Cota:	1.590,8422230000
Índice de Referência:	CDI		Valor Total Atual: 5.485.621,66
Patrimônio Líquido do Fundo:	356.352.449,33		
% dos Recursos do RPPS:	0,01 %		% do Patrimônio Líquido do Fundo: 1,54 %
Aplicação Nº:	003		
Segmento:	Renda Fixa	Tipo de Ativo:	FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV
Data da Posição Atual:	31/12/2012		
Instituição Financeira:	BANCO DO BRASIL S/A		CNPJ da Instituição Financeira: 00.000.000/0001-91
Fundo:	BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA		CNPJ do Fundo: 02.296.928/0001-90
Quantidade de Cotas:	3.434,2468850000	Valor Atual da Cota:	4,6496350760
Índice de Referência:	CDI		Valor Total Atual: 15.967,99
Patrimônio Líquido do Fundo:	1.468.011.406,20		
% dos Recursos do RPPS:	0,00 %		% do Patrimônio Líquido do Fundo: 0,00 %

Aplicação Nº: 004 Segmento: Renda Fixa Data da Posição Atual: 31/12/2012 Instituição Financeira: HSBC BANK - BRASIL Fundo: HSBC REFERENCIADO DI LONGO PRAZO Quantidade de Cotas: 3.389.441,1330000000 Índice de Referência: CDI Patrimônio Líquido do Fundo: 10.287.038.813,35 % dos Recursos do RPPS: 0,06 %	Tipo de Ativo: FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV Valor Atual da Cota: 15,5666010000	CNPJ da Instituição Financeira: 01.701.201/0001-89 CNPJ do Fundo: 00.975.480/0001-06 Valor Total Atual: 52.762.077,73 % do Patrimônio Líquido do Fundo: 0,51 %
Aplicação Nº: 005 Segmento: Renda Fixa Data da Posição Atual: 31/12/2012 Instituição Financeira: BANCO BRADESCO S/A Fundo: BRADESCO FI REF. DI PREMIUM Quantidade de Cotas: 7.520.499,3600000000 Índice de Referência: CDI Patrimônio Líquido do Fundo: 2.654.057.929,71 % dos Recursos do RPPS: 0,05 %	Tipo de Ativo: FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV Valor Atual da Cota: 6,2229050000	CNPJ da Instituição Financeira: 60.746.948/0001-12 CNPJ do Fundo: 03.399.411/0001-90 Valor Total Atual: 46.799.360,59 % do Patrimônio Líquido do Fundo: 1,76 %
Aplicação Nº: 006 Segmento: Renda Fixa Data da Posição Atual: 31/12/2012 Instituição Financeira: BANCO BRADESCO S/A Fundo: BRADESCO FI RF IRF-M1 Quantidade de Cotas: 22.439.491,3700000000 Índice de Referência: IMA Patrimônio Líquido do Fundo: 636.717.182,39 % dos Recursos do RPPS: 0,03 %	Tipo de Ativo: FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b" Valor Atual da Cota: 1,2966629000	CNPJ da Instituição Financeira: 60.746.948/0001-12 CNPJ do Fundo: 11.492.176/0001-24 Valor Total Atual: 29.096.455,95 % do Patrimônio Líquido do Fundo: 4,57 %
Aplicação Nº: 007 Segmento: Renda Fixa Data da Posição Atual: 31/12/2012 Instituição Financeira: CAIXA ECONÔMICA Fundo: CAIXA FI BRASIL DI LP Quantidade de Cotas: 577.486.8868000000 Índice de Referência: CDI Patrimônio Líquido do Fundo: 219.722.916,00 % dos Recursos do RPPS: 0,00 %	Tipo de Ativo: FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV Valor Atual da Cota: 1,9097760000	CNPJ da Instituição Financeira: 00.360.305/0001-04 CNPJ do Fundo: 03.737.206/0001-97 Valor Total Atual: 1.102.870,60 % do Patrimônio Líquido do Fundo: 0,50 %

Aplicação Nº: 008			
Segmento: Renda Fixa	Tipo de Ativo: FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV		
Data da Posição Atual: 31/12/2012			
Instituição Financeira: CAIXA ECONÔMICA		CNPJ da Instituição Financeira: 00.360.305/0001-04	
Fundo: CAIXA FI ALIANÇA RENDA FIXA		CNPJ do Fundo: 05.164.358/0001-73	
Quantidade de Cotas: 14.451.931,5500000000	Valor Atual da Cota: 2,1950090000	Valor Total Atual: 31.722.119,82	
Índice de Referência: CDI			
Patrimônio Líquido do Fundo: 192.745.418,66			
% dos Recursos do RPPS: 0,03 %		% do Patrimônio Líquido do Fundo: 16,46 %	
Aplicação Nº: 009			
Segmento: Renda Fixa	Tipo de Ativo: FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b"		
Data da Posição Atual: 31/12/2012			
Instituição Financeira: CAIXA ECONÔMICA		CNPJ da Instituição Financeira: 00.360.305/0001-04	
Fundo: CAIXA FI BRASIL IRF-M1		CNPJ do Fundo: 10.740.670/0001-06	
Quantidade de Cotas: 29.635.798,2200000000	Valor Atual da Cota: 1,3060690000	Valor Total Atual: 38.706.397,35	
Índice de Referência: IMA			
Patrimônio Líquido do Fundo: 2.395.764.150,75			
% dos Recursos do RPPS: 0,04 %		% do Patrimônio Líquido do Fundo: 1,62 %	
Aplicação Nº: 010			
Segmento: Disponibilidades Financeiras			
Saldo: 10.175.394,57			
Aplicação Nº: 011			
Segmento: Demais bens, direitos e ativos	Tipo: BENS IMÓVEIS		
CNPJ: 03.066.219/0001-81			
Quantidade: 0,01	Valor Total: 228.493.407,95		
Aplicação Nº: 012			
Segmento: Ativos Vinculados Por Lei ao RPPS	Tipo de Ativo: Outros - Art. 3º, V		
Número da Lei de Vinculação: 40155	Data de Vigência da Lei: 17/10/2006		
Discriminação: FUNDES-Fundo de Desenvolvimento Econômico Social (Dec Lei 08 de 15/03/1975 e Dec. 40155 de 17/10/2006)			
Localização: Estado do Rio de Janeiro			
Valor: 1.065.231.421,81			
Aplicação Nº: 013			
Segmento: Ativos Vinculados Por Lei ao RPPS	Tipo de Ativo: Outros - Art. 3º, V		
Número da Lei de Vinculação: 4534	Data de Vigência da Lei: 04/04/2005		
Discriminação: FREMF-Fundo de Recuperação Econômica de Municípios Fluminenses (Lei 4534/05 - Dec 42755/10 e Dec.43358 de 16/12/11)			
Localização: Estado do Rio de Janeiro			
Valor: 213.595.289,55			

Aplicação Nº: 014			
Segmento:	Renda Fixa	Tipo de Ativo:	FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV
Data da Posição Atual:	31/12/2012		
Instituição Financeira:	BANCO SANTANDER (BRASIL) S/A	CNPJ da Instituição Financeira:	90.400.888/0001-42
Fundo:	SANTANDER FIC FI CORPORATE	CNPJ do Fundo:	03.069.104/0001-40
Quantidade de Cotas:	6.322.948,0229960000	Valor Atual da Cota:	6,4030307000
Índice de Referência:	CDI	Valor Total Atual:	40.486.030,31
Patrimônio Líquido do Fundo:	1.834.755.682,28		
% dos Recursos do RPPS:	0,04 %	% do Patrimônio Líquido do Fundo:	2,21 %
Aplicação Nº: 015			
Segmento:	Ativos Vinculados Por Lei ao RPPS	Tipo de Ativo:	Outros - Art. 3º, V
Número da Lei de Vinculação:	3189	Data de Vigência da Lei:	22/02/1999
Discriminação:	Royalties e Participação Especial-Lei 3189/1999, Lei 4237/2003 e Dec. 42011 de 28/08/2009.		
Localização:	Estado do Rio de Janeiro		
Valor:	91.272.533.664,71		
Total de Aplicações no Bimestre:	93.065.606.870,80	Total de Disponibilidades Financeiras no Bimestre:	10.175.394,57
		Total Geral:	93.075.782.265,37