

EXTRATO MENSAL - IPRERIO - RIO NEGRINHO 03/2012



RENTABILIDADES

DESEMPENHO DA CARTEIRA

PRINCIPAIS INDICADORES

INSTITUIÇÃO	MÊS	ANO
IPRERIO	1,46%	5,59%
INPC+6%	0,68%	2,58%

INDICADORES	MÊS	ANO
IBOVESPA	-1,98	13,67%
CDI	0,81	2,45%

CLASSE	ATIVO	VOLAT	MÊS	% ÍNDICE	ANO	VALOR (R\$)	PL DO FUNDO	% NO PL DO FUNDO	% NA CARTEIRA	CONCENTRAÇÃO	LIMITE DA P.I	LIMITE DA RES. 3922/10	NORMA
TÍTULOS PÚBLICOS										0%	15%	100%	Art. 7º, I, "a"
FUNDOS 100% TP (IMA OU IDKA)	BB RPPS LIQ FIC FI	0,15%	0,94%	1,16%	2,85%	R\$ 761.856,43	R\$ 1.619.252.538,16	0,05%	1,57%	48,21%	16%	100%	Art. 7º, I, "b"
	CAIXA FI BR IRF-M 1 TP RF	0,16%	0,94%	1,16%	2,88%	R\$ 2.586.872,56	R\$ 1.285.347.436,87	0,20%	5,33%				
	CAIXA FI BRASIL IMA-B TP	1,02%	1,78%	2,20%	5,82%	R\$ 3.879.416,38	R\$ 7.038.747.568,90	0,06%	7,99%				
	BB RPPS RF IMA B 5+	1,35%	2,34%	2,89%	6,48%	R\$ 4.003.384,07	R\$ 941.045.663,99	0,43%	8,24%				
	BRADESCO FI RF IMA-B TP	1,06%	1,83%	2,26%	5,71%	R\$ 2.182.005,68	R\$ 1.021.403.393,99	0,21%	4,49%				
	BB RPPS RF ATUARIAL CONS FI	0,96%	1,82%	2,25%	5,59%	R\$ 2.778.995,94	R\$ 10.218.570.599,41	0,03%	5,72%				
	CAIXA FI BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	0,70%	1,08%	1,33%	4,42%	R\$ 3.895.621,34	R\$ 1.376.147.027,57	0,28%	8,02%				
	CAIXA FI BRASIL IMA GERAL TP	0,62%	1,37%	1,69%	4,14%	R\$ 1.673.644,13	R\$ 963.766.611,09	0,17%	3,45%				
RENTA FIXA (IMA OU IDKA)	ITAU INST RF INFLAÇÃO FICFI	1,03%	1,88%	2,32%	5,73%	R\$ 1.646.078,21	R\$ 1.065.186.847,70	0,15%	3,39%	30,02%	45,34%	80%	Art. 7º, III
	BANRISUL PREV MUNI III FI RF LP	0,97%	1,89%	2,33%	5,62%	R\$ 5.281.808,28	R\$ 472.521.414,37	1,12%	10,88%				
	BRADESCO FI RF IMA GERAL	0,59%	1,31%	1,62%	4,03%	R\$ 3.255.673,43	R\$ 973.978.374,92	0,33%	6,70%				
	FIC NOVO BRASIL IMA-B RF LP	0,95%	1,88%	2,32%	5,93%	R\$ 3.755.722,76	R\$ 3.635.791.733,76	0,10%	7,73%				
	FI RENDA FIXA ELO	0,48%	1,34%	1,65%	4,43%	R\$ 1.278.219,91	R\$ 257.326.591,10	0,50%	2,63%				
RENTA FIXA E REFERENCIADO NÃO CRÉDITO PRIVADO	LMX IMA-B FI RF	0,97%	1,24%	1,53%	4,29%	R\$ 1.003.495,99	R\$ 20.922.814,50	4,80%	2,07%	0%	3,60%	30%	Art. 7º, IV
FIDC ABERTO	QT IPCA JUROS REAL	0,03%	1,05%	1,30%	3,22%	R\$ 673.280,65	R\$ 54.719.136,35	1,23%	1,39%	1,39%	1%	15%	Art. 7º, VI
FIDC FECHADO	FIDC MULT BVA ITALIA	0,01%	1,11%	1,37%	1,43%	R\$ 191.478,76	R\$ 36.180.913,65	0,53%	0,39%	2,07%	1,50%	5%	Art. 7º, VII, "a"
	FIDC MULT BVA MASTER III SENI	20,24%	1,11%	1,37%	3,33%	R\$ 813.051,84	R\$ 173.199.814,70	0,47%	1,67%				
RENTA FIXA E REF. CRÉDITO PRIVADO	FI CAIXA BR IPCA XV RF CRED. PRIV.	0,67%	1,68%	2,07%	4,04%	R\$ 678.995,40	R\$ 59.135.492,94	1,15%	1,40%	3,85%	4,05%	5%	Art. 7º, VII, "b"
	FI CAIXA BR IPCA XI RF CRD. PRIV	0,65%	1,61%	1,99%	3,94%	R\$ 1.189.821,00	R\$ 69.843.682,52	1,70%	2,45%				
MULTIMERCADO										0%	0%	5%	Art. 8º, IV
FIP	ATICO GERAÇÃO DE ENERGIA FIP	0,12%	-0,13%	0,07%	-0,12%	R\$ 994.883,32	R\$ 135.251.772,61	0,74%	2,05%	4,45%	5%	5%	Art. 8º, V
	NSG VAR. ALIM. INFRA. FIP	0,17%	1,29%	-0,65%	4,10%	R\$ 1.168.274,00	R\$ 221.126.819,70	0,53%	2,41%				
FUNDO DE AÇÃO INDEXADO IBOV.IBX OU IBX-50	CAIXA FI BRASIL IBX-50	5,72%	-1,55%	0,78%	9,09%	R\$ 665.269,76	R\$ 154.867.619,34	0,43%	1,37%	2,45%	2,51%	30%	Art. 8º, I
	ITAU RPI AÇÕES IBOV FICFI	4,74%	-0,44%	0,22%	12,56%	R\$ 525.878,23	R\$ 573.223.980,94	0,09%	1,08%				
FUNDO DE AÇÃO	LMX DIVIDENDOS FIA	3,23%	2,69%	-1,36%	10,87%	R\$ 519.379,11	R\$ 3.279.330,35	15,84%	1,07%	7,57%	6%	15%	Art. 8º, III
	HUMAITA ABSOLUTE FIA	4,21%	5,52%	-2,79%	25,33%	R\$ 535.010,10	R\$ 4.692.584,94	11,40%	1,10%				
	BB RPPS AÇÕES	4,69%	-0,26%	0,13%	13,76%	R\$ 2.619.539,16	R\$ 266.041.884,41	0,98%	5,39%				

ATIVOS EM ENQUADRAMENTO

R\$ 48.557.656,44 100% 100%

- Limites de recursos do RPPS no mesmo ativo 20% - Art. 13, Res. 3922/10
- Limite de participação na carteira do fundo 25% - Art.14, Res. 3922/10
- Desenquadramento perante a P.I adotada pelo RPPS
- Desenquadramento perante a Res. 3922/10
- Desenquadramento Conceitual