

RELATÓRIO DO DEMOSTRATIVO DE INVESTIMENTOS - COSIPREV

Segmento	Dezembro/2013		Dezembro/2012	
	Valor	Percentual	Valor	Percentual
Renda Fixa	525.298.713,27	95,01%	492.353.375,99	94,85%
Renda Variável	8.311.241,31	1,50%	8.996.029,76	1,73%
Investimentos Estruturados	1.674.193,12	0,30%	1.852.228,20	0,36%
Operações Com Participantes - Empréstimos	17.693.555,66	3,20%	15.966.789,28	3,07%
Outras Exigibilidades	(63.263,02)	(0,01%)	(66.378,68)	(0,01%)
Total de Investimentos	552.914.440,34	100,00%	519.102.044,55	100,00%

Composição do Segmento de Renda Fixa

Títulos Públicos

Descrição	Valor	% sobre o Segmento
NTN-B - IPCA	161.401.627,21	30,73%
Total	161.401.627,21	30,73%

Créditos Privados e Depósitos

Descrição	Valor	% sobre o Segmento
Conta Corrente	1.998.386,05	0,38%
Letras Financeiras - Di	79.412.012,88	15,12%
Letras Financeiras - Ipca	36.987.208,73	7,04%
CRI - IPCA	969.216,90	0,18%
CDB - DI	115.195.473,05	21,93%

Debêntures Não Conversíveis De Empresas - DI	6.811.543,82	1,30%
Debêntures Não Conversíveis De Empresas - IPCA	29.494.558,26	5,61%
DPGE - DI	1.669.670,51	0,32%
DPGE - IPCA	3.518.463,40	0,67%
Total	276.056.533,60	52,55%

Fundos de Investimento

Descrição	Valor	% sobre o Segmento
BTG EMISS II	2.361.976,30	0,45%
BTG EMISS RF CP	5.547.316,96	1,06%
FICFIDC PACT II	710.439,77	0,13%
FIDC BICBANCO C	562.431,08	0,11%
FIDC CEDAE	2.260.848,87	0,43%
FIDC CEEEIV-D	643.115,88	0,12%
FIDC CESP IV	1.572.196,28	0,30%
FIDC ECO MULTI	144.240,61	0,03%
TRIUMPH	74.037.986,71	14,09%
Total	87.840.552,46	16,72%

Valores a Pagar e Receber

Descrição	Valor	% sobre o Segmento
Valor a Receber	0,00	0,00%
Valor a Pagar	0,00	0,00%
Total	0,00	0,00%

Total do Segmento de Renda Fixa	525.298.713,27	100,00%
--	-----------------------	----------------

Composição do Segmento de Renda Variável

Ações

Descrição	Valor	% sobre o Segmento
FIA MSQUARE	249.877,30	3,00%
FIA SINERGIA IV	3.596.697,59	43,28%
FIA SULAMER GOV	4.464.666,42	53,72%
Total	8.311.241,31	100,00%

Valores a Pagar e Receber		
Descrição	Valor	% sobre o Segmento
Valor a Receber	0,00	0,00%
Valor a Pagar	0,00	0,00%
Total	0,00	0,00%
Total do Segmento de Renda Variável	8.311.241,31	100,00%

Composição do Segmento de Investimentos Estruturados

Descrição	Valor	% sobre o Segmento
FIC FIP PATRIA	653.114,77	39,01%
FIP NEO	129.458,70	7,73%
FIP OLEO E GAS	538.687,91	32,18%
FIP RIO BRAVO	200.970,25	12,00%
INV.INS.III FIP	151.961,49	9,08%
Total	1.674.193,12	100,00%

Valores a Pagar e Receber

Descrição	Valor	% sobre o Segmento
Valor a Receber	0,00	0,00%
Valor a Pagar	0,00	0,00%
Total	0,00	0,00%
Total do Segmento de Investimentos Estruturados	1.674.193,12	100,00%

Composição do Segmento de Operações com Patilpantes - Empréstimos

Empréstimos

Indexador	Valor	% sobre o Segmento
Pós Fixado	3.200.478,54	18,09%
Pre Fixado	14.498.222,68	81,94%
Total	17.698.701,22	100,03%

Valores a Pagar e Receber

Descrição	Valor	% sobre o Segmento
Valor a Receber	0,00	0,00%
Valor a Pagar	(5.145,56)	(0,03%)
Total	(5.145,56)	(0,03%)
Total do Segmento de Operações com Participantes - Empréstimos	17.693.555,66	100,00%

Desenquadramento e/ou inobservância à Resolução CMN n.º 3.792

Itens	Discriminação	% Aplicado	Justificativas
Não se aplica			

Distribuição dos Investimentos da Entidade (PB1, USIPREV, PBD, COSIPREV e PGA) por Segmento

Segmento	Dezembro/2013		Dezembro/2012	
	Valor	Percentual	Valor	Percentual
Renda Fixa	5.662.440.046,18	85,59%	5.397.530.915,63	84,38%
Renda Variável	560.993.841,76	8,48%	610.326.778,61	9,54%
Investimentos Estruturados	26.474.626,19	0,40%	19.107.424,21	0,30%
Imóveis	287.183.971,59	4,34%	289.598.967,80	4,53%
Operações com Participantes - Empréstimos	72.225.630,56	1,09%	73.609.229,80	1,15%
Depósitos Judiciais/Recurais	16.178.914,84	0,24%	16.634.138,52	0,26%
Outros Realizáveis	7.107.041,17	0,11%	7.107.041,17	0,11%
Outras Exigibilidades	(517.831,95)	(0,01%)	(353.648,64)	(0,01%)
Exigível Contingencial - Investimentos	(16.178.914,84)	(0,24%)	(16.634.147,79)	(0,26%)
Total de Investimentos	6.615.907.325,50	100,00%	6.396.926.699,31	100,00%