

1. Introdução

A Resolução CMN nº 4.176, de 2 de janeiro de 2013, alterou a Resolução CMN nº 3.308/05, exigindo que os fundos previdenciários atendam a requisitos mínimos de prazos médios remanescente (PMR) e de repactuação (PRC), conforme definidos no próprio normativo.

Para possibilitar a supervisão do cumprimento das novas diretrizes do Conselho Monetário Nacional, os supervisionados deverão fornecer à SUSEP uma série de informações sobre as carteiras de tais fundos, sendo necessária, assim, uma atualização dos quadros do FIP referente a ativos.

Após analisar as mudanças que deveriam ser implantadas, a DIMAT optou por abandonar os quadros existentes e substituí-los por outros no formato dos quadros estatísticos utilizados no acompanhamento das provisões.

Desta forma, o presente documento visa a definir o formato deste novo quadro, que substituirá os quadros 17T, 18T, 19, 19A, 20T, 46B, 47B, 48B, 49C, 49D, 75C, 75D, 76, 77 e 83 do FIP e incluirá as informações relativas aos prazos médios definidos pela Resolução CMN 4.176/13.

Vale ressaltar que, para os Resseguradores Admitidos, será exigido o preenchimento deste quadro do FIP informando os recursos detidos para garantia de suas obrigações, assim como os demais títulos e valores mobiliários que detêm.

2. Formato do Arquivo

Campo	Formato	Posição Inicial	Tamanho	Posição Final	Observação
Tipo Registro	00	1	2	2	
Data	aaaammdd	3	8	10	
CNPJ_1	00000000000000	11	14	24	CNPJ, com 14 dígitos, sem os caracteres especiais (';', '/', '-')
Tipo Ativo	0000	25	4	28	

CGSOA/COARI/DIMAT – Especificação de Novo Quadro do FIP – agosto/2013

Código Câmara	xxxxxxxxxxxxxx	29	15	43	Caso o código tenha tamanho inferior a 15 caracteres, inseri-lo a partir da posição 29 e completar, ao final, os caracteres restantes com espaços em branco.
Código Isin	xxxxxxxxxxxxx	44	12	55	Preencher com zeros quando não aplicável
Local do Registro	0	56	1	56	Preencher com zeros os caracteres não utilizados
Endereço Imóvel / Descrição	x(40)	57	40	96	Caso o código tenha tamanho inferior a 40 caracteres, inseri-lo a partir da posição 57 e completar, ao final, os caracteres restantes com espaços em branco.
UF Imóvel	xx	97	2	98	Preencher com zeros os caracteres não utilizados
Cidade Imóvel	x(20)	99	20	118	Caso o código tenha tamanho inferior a 20 caracteres, inseri-lo a partir da posição 99 e completar, ao final, os caracteres restantes com espaços em branco.
Emissor	00000000000000	119	14	132	CNPJ, com 14 dígitos, sem os caracteres especiais (';', '/', '-')
CNPJ_2	00000000000000	133	14	146	CNPJ, com 14 dígitos, sem os caracteres especiais (';', '/', '-')
Gestor fundo	00000000000000	147	14	160	CNPJ, com 14 dígitos, sem os caracteres especiais (';', '/', '-')
Vencimento	aaaammdd	161	8	168	Preencher com zeros quando não aplicável
Tipo de Marcação	0	169	1	169	
Valor Contábil Unitário	000000000000,0000000000	170	24	193	Preencher com zeros os caracteres não utilizados
Valor Mercado Unitário	000000000000,0000000000	194	24	217	Preencher com zeros os caracteres não utilizados
Exposição Fator Risco	000000000000,0000000000	218	24	241	Preencher com zeros os caracteres não utilizados
Quantidade	000000000000,0000000000	242	24	265	Preencher com zeros os caracteres não utilizados
Posição	x	266	1	266	Valores Possíveis: "C" ou "V"
Indexador_1 (benchmark)	00	267	2	268	Preencher com zeros quando não aplicável
Requerimento de Margem	00	269	24	292	Preencher com zeros os caracteres não utilizados
Patrimônio	000000000000,0000000000	293	24	316	Preencher com zeros os caracteres não utilizados
Prazo Médio	00000,00	317	8	324	Preencher com zeros os caracteres não utilizados

CGSOA/COARI/DIMAT – Especificação de Novo Quadro do FIP – agosto/2013

Remanescente					
Prazo Médio de Repactuação	00000,00	325	8	332	Preencher com zeros os caracteres não utilizados
VaR (1 dia/ 99%)	0000000000000,0000000000	333	24	356	Preencher com zeros os caracteres não utilizados
Vínculo à Susep	x	357	1	357	Valores Possíveis: “V” ou “L”

x – caractere alfanumérico

0 – caractere numérico

3. Descrição dos Campos

3.1 Tipo Registro

Este campo contém a informação sobre a carteira a qual pertence o ativo objeto do registro. Deve ser preenchido conforme a tabela abaixo:

Código	Tipo Registro	Observações
00	Carteira Própria	Carteira própria (livre ou vinculada) do supervisionado
01	FIE prev 1	Carteira de FIE para recepção de recursos de planos PGBL/VGBL na fase de acumulação
02	FIQE prev 1	Carteira de FIQE para recepção de recursos de planos PGBL/VGBL na fase de acumulação
03	FIE prev 2	Carteira de FIE para recepção de recursos de planos previdenciários que prevejam reversão de excedente financeiro
04	FIQE prev 2	Carteira de FIQE para recepção de recursos de planos previdenciários que prevejam reversão de excedente financeiro
05	FIE prev outros	Carteira de demais FIEs previdenciários
06	FIQE prev outros	Carteira de demais FIQEs previdenciários
07	FIE RT	Carteira de FIE Reservas Técnicas
08	FIQE RT	Carteira de FIQE Reservas Técnicas
09	FIFE	Carteira de FIFE

CGSOA/COARI/DIMAT – Especificação de Novo Quadro do FIP – agosto/2013

10 | Fundos 409 – outros | Carteira de Fundos Abertos

Os FIEs, que não são previdenciários, devem se valer do código '07 – FIE RT'. Atualmente, na Resolução CMN nº 3.308/05, seriam apenas os descritos como “títulos públicos” (alínea 'e', inciso I, do artigo 4º do Anexo I à Resolução CMN nº 3.308/05).

3.2 Data

Este campo deve ser preenchido com a data a que se refere o registro.

Deverão ser informadas as posições em todos os dias úteis do mês de referência do FIP quando:

- o campo Tipo Ativo = '1000' (Carteira 4176); ou
- o campo Tipo Registro = '00' e Tipo Ativo = '01', '03', '09'; ou
- entidade for resseguradora admitida e o campo Tipo Ativo = 'FFFF' (Conta Moeda Estrangeira).

Deverá ser informada a posição apenas do último dia útil do mês de referência nos demais casos.

3.3 CNPJ_1

Este campo deverá ser preenchido conforme a tabela abaixo, em função do valor indicado no campo Tipo Registro.

Campo “Tipo Registro”	Valor a ser preenchido no campo CNPJ_1
00	CNPJ do supervisionado
01	CNPJ do FIE
02	CNPJ do FIQE
03	CNPJ do FIE
04	CNPJ do FIQE
05	CNPJ do FIE
06	CNPJ do FIQE

CGSOA/COARI/DIMAT – Especificação de Novo Quadro do FIP – agosto/2013

07	CNPJ do FIE
08	CNPJ do FIQE
09	CNPJ do FIFE
10	CNPJ do Fundo 409

3.4 Tipo Ativo

Este campo deverá ser preenchido conforme a tabela abaixo.

Para o derivativo “Swap”, deverá ser feito dois lançamentos sendo um para a ponta ativa e outra para a ponta passiva.

Tipo Ativo	Descrição	Observações
1040	Letras do Tesouro Nacional	
1074	Letras Financeiras do Tesouro	
1091	Letras Hipotecárias	
1104	Bônus do Tesouro Nacional	
1139	NTN – Notas do Tesouro Nacional	
1155	Crédito Securitizado	
1189	Fundo de Invest. Curto Prazo – Títulos	
1190	Fundo de Invest. Refer. – Títulos	
1191	Fundo de Invest. Cambial – Títulos	
1192	Fundo de Invest. De Renda Fixa – Títulos	
2054	Bônus de Subscrição de Ações	
2063	Certificados de Dep de Ações do Mercosul	
2090	Fundo de Invest em Empresas Emergentes	

CGSOA/COARI/DIMAT – Especificação de Novo Quadro do FIP – agosto/2013

2104	AÇÕES SUSEP	
3018	Imóveis (Líquido de Depreciação)	
3027	Direitos Resultantes da Venda de Imóveis	Descrição
3034	Terrenos	
3035	Direitos Resultantes da Venda de Terreno	Descrição
3042	Fundos de Invest. Imobiliários	
4014	Recibo de Depósito Bancário	
4111	Certificado de Depósito Bancário	
4112	Letras de crédito do agronegócio	
4113	cert. De dir. cred. Do agronegócio	
4114	cert. De receb. Do agronegócio	
4120	Debêntures de Distribuição Pública	
4138	Letras de Câmbio	
4146	Cédulas de Debêntures	
4154	Cédulas Hipotecárias	
4162	Letras e Cédulas de Crédito Imobiliário	
4227	Títulos da Dívida Agrária	
4308	Dir Cred Frac Prêmios Seguros	
4406	Fundo de Invest. De Curto Prazo	
4407	Fundo de Invest. Referenciado – RF	
4408	Fundo de Invest. Cambial	
4409	Fundo de Invest. Multimercado	
4410	Fundo de Invest. De Renda Fixa	
4422	FIC de Fundo de Invest. De Curto Prazo	
4423	FIC de Fundo de Invest. Referenc. – RF	
4424	FIC de Fundo de Invest. Cambial	

CGSOA/COARI/DIMAT – Especificação de Novo Quadro do FIP – agosto/2013

4425	FIC de Fundo de Invest. Multimercado	
4426	FIC de Fundo de Invest. De Renda Fixa	
4457	Fundo de Invest. De Dívida Externa	
4458	FIC de Fundo de Invest. Dívida Externa	
4502	N. Promissórias de S/A p/ Oferta Pública	
4545	Depósitos de Poupança	Descrição – Banco e conta
4596	Empréstimos Assistenciais	
4600	Outras Aplicações	Descrição
4618	Certificado de Recebíveis Imobiliários	
4708	Cédulas de Crédito Bancário	
4719	Certificados de Cédulas de Crédito Banc.	
4720	Cédulas de Produto Rural	
4731	Contr. Mercantis de C/V de Produtos	
4741	Fundos de Invest Dir Creditórios	
4752	FIC de Fundos de Inv. Dir Credit.	
5005	Ações do Novo Mercado	
5016	Bônus,Recibos,Cert Dep Ações Novo Mercad	
5028	Fundo de Invest. De Ações do Novo Merc.	
5029	FIC de Fundo de Invest. Ações Novo Merc	
5049	Ações de Nível 2 da BOVESPA	
5050	Bônus,Rec,Cert Dep Ações Nível 2 BOVESPA	
5062	Fundo de Invest. Ações Nível 2 BOVESPA	
5063	FIC Fundo Invest. Ações Nível 2 BOVESPA	
5082	Ações de Cia Abertas	
5093	Bônus,Recibos,Cert Dep Ações	
5105	Fundo de Invest. De Ações	

CGSOA/COARI/DIMAT – Especificação de Novo Quadro do FIP – agosto/2013

5106	FIC de Fundo de Invest. De Ações	
5126	Ações do Merc.Balcão Organizado	
5137	Ações e Debêntures de Soc Prop Específic	
5171	Debentures com Participação no Lucro	
5182	Ações de Nível 1 da BOVESPA	
5193	Bônus,Rec,Cert Dep Ações Nível 1 BOVESPA	
5205	Fundo de Invest. Ações Nível 1 BOVESPA	
5206	FIC Fundo Invest. Ações Nível 1 BOVESPA	
5300	Fundo de Invest. Referenciado – RV	
5301	FIC Fundo de Invest. Referenciado – RV	
5302	Fundo de Invest. Em Participações	
5303	Fundo Financ.Indust.Cinematográf. Nac.	
5304	Fundo Índice Cot. Neg B.Valores/M.Balcão	
5309	Fundo de Invest. Cultural e Artístico	
5310	FIC Fundo de Invest. Em Participações	
5322	Título de Capitalização	
5324	Participações Societárias no País	Descrição – Razão Social
5325	Conta corrente	Descrição – Consolidado por Instituição Financeira
5327	Operação compromissada	
5332	Dép. A Prazo Fixo/Moeda Estrang. No País	
5334	Dinheiro em Caixa	
5335	Participações Societárias no Exterior	Descrição – Razão Social e País
5336	Letra Financeira	
5337	Depósito a Prazo com Garantia Especial	
5338	Fundo Soberano – DPVAT	
5339	Títulos de RF de Inst. Fin.no Exterior	Descrição

CGSOA/COARI/DIMAT – Especificação de Novo Quadro do FIP – agosto/2013

5340	Títulos de RF de Inst. Não Fin. No Ext	Descrição
5341	Bônus Gov Estr em sua Moeda	Descrição
5342	Bônus Gov Estr outra Moeda	Descrição
6001	Ações SUSEP 1	
AAAA	Futuro	A ser criado
BBBB	Swap	A ser criado
CCCC	Opções padronizadas – Call	A ser criado
	Opções não padronizadas – Call	A ser criado
	Opções padronizadas – Put	A ser criado
	Opções não padronizadas – Put	A ser criado
	Termo	A ser criado
	Valores a pagar Fundo	A ser criado
	Valores a receber Fundo	A ser criado
	Caixa Fundo	A ser criado
	Resultado de Op Compromissada fundo	A ser criado
	Resultado de swap fundo	A ser criado
1000	Carteira 4176 = '1000'	A ser criado
EEEE	FIE prev 1	A ser criado
HHHH	FIQE prev 1	A ser criado
	FIE prev 2	A ser criado
	FIQE prev 2	A ser criado
	FIE RT	A ser criado
	FIQE RT	A ser criado
GGGG	FIFE	A ser criado
	Ouro – ativo financeiro	A ser criado
	Outros valores fundo	Descrição – A ser criado

CGSOA/COARI/DIMAT – Especificação de Novo Quadro do FIP – agosto/2013

	ADR	A ser criado
	BDR	A ser criado
FFFF	Conta Moeda Estrangeira	A ser criado
	Empréstimo de Títulos e Valores Mobiliários	Descrição - A ser criado

A descrição dos ativos aqui listados seguem as especificações do Regulamento anexo à Resolução CMN nº3308/05. Abaixo, segue a identificação no Regulamento anexo à Resolução CMN nº3308/05 dos ativos com descrição imprecisa:

- Ações do Novo Mercado: ações de companhias abertas negociadas em bolsa de valores ou mercado de balcão organizado e pertencentes ao segmento do Novo Mercado da Bovespa.

Limites: individual = 10% e grupo = 49%;

Normativo: inciso I, art. 10, do Regulamento anexo à Resolução CMN nº3308/05 c/c alínea “a”, inciso III, do parágrafo 3º, do art. 10 do mesmo regulamento.

- Ações de Nível 2 da BOVESPA: ações de companhias abertas negociadas em bolsa de valores ou mercado de balcão organizado e pertencentes ao segmento do Nível 2 da Bovespa.

Limites: individual = 10% e grupo = 40%;

Normativo: inciso II, art. 10, do Regulamento anexo à Resolução CMN nº3308/05 c/c alínea “a”, inciso III, do parágrafo 3º, do art. 10 do mesmo regulamento.

- Ações de Nível 1 da BOVESPA: ações de companhias abertas negociadas em bolsa de valores ou mercado de balcão organizado, pertencentes ao segmento do Nível 1 da Bovespa e que não representam 3% ou mais do Ibovespa, do IBX ou do IBX 50..

Limites: individual = 5% e grupo = 35%;

Normativo: inciso III, art. 10, do Regulamento anexo à Resolução CMN nº3308/05 c/c alínea “b”, inciso III, do parágrafo 3º, do art. 10 do mesmo regulamento.

CGSOA/COARI/DIMAT – Especificação de Novo Quadro do FIP – agosto/2013

- AÇÕES SUSEP 1: ações de companhias abertas negociadas em bolsa de valores ou mercado de balcão organizado, pertencentes ao segmento do Nível 1 da Bovespa e que representam 3% ou mais do Ibovespa, do IBX ou do IBX 50..

Limites: individual = 10% e grupo = 35%;

Normativo: inciso III, art. 10, do Regulamento anexo à Resolução CMN nº3308/05 c/c alínea “b”, inciso III, do parágrafo 3º, do art. 10 do mesmo regulamento.

- Ações de Cia Abertas: ações de companhias abertas negociadas em bolsa de valores e que não representam 3% ou mais do Ibovespa, do IBX ou do IBX 50.

Limites: individual = 5% e grupo = 30%;

Normativo: inciso IV, art. 10, do Regulamento anexo à Resolução CMN nº3308/05 c/c alínea “b”, inciso III, do parágrafo 3º, do art. 10 do mesmo regulamento.

- AÇÕES SUSEP: ações de companhias abertas negociadas em bolsa de valores e que representam 3% ou mais do Ibovespa, do IBX ou do IBX 50.

Limites: individual = 10% e grupo = 30%;

Normativo: Inciso IV, art. 10, do Regulamento anexo à Resolução CMN nº3308/05 c/c alínea “b”, inciso III, do parágrafo 3º, do art. 10 do mesmo regulamento.

3.5 Código Câmara

Este campo deverá ser preenchido com o código dado ao ativo pela câmara de registro e custódia – p. ex. Selic, Cetip e BM&Fbovespa .

No caso de imóveis, com a matrícula no RGI.

No caso de Operações compromissadas e de Empréstimo de Títulos e Valores Mobiliários, indicar o código do ativo utilizado como lastro, conforme estabelecido pela câmara de custódia. Deixando claro que as operações de empréstimos (aluguéis) de títulos e valores mobiliários serão regulamentadas em Resolução do CNSP, não estando aqui qualquer autorização prévia para tais operações.

No caso de direitos resultantes de venda de imóveis ou terrenos, deverá ser informada a matrícula do mesmo no RGI.

CGSOA/COARI/DIMAT – Especificação de Novo Quadro do FIP – agosto/2013

3.6 Código Isin

Este campo deverá ser preenchido com o código Isin – *International Securities Identification Number* – do ativo.

No caso de Operações compromissadas e de Empréstimo de Títulos e Valores Mobiliários, indicar o código isin do lastro.

No caso de imóveis, depósitos à vista ou poupança, preencher com zeros.

3.7 Local do Registro

Este campo deverá ser preenchido conforme a tabela abaixo.

Código a ser preenchido no campo “Local do Registro”	Local do Registro
1	SELIC
2	CETIP
3	BM&Fbovespa
4	RGI
5	No País – outros
6	No exterior
7	Não registrado

3.8 Endereço Imóvel / Descrição

Este campo deverá ser preenchido com o endereço do imóvel ou terreno.

CGSOA/COARI/DIMAT – Especificação de Novo Quadro do FIP – agosto/2013

Caso o ativo não seja imóvel ou terreno, este campo deverá ser preenchido conforme a tabela abaixo.

Valor do Campo "Tipo Ativo"	Descrição do Campo "Tipo Ativo"	Informação a ser preenchida no campo "Endereço Imóvel"
3027	Direitos Resultantes da Venda de Imóveis	Endereço do imóvel original
3035	Direitos Resultantes da Venda de Terreno	Endereço do terreno original
4600	Outras Aplicações	Descrição da Aplicação
5339	Títulos de RF de Inst. Fin.no Exterior	Descrição do Título e Emissor
5340	Títulos de RF de Inst. Não Fin. No Ext	Descrição do Título e Emissor
5341	Bônus Gov Estr em sua Moeda	Descrição do Título e Emissor
5342	Bônus Gov Estr outra Moeda	Descrição do Título e Emissor
5325	Conta corrente	Nome da Instituição Financeira
FFFF	Conta Moeda Estrangeira	Nome da Instituição Financeira
4545	Depósitos de Poupança	Nome da Instituição Financeira
	Outros Valores – Fundo	Descrição dos Valores
Demais	Diversos	Preencher com zeros

Nos casos de conta-corrente, conta em moeda estrangeira e depósitos de poupança, informar apenas o valor consolidado por Instituição Financeira.

3.9 UF Imóvel

Este campo deverá ser preenchido com a UF onde o imóvel/terreno se situa. Para os demais ativos, deverá ser preenchido com zeros.

Deve ser preenchido inclusive nos casos de direitos resultantes de venda de imóveis ou terrenos.

3.10 Cidade Imóvel

CGSOA/COARI/DIMAT – Especificação de Novo Quadro do FIP – agosto/2013

Este campo deverá ser preenchido com a cidade onde o imóvel/terreno se situa. Para os demais ativos, deverá ser preenchido com zeros.

Deve ser preenchido inclusive nos casos de direitos resultantes de venda de imóveis ou terrenos.

3.11 Emissor

Este campo deverá ser preenchido com o CNPJ do Emissor do Ativo, ou conforme a tabela abaixo, de acordo com a informação indicada no campo “Tipo Ativo”.

Ativo	Informação a ser preenchida no campo “Emissor”
Cota de Fundo de Investimento	CNPJ do Administrador
Depósitos à Vista no País	CNPJ da Instituição Depositária
Depósitos de Poupança	CNPJ da Instituição Depositária
Depósitos em Moeda Estrangeira	CNPJ da Instituição Depositária
Certificados de Recebíveis	CNPJ da Cia Securitizadora
Imóveis/Terrenos	CNPJ do Cartório onde o imóvel está registrado

3.12 CNPJ_2

Este campo deverá ser preenchido conforme a tabela abaixo, de acordo com a informação indicada no campo “Tipo Ativo”.

Ativo	Informação a ser preenchida no campo “CNPJ_2”
Cota de Fundo de Investimento	CNPJ do Fundo formado por estas cotas
Certificados de Recebíveis	CNPJ do Patrimônio Separado
Participações Societárias no País	CNPJ da sociedade em que participa
Demais Ativos	Preencher com zeros

CGSOA/COARI/DIMAT – Especificação de Novo Quadro do FIP – agosto/2013

3.13 Gestor Fundo

Este campo deverá ser preenchido conforme a tabela abaixo, de acordo com a informação indicada no campo “Tipo Ativo”.

Ativo	Informação a ser preenchida no campo “Gestor Fundo”
Cota de Fundo de Investimento	CNPJ do Gestor do Fundo formado por estas cotas
Demais Ativos	Preencher com zeros

3.14 Vencimento

Este campo deverá ser preenchido com a data de vencimento do ativo, quando aplicável. Caso contrário, preencher com zeros.

3.15 Tipo de Marcação

Este campo deverá ser preenchido com o tipo de marcação contábil do ativo na contabilidade da entidade ou, quando for o caso, do fundo, conforme a tabela abaixo:

Ativo	Informação a ser preenchida no campo “Tipo de Marcação”
Mantido até o Vencimento	1
Disponível para Negociação	2
Disponível para Venda	3
Custo Histórico	4
Equivalência Patrimonial	5

CGSOA/COARI/DIMAT – Especificação de Novo Quadro do FIP – agosto/2013

Outros	6
--------	---

3.16 Valor Contábil Unitário

Este campo deve ser preenchido com o Valor Contábil Unitário dos títulos, valores mobiliários e dos derivativos.

No caso de contratos futuros, deverá ser informado o valor acumulado dos ajustes diários, conforme registrado na contabilidade, dividido pelo número de contratos.

Para o contrato de *Swap*, deverá ser feito dois lançamentos sendo um para a ponta ativa e outra para a ponta passiva. Em cada uma das pontas, deverá ser informado o valor justo do contrato, conforme registrado na contabilidade, dividido pelo número de contratos.

No contrato a termo (*forward*), deverá ser informado o valor justo do contrato, conforme registrado na contabilidade, dividido pelo número de contratos.

E para os contratos com opções, informar o prêmio da opção na data de referência, conforme registrado na contabilidade.

Os valores deverão ser informados em reais e sendo negativo, deverá vir precedido do sinal “-”, como no exemplo “-450,01”.

3.17 Valor Mercado Unitário

Este campo deve ser preenchido com o Valor de Mercado Unitário dos títulos, valores mobiliários e dos derivativos – marcação a mercado. Mesmo que o ativo esteja contabilmente classificado como mantido até o vencimento, seu valor de mercado deverá ser informado.

A marcação a mercado deverá ser realizada utilizando-se das melhores práticas utilizadas pelo mercado, recomendadas por organismos reguladores e/ou autorreguladores.

No caso de contratos futuros, deverá ser informado o valor acumulado dos ajustes diários, dividido pelo número de contratos.

CGSOA/COARI/DIMAT – Especificação de Novo Quadro do FIP – agosto/2013

Para o contrato de *Swap*, deverá ser feito dois lançamentos sendo um para a ponta ativa e outra para a ponta passiva. Em cada uma das pontas, deverá ser informado o valor de mercado do contrato.

Para o contrato a termo (*forward*), deverá ser informado o valor de mercado do contrato.

Nos contratos com opções, informar o prêmio de mercado da opção na data de referência.

Fundos exclusivos contendo ativos marcados como mantidos até o vencimento deverão indicar o valor da cota, considerando os ativos integrantes de sua carteira marcados a mercado.

Os valores deverão ser informados em reais e sendo negativo, deverá vir precedido do sinal “-”, como no exemplo “-450,01”.

3.18 Exposição Fator Risco

Este campo deve ser preenchido com a exposição unitária ao fator de risco, a mercado, apenas dos derivativos, utilizando-se das melhores práticas utilizadas pelo mercado, recomendadas por organismos reguladores e/ou autorreguladores.

Informar, no caso de:

- contratos futuros o PU de ajuste;
- contratos a termo a exposição ao fator de risco do contrato;
- contratos de opção o produto do preço do ativo subjacente ponderado pelo delta.

Para os contratos swaps, informar separadamente (como sendo duas posições) as pontas ativa e passiva.

Os valores deverão ser informados em reais e sendo negativo, deverá vir precedido do sinal “-”, como no exemplo “-450,01”.

3.19 Quantidade

Este campo deve ser preenchido com a quantidade detida do ativo.

CGSOA/COARI/DIMAT – Especificação de Novo Quadro do FIP – agosto/2013

3.20 Posição

Este campo deverá ser preenchido, no caso de contratos derivativos, compromissadas e empréstimo de títulos e valores imobiliários com:

‘c’ – no caso de posição comprada (ponta ativa)

‘v’ – no caso de posição vendida (ponta passiva)

O sinal ‘c’ é o padrão.

Além disso, entende-se que comprado (c) em um futuro de DI1 significa comprado em PU.

3.21 Indexador_1 (benchmark)

Quando aplicável, o preenchimento deste campo deverá ser realizado de acordo com a seguinte tabela:

Código	Indexador
01	PRÉ
02	CDI
03	SELIC
04	IGP
05	IPC
06	DÓLAR
07	IMA-S
08	IMA-B
09	IMA-C
10	IRF-M
11	AÇÃO
12	IMÓVEL

CGSOA/COARI/DIMAT – Especificação de Novo Quadro do FIP – agosto/2013

13	IBOVESPA
14	IBRX-50
15	ISE
16	IMA – Geral
17	IMA – Geral ex-C
18	IDkA
19	OUTRAS TAXAS DE JUROS
20	OUTROS ÍNDICES DE PREÇOS
21	OUTROS ÍNDICES DE RENDA FIXA
22	OUTROS ÍNDICES DE AÇÕES
23	OUTROS - GERAIS

Além disso, em função do tipo de ativo, este campo deverá ser preenchido de acordo com a tabela abaixo:

Ativo	Informação a ser preenchida no campo “Indexador_1”
Fundo de Investimento	Benchmark do Fundo
Títulos de Renda Fixa	Fator de Remuneração
Contratos Derivativos	Fator de Remuneração

Lembrando que no caso do swap (derivativo) será informado cada ponta, ativa e passiva, separadamente, devendo em cada preenchimento ser indicado o “indexador_1”.

3.22 Requerimento de Margem

Este campo deverá ser preenchido com o requerimento unitário de margem quando exigido na operação com títulos, valores mobiliários ou derivativos.

Quando não houver requerimento, preencher com zeros.

CGSOA/COARI/DIMAT – Especificação de Novo Quadro do FIP – agosto/2013

Os valores deverão ser informados em reais.

3.23 Patrimônio

Este campo deverá ser preenchido com o patrimônio líquido do fundo ou com o valor do patrimônio separado de emissão de certificado de recebíveis.

3.24 Prazo Médio Remanescente

Este campo deverá ser preenchido com o Prazo Médio Remanescente do ativo no dia. Este prazo é o calculado no próprio dia, e não a média móvel.

3.25 Prazo Médio de Repactuação

Este campo deverá ser preenchido com o Prazo Médio de Repactuação do ativo no dia. Este prazo é o calculado no próprio dia, e não a média móvel.

3.26 VaR (1 dia/ 99%)

Este campo deverá ser preenchido com o VaR (1 dia/ 99%) do fundo indicado no campo 'CNPJ_2'.

A metodologia utilizada no cálculo do VaR deverá ser baseada nas melhores práticas do mercado.

Campo aplicável somente a fundos de investimento.

3.27 Vínculo à SUSEP

Neste campo deverá ser informado se o ativo está vinculado à garantia de provisões técnicas. Apenas os ativos depositados em conta vinculada, os imóveis cujas certidões contenham a cláusula de vínculo e estejam estas atualizadas junto à SUSEP e os ativos especiais vinculados, conforme norma específica, podem ser indicados como vinculados.

Valores possíveis: 'V' – vinculado; 'L' – livre.

Obs: Os ativos constantes das carteiras dos fundos de investimento devem ser marcados como "L".

4. Exemplos

4.1 LTN

Dados: 100 LTNs na carteira do FIE Previdenciário (PGBL/VGBL) de cnpj 22.222.222/222-22, da seguradora de cnpj 11.111.111/1111-11, com vencimento em 01/01/2014, adquiridas em 03/01/2013 a R\$ 933,49 cada.

Data de referência: 30/04/2013.

Observações: O ativo está registrado contabilmente como mantido até o vencimento e depositado em conta vinculada no Selic.

Dados:		
Tipo Ativo	1040 - Letra do Tesouro Nacional	
Quantidade Contratos	100	
Preço Unitário Aquisição	R\$ 933,49	
Taxa	7,12%	
Preço Unitário Curva	R\$ 955,15	
Preço Unitário Mercado	R\$ 949,99	
Vínculo à SUSEP	V - Vinculado	
Tipo Registro	01 - Carteira FIE Prev1	
CNPJ FIE Prev	22.222.222/222-22	
Tipo de Marcação	1 - Mantido até o Vencimento	
Data Aquisição	03/01/2013	
Data Vencimento	01/01/2014	
Data Referência	30/04/2013	
Prazo Médio Remanescente	246	
Prazo Médio de Repactuação	246	PRÉ

CGSOA/COARI/DIMAT – Especificação de Novo Quadro do FIP – agosto/2013

Campo	Preenchimento	Comentário
Tipo Registro	01	Carteira de FIE Prev 1
Data	20130430	data de referência: 30/04/13
CNPJ_1	222222222222	CNPJ FIE Prev
Tipo Ativo	1040	Letras do Tesouro Nacional
Código Câmara	100000	Código Selic – Preencher caracteres não utilizados com espaços em branco
Código Isin	BRSTNCLTN6M6	
Local do Registro	1	Selic
Endereço Imóvel	000000000000000000000000000000000000	Preencher com zeros
UF Imóvel	00	Preencher com zeros
Cidade Imóvel	00000000000000000000	Preencher com zeros
Emissor	00394460040950	CNPJ da STN
CNPJ_2	00000000000000	Preencher com zeros
Gestor fundo	00000000000000	Preencher com zeros
Vencimento	20140101	
Tipo de Marcação	1	mantido ao vencimento
Valor Contábil Unitário	0000000000955,1500000000	Valor na curva
Valor Mercado Unitário	0000000000949,9900000000	Valor de mercado unitário
Exposição Fator Risco	0000000000949,9900000000	Exposição Fator Risco
Quantidade	0000000000100,0000000000	
Posição	c	
Indexador_1 (benchmark)	01	Pré-fixado
Requerimento de Margem	0000000000000,0000000000	
Patrimônio	0000000000000,0000000000	
Cotas Emitidas	0000000000000,0000000000	

CGSOA/COARI/DIMAT – Especificação de Novo Quadro do FIP – agosto/2013

Prazo Médio Remanescente	00246,00	número de dias corridos entre 30/04/2013 e 01/01/2014
Prazo Médio de Repactuação	00246,00	pré-fixado
VaR (1 dia/ 99%)	0000000000000,0000000000	
Vínculo à Susep	V	

4.2 LFT

Dados: 100 LFTs na carteira própria da seguradora cnpj 11.111.111/1111-11, com vencimento em 07/09/2014.

Data de referência: 30/04/2013.

Observações: O ativo está registrado contabilmente como disponível para venda e depositado em conta vinculada no Selic.

[illegible]

CGSOA/COARI/DIMAT – Especificação de Novo Quadro do FIP – agosto/2013

Tipo de Marcação	3	Disponível para venda
Valor Contábil Unitário	0000000005573,9100000000	
Valor Mercado Unitário	0000000005573,9100000000	
Exposição Fator Risco	0000000005573,9100000000	Exposição Fator Risco
Quantidade	0000000000100,0000000000	
posição	c	
Indexador_1 (benchmark)	03	Selic
Requerimento de Margem	0000000000000,0000000000	
Patrimônio	0000000000000,0000000000	
Cotas Emitidas	0000000000000,0000000000	
Prazo Médio Remanescente	00000,00	Como é carteira própria, não precisa informar.
Prazo Médio de Repactuação	00000,00	Como é carteira própria, não precisa informar. Se pertencesse à carteira de um fundo previdenciário, o prazo médio de repactuação seria 1.
VaR (1 dia/ 99%)	0000000000000,0000000000	
Vínculo à Susep	V	

4.3 NTN-B

Dados: 100 NTN-B na carteira do FIE Previdenciário (PGBL/VGBL) de cnpj 22.222.222/2222-22, da seguradora cnpj 11.111.111/1111-11, com vencimento em 15/08/2014.

Data de referência: 30/04/2013.

Observações: O ativo está registrado contabilmente como mantido até o vencimento e depositado em conta vinculada no Selic.

CGSOA/COARI/DIMAT – Especificação de Novo Quadro do FIP – agosto/2013

Campo	Preenchimento	Comentário
Tipo Registro	01	Carteira de FIE Prev 1
Data	20130430	Data de referência: 30/04/13
CNPJ_1	222222222222	CNPJ FIE
Tipo Ativo	1139	NTN- Notas do Tesouro Nacional
Código Câmara	760199	Código Selic – Preencher caracteres não utilizados com espaços em branco
Código Isin	BRSTNCNTB393	
Local do Registro	1	Selic
Endereço Imóvel	000000000000000000000000000000000000	Preencher com zeros
UF Imóvel	00	Preencher com zeros
Cidade Imóvel	00000000000000000000	Preencher com zeros
Emissor	00394460040950	CNPJ da STN
CNPJ_2	00000000000000	
Gestor fundo	00000000000000	
Vencimento	20140815	
Tipo de Marcação	1	Mantido ao vencimento
Valor Contábil Unitário	0000000002640,3700000000	Valor na curva unitário
Valor Mercado Unitário	0000000002400,0900000000	Valor de mercado unitário
Exposição Fator Risco	0000000002400,0900000000	Exposição Fator Risco
Quantidade	0000000000100,0000000000	
Posição	c	comprado
Indexador_1 (benchmark)	05	IPCA
Requerimento de Margem	0000000000000,0000000000	
Patrimônio	0000000000000,0000000000	
Cotas Emitidas	0000000000000,0000000000	
Prazo Médio Remanescente	00472,00	número de dias corridos entre 30/04/2013 e 15/08/2014

CGSOA/COARI/DIMAT – Especificação de Novo Quadro do FIP – agosto/2013

Prazo Médio de Repactuação	00472,00	IPCA
VaR (1 dia/ 99%)	0000000000000,0000000000	só aplicável a fundos de investimento
Vínculo à Susep	V	

4.4 Ações

Dados: 10.000 ações PETR4 na carteira do fundo PGBL/VGBL de CNPJ 22.222.222/2222-2, da seguradora de CNPJ 11.111.111/1111-11.

Data de referência: 30/04/2013.

Observações: O ativo está registrado contabilmente como disponível para negociação.

Campo	Preenchimento	Comentário
Tipo Registro	01	FIE
Data	20130430	Data de referência: 30/04/13
CNPJ_1	222222222222	CNPJ do FIE
Tipo Ativo	2102	AÇÕES CBLC
Código Câmara	PETR4	Código BMFBovespa – Preencher caracteres não utilizados com espaços em branco
Código Isin	BRPETRACNPR6	
Local do Registro	3	BM&Fbovespa
Endereço Imóvel	0000000000000000000000000000000000 00	Preencher com zeros
UF Imóvel	00	Preencher com zeros
Cidade Imóvel	00000000000000000000	Preencher com zeros
Emissor	33000167000101	CNPJ da PETROBRAS S/A
CNPJ_2	00000000000000	
Gestor fundo	00000000000000	

CGSOA/COARI/DIMAT – Especificação de Novo Quadro do FIP – agosto/2013

Vencimento	00000000	Preencher com zeros
Tipo de Marcação	2	Disponível para Negociação
Valor Contábil Unitário	00000000000012,9500000000	Valor de mercado unitário
Valor Mercado Unitário	00000000000012,9500000000	Valor de mercado unitário
Exposição Fator Risco	00000000000012,9500000000	Exposição Fator Risco
Quantidade	0000000010000,0000000000	
posição	c	Comprado
Indexador_1 (benchmark)	11	Ação
Requerimento de Margem	0000000000000,0000000000	
Patrimônio	0000000000000,0000000000	
Cotas Emitidas	0000000000000,0000000000	
Prazo Médio Remanescente	000000,00	
Prazo Médio de Repactuação	000000,00	
VaR (1 dia/ 99%)	000000000000000000000000	só aplicável a fundos de investimento
Vínculo à Susep	L	carteira FIE

4.5 FIDC

Dados: 1.000 cotas do FIDC de CNPJ: 11.461.546/0001-66, cujo CNPJ do administrador é 11.758.741/0001-52 e do gestor é 13.797.505/0001-70, na carteira própria da seguradora de CNPJ 11.111.111/1111-11, com vencimento indeterminado.

Data de referência: 30/04/2013.

Observações: O ativo está registrado contabilmente como disponível para negociação e depositado em conta de livre movimentação na Cetip. O PL do fundo em 30/04/2013 era de R\$ 29.340.261,95 e o valor da cota era de R\$ 960,75. 30.539 cotas seniores foram emitidas. Não foram emitidas cotas subordinadas. Isin: BRCEQCTF004. Código Cetip: 0426307CES

Campo	Preenchimento	Comentário
-------	---------------	------------

CGSOA/COARI/DIMAT – Especificação de Novo Quadro do FIP – agosto/2013

Tipo Registro	00	Carteira propria
Data	20130430	Data de referência: 30/04/13
CNPJ_1	11111111111111	CNPJ da seguradora
Tipo Ativo	4741	FIDC
Código Câmara	0426307CES	Código CETIP – Preencher caracteres não utilizados com espaços em branco
Código Isin	BRCESQCTF004	
Local do Registro	2	CETIP
Endereço Imóvel	00	Preencher com zeros
UF Imóvel	00	Preencher com zeros
Cidade Imóvel	00000000000000000000	Preencher com zeros
Emissor	11758741000152	CNPJ do Administrador
CNPJ_2	11461546000166	CNPJ do Fundo
Gestor fundo	13797505000170	CNPJ do Gestor
Vencimento	00000000	Preencher com zeros
Tipo de Marcação	2	Disponível para Negociação
Valor Contábil Unitário	0000000000960,7500000000	Valor de mercado da Cota
Valor Mercado Unitário	0000000000960,7500000000	Valor de mercado da Cota
Exposição Fator Risco	0000000000960,7500000000	Exposição Fator Risco
Quantidade	00000000001000,0000000000	
posição	c	
Indexador_1 (benchmark)	02	CDI
Requerimento de Margem	0000000000000,0000000000	
Patrimônio	0000029340261,9500000000	
Cotas Emitidas	0000000030539,0000000000	
Prazo Médio Remanescente	00000,00	
Prazo Médio de Repactuação	00000,00	

CGSOA/COARI/DIMAT – Especificação de Novo Quadro do FIP – agosto/2013

VaR (1 dia/ 99%)	0000000000000,0000000000	
Vínculo à Susep	L	

4.6 Imóvel

Dados: Imóvel urbano sito à Rua ABC,111, Centro, Rio de Janeiro RJ, de propriedade da seguradora de CNPJ 11.111.111/1111-11, adquirido em 03/01/2013 por R\$ 1.000.000,00.

Data de referência: 30/04/2013.

Observações: A certidão do RGI - nº 3333 do 11º OFÍCIO DO REGISTRO DE IMÓVEIS - contém cláusula de vínculo e está atualizada junto à Susep.

Campo	Preenchimento	Comentário
Tipo Registro	00	Carteira Própria
Data	20130430	Data de referência: 30/04/13
CNPJ_1	1111111111111	CNPJ da seguradora
Tipo Ativo	3018	Imóveis (Líquido de Depreciação)
Código Câmara	3333	Matrícula no RGI – Preencher caracteres não utilizados com espaços em branco
Código Isin	000000000000	
Local do Registro	5	RGI
Endereço Imóvel	Rua ABC, 111, Centro	Preencher caracteres não utilizados com espaços em branco
UF Imóvel	RJ	
Cidade Imóvel	Rio de Janeiro	Preencher caracteres não utilizados com espaços em branco
Emissor	27128834000133	CNPJ do 11º ofício do registro de imóveis
CNPJ_2	0000000000000	
Gestor fundo	0000000000000	
Vencimento	00000000	Preencher com zeros
Tipo de Marcação	4	Custo Histórico
Valor Contábil Unitário	0000000900000,0000000000	Valor histórico depreciado

CGSOA/COARI/DIMAT – Especificação de Novo Quadro do FIP – agosto/2013

Valor Mercado Unitário	0000002000000,0000000000	Valor de mercado unitário
Exposição Fator Risco	0000002000000,0000000000	Exposição Fator Risco
Quantidade	00000000000001,0000000000	
posição	c	
Indexador_1 (benchmark)	12	Imóvel
Requerimento de Margem	0000000000000,0000000000	
Patrimônio	0000000000000,0000000000	
Cotas Emitidas	0000000000000,0000000000	
Prazo Médio Remanescente	00000,00	Não aplicável
Prazo Médio de Repactuação	00000,00	Não aplicável
VaR (1 dia/ 99%)	0000000000000,0000000000	
Vínculo à Susep	V	

4.7 Fundo de Investimento

Dados: 1.000 cotas do Fundo de Investimento em RF (Fundo 409) de CNPJ: 22.222.222/2222-22, cujo administrador é a adm s.a. de cnpj 33.333.333/3333-3, o gestor é a gestor s.a. de cnpj 44.444.444/4444-44, e cujas cotas são de propriedade do FIE de CNPJ 11.111.111/1111-11.

Data de referência: 30/04/2013.

Observações: I) Havia 1.000.000 cotas emitidas do fundo em 30/04/2013. O PL do fundo era de R\$ 1.234.567,89, com valor de cota igual a 1,23456789. As cotas estavam registradas em conta vinculada à Susep na Cetip;

II) O PMR da carteira do fundo é de 1350 dias. O PRC é de 1000 dias.

Campo	Preenchimento	Comentário
Tipo Registro	01	FIE Prev 1
Data	20130430	data de referência: 30/04/13
CNPJ_1	11111111111111	CNPJ do FIE
Tipo Ativo	4410	Fundo de Invest. de Renda Fixa

CGSOA/COARI/DIMAT – Especificação de Novo Quadro do FIP – agosto/2013

Código Câmara	1661812F940	Código do Fundo na Cetip – Preencher caracteres não utilizados com espaços em branco
Código Isin	BRIVG2CTF009	
Local do Registro	2	Cetip
Endereço Imóvel	0000000000000000000000000000000000 000	Preencher com zeros
UF Imóvel	00	Preencher com zeros
Cidade Imóvel	00000000000000000000	Preencher com zeros
Emissor	333333333333	CNPJ do administrador
CNPJ_2	222222222222	CNPJ fundo
Gestor fundo	444444444444	CNPJ gestor
Vencimento	00000000	Preencher com zeros
Tipo de Marcação	2	Disponível para negociação
Valor Contábil Unitário	0000000000001,2345678900	Valor da cota
Valor Mercado Unitário	0000000000001,2345678900	Valor da cota
Exposição Fator Risco	0000000000001,2345678900	Exposição Fator Risco
Quantidade	0000000001000,0000000000	1.000 cotas
posição	c	
Indexador_1 (benchmark)	14	Benchmark do fundo: IMA-B
Requerimento de Margem	000000000000,0000000000	
Patrimônio	0000001234567,8900000000	R\$ 1,234,567.89
Cotas Emitidas	0000001000000,0000000000	1.000.000 de cotas
Prazo Médio Remanescente	01350,00	PMR = 1350 dias
Prazo Médio de Repactuação	01000,00	PRC = 1000 dias
VaR (1 dia/ 99%)	000000000000,0249100000	0,02491%

CGSOA/COARI/DIMAT – Especificação de Novo Quadro do FIP – agosto/2013

Vínculo à Susep	V	
-----------------	---	--

4.8 Debênture

Dados: 1.000 debêntures CCRR11, cujo cnpj do emissor é 13.840.074/0001-88, na carteira própria da seguradora cnpj 11.111.111/1111-11, com vencimento em 21/05/2018.

Data de referência: 30/04/2013.

Observações: O ativo está registrado contabilmente como mantido até o vencimento e depositado em conta de livre movimentação no Selic. A debênture foi emitida em 20/05/2013, com valor nominal na emissão igual a R\$ 1.000,00, corrigido a cada dia útil por 100% do DI. Paga juros de 2,6% a.a. a cada 6 meses.

Campo	Preenchimento	Comentário
Tipo Registro	00	Carteira Própria
Data	20130430	data de referência: 30/04/13
CNPJ_1	11111111111111	CNPJ da seguradora
Tipo Ativo	4120	Debêntures de Distribuição Pública
Código Câmara	CCRR11	Código Cetip – Preencher caracteres não utilizados com espaços em branco
Código Isin	BRCCRRDBS007	
Local do Registro	2	Cetip
Endereço Imóvel	00	Preencher com zeros
UF Imóvel	00	Preencher com zeros
Cidade Imóvel	00000000000000000000	Preencher com zeros
Emissor	13840074000188	CNPJ do Emissor
CNPJ_2	00000000000000	
Gestor fundo	00000000000000	
Vencimento	20180521	
Tipo de Marcação	1	Mantido ao vencimento
Valor Contábil Unitário	0000000001054,3700000000	Valor na curva unitário

CGSOA/COARI/DIMAT – Especificação de Novo Quadro do FIP – agosto/2013

Valor Mercado Unitário	0000000000948,89000000000	Valor de mercado unitário
Exposição Fator Risco	0000000000948,89000000000	Exposição Fator Risco
Quantidade	0000000001000,00000000000	
posição	c	
Indexador_1 (benchmark)	02	DI
Requerimento de Margem	0000000000000,00000000000	
Patrimônio	0000000000000,00000000000	
Cotas Emitidas	0000000000000,00000000000	
Prazo Médio Remanescente	00000,00	Preencher com zeros
Prazo Médio de Repactuação	00000,00	Preencher com zeros
VaR (1 dia/ 99%)	0000000000000,00000000000	
Vínculo à Susep	L	

4.9 Assistência Financeira

Dados: carteira de assistência financeira (indexada ao IGP) da seguradora cnpj 11.111.111/1111-11, avaliada em R\$ 1.000.000,00. Prazo Médio da Carteira 450 dias.

Data de referência: 30/04/2013.

Observações: Redução a valor recuperável de R\$ 100.000,00. Valor de mercado da carteira R\$ 1.120.000,00.

Campo	Preenchimento	Comentário
Tipo Registro	00	Carteira Própria
Data	20130430	Data de referência: 30/04/13
CNPJ_1	11111111111111	CNPJ da seguradora
Tipo Ativo	4596	Empréstimos Assistenciais
Código Câmara	000000000000000	Preencher com zeros
Código Isin	00000000000000	Preencher com zeros

CGSOA/COARI/DIMAT – Especificação de Novo Quadro do FIP – agosto/2013

[illegible]

4.10 Futuro de DI1

CGSOA/COARI/DIMAT – Especificação de Novo Quadro do FIP – agosto/2013

Dados: Compra de 10 DI1F14 na carteira própria da seguradora cnpj 11.111.111/1111-11, com vencimento em 01/01/2014, adquiridos em 03/01/2013 a R\$ 93.349,00 cada.

Data de referência: 30/04/2013.

Observações: O derivativo está registrado contabilmente como disponível para venda.

Campo	Preenchimento	Comentário
Tipo Registro	00	Carteira Própria
Data	20130430	Data de referência: 30/04/13
CNPJ_1	11111111111111	CNPJ da seguradora
Tipo Ativo	AAAA	Futuro
Código Câmara	DI1F14	Código BM&Fbovespa – Preencher caracteres não utilizados com espaços em branco
Código Isin	BRBMEFD11E1	
Local do Registro	3	BM&Fbovespa
Endereço Imóvel	00000000000000000000000000000000 000000	Preencher com zeros
UF Imóvel	00	Preencher com zeros
Cidade Imóvel	00000000000000000000	Preencher com zeros
Emissor	09346601000125	CNPJ da BM&Fbovespa
CNPJ_2	00000000000000	
Gestor fundo	00000000000000	
Vencimento	20140102	
Tipo de Marcação	1	Mantido ao vencimento
Valor Contábil Unitário	0000000000450,8500000000	Soma dos ajustes diários
Valor Mercado Unitário	0000000000450,8500000000	Soma dos ajustes diários
Exposição Fator Risco	0000000094936,6900000000	Exposição Fator Risco
Quantidade	0000000000010,0000000000	
Posição	v	

CGSOA/COARI/DIMAT – Especificação de Novo Quadro do FIP – agosto/2013

Indexador_1 (benchmark)	02	CDI
Requerimento de Margem	0000000000960,5400000000	
Patrimônio	0000000000000,0000000000	
Cotas Emitidas	0000000000000,0000000000	
Prazo Médio Remanescente	00000,00	
Prazo Médio de Repactuação	0-246,00	= 1(ponta ativa DI)- 247 (ponta passiva = número de dias corridos entre 30/04/2013 e 01/01/2014)
VaR (1 dia/ 99%)	0000000000000,0000000000	
Vínculo à Susep	L	

4.11 Opção de Ação

Dados: Compra de 10 OPPETRE19 na carteira própria da seguradora cnpj 11.111.111/1111-11, com vencimento em 20/05/2013, adquiridas em 16/04/2013 a R\$ 0.24 cada.

Data de referência: 30/04/2013.

Observações: O derivativo está registrado contabilmente como disponível para venda.

CGSOA/COARI/DIMAT – Especificação de Novo Quadro do FIP – agosto/2013

<u>Dados:</u>		
Tipo Ativo	CCCC - Opção	
Quantidade Contratos	10	
Preço Unitário Aquisição	R\$ 0,24	prêmio
Preço Unitário Contábil	R\$ 1,87	prêmio
Preço Unitário Mercado	R\$ 1,87	prêmio
Preço PETR4 em 30/04/2013	R\$ 20,09	
Delta em 30/04/2013	92,34%	
Exposição a PETR4	R\$ 18,55	
Vínculo à SUSEP	L - Vinculado	
Tipo Registro	00 - Carteira Própria	
CNPJ	11.111.111/1111-11	
Tipo de Marcação	2 - Disponível para Venda	
Data Aquisição	16/04/2013	
Data Vencimento	20/05/2013	
Data Referência	30/04/2013	
Prazo Médio Remanescente	0	
Prazo Médio de Repactuação	0	

Campo	Preenchimento	Comentário
Tipo Registro	00	Carteira Própria
Data	20130430	Data de referência: 30/04/13
CNPJ_1	11111111111111	CNPJ da seguradora
Tipo Ativo	CCCC	Futuro
Código Câmara	OPPETRE19	Código BM&FBovespa – Preencher caracteres não utilizados com espaços em

CGSOA/COARI/DIMAT – Especificação de Novo Quadro do FIP – agosto/2013

		branco
Código Isin	BRBVMF3E06I7	
Local do Registro	3	BM&Fbovespa
Endereço Imóvel	00000000000000000000000000000000 000	Preencher com zeros
UF Imóvel	00	Preencher com zeros
Cidade Imóvel	00000000000000000000	Preencher com zeros
Emissor	09346601000125	CNPJ da BM&Fbovespa
CNPJ_2	00000000000000	
Gestor fundo	00000000000000	
Vencimento	20130520	
Tipo de Marcação	1	mantido ao vencimento
Valor Contábil Unitário	0000000000001,8700000000	Prêmio a mercado
Valor Mercado Unitário	0000000000001,8700000000	Prêmio a Mercado
Exposição Fator Risco	00000000000020,0900000000	Valor do Ativo Subjacente x delta opção
Quantidade	00000000000010,0000000000	
posição	c	
Indexador_1 (benchmark)	11	AÇÃO
Requerimento de Margem	000000000000,0000000000	
Patrimônio	000000000000,0000000000	
Cotas Emitidas	000000000000,0000000000	
Prazo Médio Remanescente	00000,00	
Prazo Médio de Repactuação	00000,00	
VaR (1 dia/ 99%)	000000000000,0000000000	
Vínculo à Susep	V	

CGSOA/COARI/DIMAT – Especificação de Novo Quadro do FIP – agosto/2013

4.12 FIE – Fundo de Investimento Exclusivo

Dados: FIE sujeito à Res CMN nº 4.176/2013

Data de referência: 30/04/2013.

Campo	Preenchimento	Comentário
Tipo Registro	00	Carteira Própria
Data	20130430	data de referência: 30/04/13
CNPJ_1	11111111111111	CNPJ da seguradora
Tipo Ativo	1000	Carteira 4176
Código Câmara	ABCD1234	Código do Fundo na Cetip – Preencher caracteres não utilizados com espaços em branco
Código Isin	BRXXXXCTF000	Código Isin do Fundo
Local do Registro	2	Cetip
Endereço Imóvel	00000000000000000000000000000000 0000	Preencher com zeros
UF Imóvel	00	Preencher com zeros
Cidade Imóvel	00000000000000000000	Preencher com zeros
Emissor	22222222222222	CNPJ do Administrador
CNPJ_2	33333333333333	CNPJ do Fundo
Gestor fundo	44444444444444	CNPJ Gestor
Vencimento	00000000	Preencher com zeros
Tipo de Marcação	0	
Valor Contábil Unitário	00000000000001,0000000000	Valor da cota
Valor Mercado Unitário	00000000000001,0000000000	Valor da cota
Exposição Fator Risco	00000000000001,0000000000	Valor da cota
Quantidade	0000001000000,0000000000	Quantidade de cotas

CGSOA/COARI/DIMAT – Especificação de Novo Quadro do FIP – agosto/2013

posição	c	Preencher com 'c'
Indexador_1 (benchmark)	14	Benchmark do fundo (IMA-B)
Requerimento de Margem	0000000000000,00000000000	Preencher com zeros
Patrimônio	0000001000000,00000000000	PL do fundo
Cotas Emitidas	0000001000000,00000000000	Preencher com zeros
Prazo Médio Remanescente	04000,00	Prazo da Carteira
Prazo Médio de Repactuação	02000,00	Prazo da Carteira
VaR (1 dia/ 99%)	0000000000000,0249100000	0,02491%
Vínculo à Susep	v	Preencher com 'v'

4.13 FIE – Carteira 4176

Dados: Carteira sujeita à Res CMN nº 4.176/2013

Data de referência: 30/04/2013.

Campo	Preenchimento	Comentário
Tipo Registro	00	Carteira Própria
Data	20130430	data de referência: 30/04/13
CNPJ_1	11111111111111	CNPJ da seguradora
Tipo Ativo	1000	Carteira 4176
Código Câmara	0000000000000000	Preencher com zeros
Código Isin	00000000000000	Preencher com zeros
Local do Registro	0	Preencher com zeros
Endereço Imóvel	00	Preencher com zeros
UF Imóvel	00	Preencher com zeros
Cidade Imóvel	00000000000000000000	Preencher com zeros

CGSOA/COARI/DIMAT – Especificação de Novo Quadro do FIP – agosto/2013

Emissor	0000000000000000	Preencher com zeros
CNPJ_2	0000000000000000	Preencher com zeros
Gestor fundo	0000000000000000	Preencher com zeros
Vencimento	00000000	Preencher com zeros
Tipo de Marcação	0	Preencher com zeros
Valor Contábil Unitário	00000000000000,0000000000	Preencher com zeros
Valor Mercado Unitário	00010000000000,0000000000	Valor total da carteira = R\$ 1 bilhão
Exposição Fator Risco	00000000000000,0000000000	Preencher com zeros
Quantidade	00000000000000,0000000000	Preencher com zeros
posição	c	Preencher com 'c'
Indexador_1 (benchmark)	00	Preencher com zeros
Requerimento de Margem	00000000000000,0000000000	Preencher com zeros
Patrimônio	00000000000000,0000000000	Preencher com zeros
Cotas Emitidas	00000000000000,0000000000	Preencher com zeros
Prazo Médio Remanescente	04000,00	Prazo da Carteira
Prazo Médio de Repactuação	02000,00	Prazo da Carteira
VaR (1 dia/ 99%)	00000000000000,0000000000	Preencher com zeros
Vínculo à Susep	v	Preencher com 'v'

CGSOA/COARI/DIMAT – Especificação de Novo Quadro do FIP – agosto/2013

4.14 Cruzamento Informações

			PLANOS TRADICIONAIS				
						LTN	
						Preço Unitário Curva	R\$ 955,22
						Preço Unitário Mercado	R\$ 950,00
EAPC			FIE PGBL/VGBL		FIFE 1	Prazo Médio Remanescente	4000 dc
CNPJ 11.111.111/1111-11					CNPJ 33.333.333/3333-33	Prazo Médio de Repactuação	4000 dc
Qtd FIFE 1 = 5.000.000,00					cota = R\$9,50		
					Qtd total cotas = 1.000.000,00		
					Qtd LTN = 10.000,00		
					PL = R\$ 9.500.000,00		
			FIFE 1				
			CNPJ 22.222.222/2222-22				
			Fundo em cotas - RF				
			cota = R\$ 0,95		FIFE 2		
			Qtd total cotas = 5.000.000,00				
			Qtd FIFE 1 = 500.000,00				
			PL = R\$ 4.750.000,00				

CGSOA/COARI/DIMAT – Especificação de Novo Quadro do FIP – agosto/2013

Campo	EAPC	FIQE 1	FIFE 1
Tipo Registro	00 - Carteira Própria	02 - Carteira de FIQE	09 - Carteira FIFE
Data			
CNPJ_1	11111111111111	22222222222222	33333333333333
Tipo Ativo	HHHH - FIQE prev 1	GGGG - FIFE	1040 - LTN
Código Câmara			
Código Isin			
Local do Registro	1 - CETIP	1 - CETIP	0 - SELIC
Endereço Imóvel			
UF Imóvel			
Cidade Imóvel			
Emissor	CNPJ do Administrador FIQE 1	CNPJ do Administrador FIFE 1	CNPJ do Tesouro Nacional
CNPJ_2	22222222222222	33333333333333	00000000000000
Gestor fundo	CNPJ do Gestor do FIQE 1	CNPJ do Gestor do FIFE 1	00000000000000
Vencimento			
Tipo de Marcação	3 - Disponível para Venda	3 - Disponível para Venda	3 - Disponível para Venda
Valor Contábil Unitário	0000000000001,2000000000	0000000000009,5000000000	0000000000950,0000000000
Valor Mercado Unitário	0000000000001,2000000000	0000000000009,5000000000	0000000000950,0000000000
Exposição Fator Risco	0000000000001,2000000000	0000000000009,5000000000	0000000000950,0000000000
Quantidade	0000005000000,0000000000	0000000500000,0000000000	0000000010000,0000000000
posição	C	C	C
Indexador_1 (benchmark)	00 - PRÉ	00 - PRÉ	00 - PRÉ
Requerimento de Margem			
Patrimônio	0000004750000,0000000000	0000009500000,0000000000	
Cotas Emitidas	0000005000000,0000000000	0000001000000,0000000000	
Prazo Médio Remanescente	04000,00	04000,00	04000,00
Prazo Médio de Repactuação	04000,00	04000,00	04000,00
VaR (1 dia/ 99%)			
Vínculo à Susep	V - Vinculado	L - Livre	L - Livre