



---

# **DIRETORIA DE INVESTIMENTOS**

## **Relatório Mensal de Investimentos**

**SETEMBRO**

Rio de Janeiro

2013

## **Diretoria de Investimentos**

Ciro Mauro de Carvalho Giannini – Diretor de Investimentos

### **Gerência de Operações e Planejamento**

Marcio Martins Rocha Ramos – Gerente  
Flávia Affonso Teixeira – Coordenadora de Planejamento  
Angela Maria Monteiro Pandolfo  
Carlos Augusto Bastos Fernandes  
Ubirajara da Silva Coelho  
Luciana Pinto Venâncio  
Fabio Rodrigo Amaral de Assunção  
Juliana Chaves Monteiro

**Fundo Único de Previdência do Estado do Rio de Janeiro – RIOPREVIDÊNCIA**  
Rua da Quitanda nº 106  
20.011-030 – Centro – Rio de Janeiro – RJ  
Telefone: (21) 2332-5757  
Home page: [www.rioprevidencia.rj.gov.br](http://www.rioprevidencia.rj.gov.br)

Elaborado por : Carlos Augusto B. Fernandes – Assessor de Risco - DIN - mat. 180.313-9

## RELATÓRIO MENSAL DE INVESTIMENTOS

Setembro de 2013

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA DO RIOPREVIDÊNCIA		(R\$)
<b>A - Disponível</b>		<b>958.887.456</b>
<b>B - Segmento de Renda Fixa</b>		<b>0</b>
1 - Carteiras Próprias		0
2- Operação Compromissada - Lastro: TPF		0
<b>C - Segmento de Imóveis</b>		<b>250.303.758</b>
1 - Carteiras Próprias		250.303.758
<b>D - Fundos de Investimento</b>		<b>708.583.699</b>
1 - Fundos de Curto Prazo		0
2 - Fundos Referenciados DI		708.583.699
3 - Fundos de Renda Fixa RF IMA		0
4 - Fundos Multimercado		0
5 - Fundos de Ações		0

A composição das aplicações do RIOPREVIDÊNCIA no encerramento do mês de setembro se apresentou conforme as tabelas abaixo, dentro dos limites estabelecidos na Resolução nº 3.922/10 do CMN, e do Plano Anual de Investimentos.

### Rioprevidência - Setembro de 2013

Posição consolidada da carteira por tipo de risco	(R\$)	(% do total)
<b>1- Títulos Públicos Federais</b>	<b>472.669.450</b>	<b>49,3%</b>
1.1 - Prefixados (LTN, NTN-F)	12.042.638	1,3%
1.2 - Pós-fixados (LFT - Selic, LTN com DI-1 Selic, Op.Comp.)	460.626.812	48,0%
1.3 - IPCA (NTN-B)	0	0,0%
1.4 - IGP-DI (CFT - Carteira Própria)	0	0,0%
<b>2- Títulos Privados de Baixo Risco de Crédito (I)</b>	<b>228.441.758</b>	<b>23,8%</b>
2.1 - CDB	34.604.735	3,6%
2.2 - Let. Financeira	167.853.697	17,5%
2.3 - Debêntures	20.167.892	2,1%
2.4 - DPGE	5.007.287	0,5%
2.5 - Outros Títulos	808.147	0,1%
<b>3 - Cotas de Fundos (II)</b>	<b>7.469.048</b>	<b>0,8%</b>
<b>4- Tesouraria (III)</b>	<b>3.442</b>	<b>0,0%</b>
<b>5- Imóveis (IV)</b>	<b>250.303.758</b>	<b>26,1%</b>
<b>Total da Carteira</b>	<b>958.887.456</b>	<b>100,0%</b>

Fonte: RIOPREVIDÊNCIA, Bradesco, HSBC, Caixa, Santander, Itaú, B.Brasil.

(I) Valor em Cotas do Fundo Caixa FI Brasil DI, HSBC DI LP, Bradesco Premium DI, Itaú Institucional DI, BB Institucional RF e BB RF Perfil que está alocado em títulos privados de baixo risco de crédito.

(II) Valor em Cotas dos Fundos: HSBC DI LP e Bradesco Premium DI, BB Institucional e BB Perfil investido em outros fundos de investimento.

(III) Recursos mantidos em Tesouraria nos fundos investidos.

(IV) Refere-se ao valor apurado em 31/08/2013.

Rioprevidência - Setembro de 2013

Posição da Carteira em 30/09/2013, por Limites do PAI e Resolução nº 3.922/10

Segmento	Tipo de Ativo	Valores (R\$)	% (V)	Limites PAI (% total)	Limite da Res. nº 3.922/10
Renda Fixa	TPF	0	0,00%	100,0%	Até 100,0%
Renda Fixa (I)	FI/FIC RF ou Referenciado	0	0,00%	80,0%	Até 80,0%
Renda Fixa (II)	FI/FIC RF ou Referenciado	708.583.699	0,75%	4,0%	Até 30,0%
Renda Fixa	FI/FIC RF ou Ref. (Crédito Privado)	0	0,00%	1,5%	Até 5,0%
Renda Fixa	Op. Compromissada com TPF	0	0,00%	2,8%	Até 15,0%
<b>Total Renda Fixa</b>		<b>708.583.699</b>	<b>0,75%</b>		
<b>Total do Ativo (III) (Res. 3.922/10)</b>		<b>94.021.014.607</b>			
<b>Imóveis (IV)</b>	<b>Terrenos e Edificações</b>	<b>250.303.758</b>			

Fonte: RIOPREVIDÊNCIA, Bradesco, HSBC, Caixa, Santander, Itaú, B.Brasil.

Glossário:

TPF - Título Público Federal

FI/FIC - Fundos de Investimento

PAI - Plano Anual de Investimentos (Limites definidos no PAI)

(I) Subíndices do IMA ou do IDkA, exceto subíndice atrelado a taxa de juros de 1 dia.

(II) Qualquer indicador de desempenho de Renda Fixa. Inclui valor em cotas dos Fundos: Caixa FI Brasil, HSBC DI LP, Itaú Institucional DI, Bradesco Premium DI, BB Institucional RF e BB RF Perfil que permite a alocação em títulos privados de baixo risco de crédito.

(III) Valor total do Ativo em 31/08/2013.

(IV) Refere-se ao valor apurado em 31/08/2013.

(V) Refere-se ao valor do ativo total apurado em 31/08/2013.

Em setembro, as aplicações financeiras do RIOPREVIDÊNCIA se concentraram em cotas de Fundos de Investimento Referenciado DI, cujos lastros são predominantemente títulos públicos federais. A estratégia de alocação de recursos segue os critérios estabelecidos na legislação vigente, no Plano Anual de Investimentos e pelo Comitê de Investimentos.

Setembro de 2013

Fundos de Investimento			Participação do RIOPREVIDÊNCIA				Rent. Acum. (% Tx. Adm.)				
Nome do Fundo	Tipo de Fundo	Gestor	Quantidade Total de Cotas	Valor Unitário das Cotas	PL dos Fundos R\$ MM	Part. % no PL dos Fundos	Valor dos Fundos R\$ MM	Rent. Acum. (% Tx. Adm.)			(% a.a.)
								Mês	Ano	12 M.	
FI Brasil REF DI LP	REFDI	CAIXA	854.175.230,58	2,01884	1.723,93	1,12%	19,32	0,70	5,68	7,48	0,20
Itaú Institucional Ref. DI FI	REFDI	B. Itaú	319.552,72	1.716,96	548,66	1,84%	10,11	0,71	5,72	7,52	0,18
ITAÚ Soberano-REF. DI LP	REFDI	B. Itaú	177.705.994,26	26,46158	4.702,38	0,03%	1,30	0,70	5,62	7,39	0,15
Bradesco FI RF DI Premium	REFDI	BRAM-Asset	631.002.158,36	6,58111	4.152,69	1,23%	50,88	0,72	5,76	7,60	0,20
Bradesco FI RF DI Federal Extra	REFDI	BRAM-Asset	439.134.672,83	6,59838	2.897,58	0,08%	2,18	0,70	5,64	7,40	0,15
Santander FIC FI Corporate (*)	REFDI	Sant.-Asset	491.347.832,38	6,77494	3.328,85	0,00%	0,02	0,72	5,81	7,61	0,20
BB Prev. RF Perfil FICF	R Fixa	BBDTVM	2.271.782.328,85	1,23773	2.811,85	11,38%	320,11	0,73	5,60	7,43	0,20
BB Institucional FI Renda Fixa	R Fixa	BBDTVM	314.777.031,02	4,91260	1.546,37	19,41%	300,10	0,72	5,66	7,47	0,20
HSBC FI REF. DI LP	REFDI	HSBC	685.496.748,38	16,47931	11.296,51	0,04%	4,57	0,74	5,86	7,70	0,15
<b>TOTAL</b>							<b>708,58</b>				

Fonte: RIOPREVIDÊNCIA, Itaú, Bradesco, Caixa, HSBC, Santander, B.Brasil

(\*) - Valor bloqueado, em verificação pelo Rioprevidência.

No encerramento do mês de setembro, as aplicações financeiras em fundos de investimento totalizaram R\$ 708.583.698,66 distribuídos da forma abaixo:

*Obs: A concentração de aplicações junto ao Banco do Brasil se deve a operação de Cessão Definitiva de Parte dos Créditos de Royalties e Participação Especial pela Exploração de Petróleo e Gás Natural no valor de R\$ 1 bilhão, realizada pelo Banco do Brasil (D.O.- RJ de 27/09/2013) e cujo ingresso se deu no final de setembro.*

### Participação por Instituição Financeira em Fundos de Investimento - R\$ Milhões

