



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

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\$)
A - Disponível		958.887.456
B - Segmento de Renda Fixa		0
1 - Carteiras Próprias		0
2- Operação Compromissada - Lastro: TPF		0
C - Segmento de Imóveis		250.303.758
1 - Carteiras Próprias		250.303.758
D - Fundos de Investimento		708.583.699
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)
1- Títulos Públicos Federais	472.669.450	49,3%
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%
2- Títulos Privados de Baixo Risco de Crédito (I)	228.441.758	23,8%
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%
3 - Cotas de Fundos (II)	7.469.048	0,8%
4- Tesouraria (III)	3.442	0,0%
5- Imóveis (IV)	250.303.758	26,1%
Total da Carteira	958.887.456	100,0%

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%
Total Renda Fixa		708.583.699	0,75%		
Total do Ativo (III) (Res. 3.922/10)		94.021.014.607			
Imóveis (IV)	Terrenos e Edificações	250.303.758			

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
TOTAL							708,58				

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

