



DIRETORIA DE INVESTIMENTOS

Relatório Mensal de Investimentos

OUTUBRO

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 – Agente de Conformidade de Investimento - DIN

RELATÓRIO MENSAL DE INVESTIMENTOS

Outubro de 2013

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA DO RIOPREVIDÊNCIA		(R\$)
A - Disponível		675.738.792
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		425.435.034
1 - Fundos de Curto Prazo		0
2 - Fundos Referenciados DI		425.435.034
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 outubro 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 - Outubro de 2013

Posição consolidada da carteira por tipo de risco	(R\$)	(% do total)
1- Títulos Públicos Federais	283.683.558	42,0%
1.1 - Prefixados (LTN, NTN-F)	258.621	0,0%
1.2 - Pós-fixados (LFT - Selic, LTN com DI-1 Selic, Op.Comp.)	283.424.936	41,9%
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)	133.873.571	19,8%
2.1 - CDB	22.028.088	3,3%
2.2 - Let. Financeira	96.357.463	14,3%
2.3 - Debêntures	11.800.382	1,7%
2.4 - DPGE	3.219.652	0,5%
2.5 - Outros Títulos	467.986	0,1%
3 - Cotas de Fundos (II)	7.877.230	1,2%
4- Tesouraria (III)	675	0,0%
5- Imóveis (IV)	250.303.758	37,0%
Total da Carteira	675.738.792	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 30/09/2013.

Rioprevidência - Outubro de 2013

Posição da Carteira em 31/10/2013, 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	425.435.034	0,45%	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		425.435.034	0,45%		
Total do Ativo (III) (Res. 3.922/10)		93.758.249.350			
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 30/09/2013.

(IV) Refere-se ao valor apurado em 30/09/2013.

(V) Refere-se ao valor do ativo total apurado em 30/09/2013.

Em outubro, 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.

Outubro de 2013

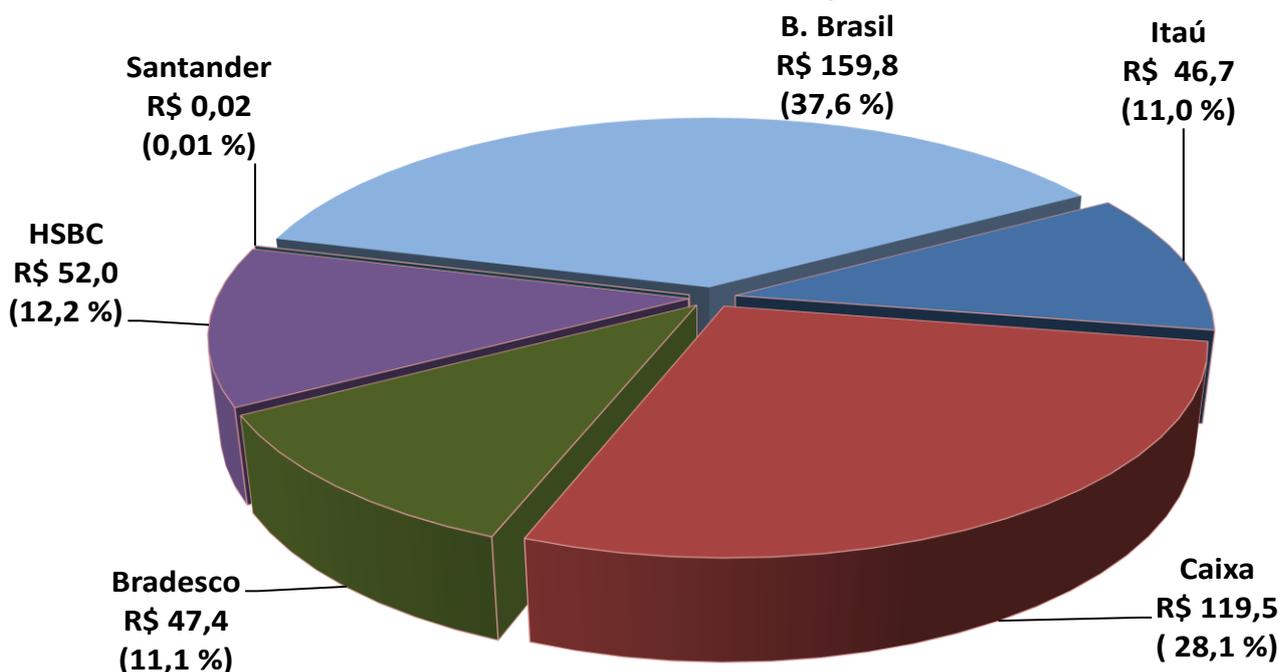
Fundos de Investimento			Participação do RIOPREVIDÊNCIA					Rent. Acum. (% Tx. Adm.)			
Nome do Fundo	Tipo de Fundo	Gestor	Quantidade Total de Cotas	Valor Unitário das Cotas	PL dos Fundos R\$ MM	Part. % no PL dos Fundos	Valor dos Fundos R\$ MM	Mês	Ano	12 M.	(% a.a.)
FI Brasil REF DI LP	REFDI	CAIXA	971.182.248,34	2,03427	1.975,60	6,05%	119,52	0,79	6,52	7,68	0,20
Itaú Institucional Ref. DI FI	REFDI	B. Itaú	318.146,88	1.730,80	550,65	1,79%	9,86	0,81	6,57	7,74	0,18
ITAÚ Soberano-REF. DI LP	REFDI	B. Itaú	217.811.802,56	26,67078	5.809,21	0,63%	36,87	0,79	6,46	7,60	0,15
Bradesco FI RF DI Premium	REFDI	BRAM-Asset	638.810.998,01	6,63494	4.238,48	1,12%	47,37	0,82	6,62	7,81	0,20
Santander FIC FI Corporate (*)	REFDI	Sant.-Asset	505.193.971,56	6,83042	3.450,68	0,00%	0,02	0,82	6,68	7,83	0,20
BB Prev. RF Perfil FICF	R Fixa	BBDTVM	2.269.170.777,29	1,24760	2.831,02	4,52%	127,97	0,80	6,44	7,61	0,20
BB Institucional FI Renda Fixa	R Fixa	BBDTVM	234.442.676,96	4,95181	1.160,92	2,74%	31,86	0,80	6,50	7,65	0,20
HSBC FI REF. DI LP	REFDI	HSBC	678.409.638,15	16,61385	11.271,00	0,46%	51,97	0,82	6,73	7,89	0,15
TOTAL							425,43				

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

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

No encerramento do mês de outubro, as aplicações financeiras em fundos de investimento totalizaram R\$ 425.435.034,21 distribuídos da forma abaixo:

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



COMITÊ DE INVESTIMENTO

Conforme a Ata da Reunião do Comitê de Investimento do Fundo Único de Previdência Social do Estado do Rio de Janeiro – Rioprevidência, realizado no dia 08 de outubro de 2013, na Sede Administrativa, à Rua da Quitanda nº 106 – Centro - Rio de Janeiro, foi aprovada a seguinte proposta:

Fundo Financeiro: A falta de uma definição na política monetária norte-americana e seus fortes reflexos sobre a política monetária dos países emergentes tem deixado nosso mercado de juros (e de câmbio) bastante volátil. O clima de aversão ao risco permanece, em especial com os recentes alertas sobre a possibilidade de revisão do rating soberano do Brasil. Este cenário e a perspectiva de utilização das reservas financeiras do Rioprevidência no curto prazo nos leva a recomendar a continuidade das aplicações com baixa volatilidade e máxima rentabilidade, observando as diretrizes do PAI e da Resolução CMN 3.922/2010.

Fundo Previdenciário: O volume de recursos ainda em fase de formação nos impossibilita desenhar uma estratégia de maior rentabilidade pois ainda não dispomos de uma parcela líquida para eventuais coberturas e para diversificação em vários ativos, estratégia básica para mitigação de riscos. Assim, recomendamos a aplicação da mesma estratégia do Fundo Financeiro para o Fundo Previdenciário.