



---

# **DIRETORIA DE INVESTIMENTOS**

## **Relatório Mensal de Investimentos**

**MAIO**

Rio de Janeiro

2013

## **Diretoria de Investimentos**

Gustavo de Oliveira Barbosa – Diretor Presidente

### **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

**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

Maio de 2013

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA DO RIOPREVIDÊNCIA		(R\$)
<b>A - Disponível</b>		<b>1.174.116.543</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>238.543.883</b>
1 - Carteiras Próprias		238.543.883
<b>D - Fundos de Investimento</b>		<b>935.572.660</b>
1 - Fundos de Curto Prazo		0
2 - Fundos Referenciados DI		935.572.660
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 maio 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 - Maio de 2013

Posição consolidada da carteira por tipo de risco	(R\$)	(% do total)
<b>1- Títulos Públicos Federais</b>	<b>787.582.197</b>	<b>67,1%</b>
1.1 - Prefixados (LTN, NTN-F)	27.218.639	2,3%
1.2 - Pós-fixados (LFT - Selic, LTN com DI-1 Selic, Op.Comp.)	760.363.558	64,8%
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>137.278.208</b>	<b>11,7%</b>
2.1 - CDB	16.682.263	1,4%
2.2 - Let. Financeira	115.186.744	9,8%
2.3 - Debêntures	3.419.574	0,3%
2.4 - DPGE	1.989.627	0,2%
2.5 - N. Promissórias	0	0,0%
<b>3 - Cotas de Fundos (II)</b>	<b>10.697.277</b>	<b>0,9%</b>
<b>4- Tesouraria (III)</b>	<b>14.978</b>	<b>0,0%</b>
<b>5- Imóveis (IV)</b>	<b>238.543.883</b>	<b>20,3%</b>
<b>Total da Carteira</b>	<b>1.174.116.543</b>	<b>100,0%</b>

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

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

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

(III) Recursos mantidos em Tesouraria nos fundos investidos.

(IV) Refere-se ao valor apurado em 30/04/2013.

Rioprevidência - Maio de 2013

Posição da Carteira em 31/05/2013, 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	935.572.660	0,97%	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>935.572.660</b>	<b>0,97%</b>		
<b>Total do Ativo (III) (Res. 3.922/10)</b>		<b>96.742.376.106</b>			
<b>Imóveis (IV)</b>	<b>Terrenos e Edificações</b>	<b>238.543.883</b>			

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

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 e Bradesco Premium DI, que permite a alocação em títulos privados de baixo risco de crédito.

(III) Valor total do Ativo em 30/04/2013.

(IV) Refere-se ao valor apurado em 30/04/2013.

(V) Refere-se ao valor do ativo total apurado em 30/04/2013.

Em maio, 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.

Maio 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	576.167.736,78	1,96500	1.132,17	18,70%	211,68	0,59	2,89	7,26	0,20
FI Caixa Aliança TP RF	R Fixa	CAIXA	136.982.395,09	2,25099	308,35	17,72%	54,65	0,52	2,55	7,02	0,20
FI Caixa Brasil TP RFLP	R Fixa	CAIXA	772.960.388,93	2,13941	1.653,68	10,59%	175,04	0,53	2,63	7,26	0,20
Itaú Institucional Ref. DI FI	REFDI	B. Itaú	241.276,47	1.670,96	403,16	19,73%	79,54	0,61	2,89	7,32	0,18
ITAÚ Soberano-REF. DI LP	REFDI	B. Itaú	177.011.235,93	25,76748	4.561,13	0,10%	4,67	0,59	2,85	7,12	0,15
Bradesco FI RFDI Premium	REFDI	BRAM-Asset	629.278.793,80	6,40316	4.029,38	2,54%	102,21	0,60	2,90	7,36	0,20
Bradesco FI RFDI Federal Extra	REFDI	BRAM-Asset	531.444.925,96	6,42544	3.414,77	6,79%	231,75	0,59	2,87	7,08	0,15
Santander FIC FI Corporate (*)	REFDI	Sant.-Asset	329.965.510,98	6,59324	2.175,54	0,00%	0,02	0,61	2,97	7,42	0,20
HSBC FI REF. DI LP	REFDI	HSBC	662.177.966,94	16,01559	10.605,17	0,72%	76,00	0,60	2,88	7,40	0,15
<b>TOTAL</b>							<b>935,57</b>				

Fonte: RIOPREVIDÊNCIA, Itaú, Bradesco, Caixa, HSBC, Santander

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

No encerramento do mês de maio, as aplicações financeiras em fundos de investimento totalizaram R\$ 935.572.659,79 distribuídos da forma abaixo:

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

