



DIRETORIA DE INVESTIMENTOS

Relatório Mensal de Investimentos

JUNHO

Rio de Janeiro

2013

Diretoria de Investimentos

Luiz Claudio Fernandes L. Gomes – em substituição ao 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

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

Junho de 2013

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA DO RIOPREVIDÊNCIA		(R\$)
A - Disponível		615.023.920
B - Segmento de Renda Fixa		0
1 - Carteiras Próprias		0
2- Operação Compromissada - Lastro: TPF		0
C - Segmento de Imóveis		238.543.883
1 - Carteiras Próprias		238.543.883
D - Fundos de Investimento		376.480.037
1 - Fundos de Curto Prazo		0
2 - Fundos Referenciados DI		376.480.037
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 junho 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 - Junho de 2013

Posição consolidada da carteira por tipo de risco	(R\$)	(% do total)
1- Títulos Públicos Federais	281.972.709	45,8%
1.1 - Prefixados (LTN, NTN-F)	423.297	0,1%
1.2 - Pós-fixados (LFT - Selic, LTN com DI-1 Selic, Op.Comp.)	281.549.412	45,8%
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)	92.579.187	15,1%
2.1 - CDB	12.112.165	2,0%
2.2 - Let. Financeira	75.651.772	12,3%
2.3 - Debêntures	3.437.382	0,6%
2.4 - DPGE	1.377.869	0,2%
2.5 - N. Promissórias	0	0,0%
3 - Cotas de Fundos (II)	1.927.117	0,3%
4- Tesouraria (III)	1.023	0,0%
5- Imóveis (IV)	238.543.883	38,8%
Total da Carteira	615.023.920	100,0%

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 31/05/2013.

Rioprevidência - Junho de 2013

Posição da Carteira em 28/06/2013, 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	376.480.037	0,39%	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		376.480.037	0,39%		
Total do Ativo (III) (Res. 3.922/10)		95.857.839.587			
Imóveis (IV)	Terrenos e Edificações	238.543.883			

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 31/05/2013.

(IV) Refere-se ao valor apurado em 31/05/2013.

(V) Refere-se ao valor do ativo total apurado em 31/05/2013.

Em junho, 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.

Junho 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.)			
								Mês	Ano	12 M.	(%a.a.)
FI Brasil REF DI LP	REF DI	CAIXA	759.445.590,03	1,97678	1.501,26	18,87%	283,26	0,60	3,51	7,23	0,20
FI Caixa Aliança TP RF	R Fixa	CAIXA	122.160.093,40	2,26333	276,49	0,50%	1,39	0,55	3,11	6,87	0,20
FI Caixa Brasil TP RFLP	R Fixa	CAIXA	736.346.951,07	2,15155	1.584,28	0,37%	5,86	0,57	3,21	7,12	0,20
Itaú Institucional Ref. DI FI	REF DI	B. Itaú	233.298,63	1.681,38	392,26	4,74%	18,59	0,62	3,53	7,31	0,18
ITAÚ Soberano-REF. DI LP	REF DI	B. Itaú	174.580.439,52	25,92062	4.525,23	0,04%	1,72	0,59	3,46	7,09	0,15
Bradesco FI RF DI Premium	REF DI	BRAM-Asset	652.070.674,59	6,44311	4.201,36	1,11%	46,61	0,62	3,54	7,34	0,20
Bradesco FI RF DI Federal Extra	REF DI	BRAM-Asset	516.272.592,29	6,46368	3.337,02	0,10%	3,39	0,60	3,48	7,06	0,15
Santander FIC FI Corporate (*)	REF DI	Sant.-Asset	411.103.879,44	6,63314	2.726,91	0,00%	0,02	0,61	3,59	7,37	0,20
HSBC FI REF. DI LP	REF DI	HSBC	663.997.178,09	16,11710	10.701,71	0,15%	15,64	0,63	3,54	7,37	0,15
TOTAL							376,48				

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

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

No encerramento do mês de junho, as aplicações financeiras em fundos de investimento totalizaram R\$ 376.480.036,75 distribuídos da forma abaixo:

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

