



DIRETORIA DE INVESTIMENTOS

Relatório Mensal de Investimentos

JULHO

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

Julho de 2013

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA DO RIOPREVIDÊNCIA		(R\$)
A - Disponível		561.132.074
B - Segmento de Renda Fixa		0
1 - Carteiras Próprias		0
2- Operação Compromissada - Lastro: TPF		0
C - Segmento de Imóveis		237.588.883
1 - Carteiras Próprias		237.588.883
D - Fundos de Investimento		323.543.191
1 - Fundos de Curto Prazo		0
2 - Fundos Referenciados DI		323.543.191
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 julho 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 - Julho de 2013

Posição consolidada da carteira por tipo de risco	(R\$)	(% do total)
1- Títulos Públicos Federais	248.366.855	44,3%
1.1 - Prefixados (LTN, NTN-F)	2.696.798	0,5%
1.2 - Pós-fixados (LFT - Selic, LTN com DI-1 Selic, Op.Comp.)	245.670.057	43,8%
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)	69.626.918	12,4%
2.1 - CDB	9.935.260	1,8%
2.2 - Let. Financeira	56.272.579	10,0%
2.3 - Debêntures	2.404.004	0,4%
2.4 - DPGE	1.015.076	0,2%
2.5 - N. Promissórias	0	0,0%
3 - Cotas de Fundos (II)	5.548.720	1,0%
4- Tesouraria (III)	698	0,0%
5- Imóveis (IV)	237.588.883	42,3%
Total da Carteira	561.132.074	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 30/06/2013.

Rioprevidência - Julho de 2013

Posição da Carteira em 31/07/2013, 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	323.543.191	0,34%	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		323.543.191	0,34%		
Total do Ativo (III) (Res. 3.922/10)		95.021.983.522			
Imóveis (IV)	Terrenos e Edificações	237.588.883			

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 30/06/2013.

(IV) Refere-se ao valor apurado em 30/06/2013.

(V) Refere-se ao valor do ativo total apurado em 30/06/2013.

Em julho, 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.

Julho 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	REF DI	CAIXA	838.632.665,00	1,99096	1.669,73	9,92%	165,71	0,72	4,25	7,33	0,20
FI Caixa Aliança TP RF	R Fixa	CAIXA	130.514.546,48	2,27991	297,56	0,82%	2,45	0,73	3,87	6,97	0,20
FI Caixa Brasil TP RFLP	R Fixa	CAIXA	783.802.422,13	2,16665	1.698,22	1,31%	22,30	0,70	3,93	7,15	0,20
Itaú Institucional Ref. DI FI	REF DI	B. Itaú	302.022,65	1.693,20	511,38	1,65%	8,43	0,70	4,26	7,35	0,18
ITAÚ Soberano-REF. DI LP	REF DI	B. Itaú	169.914.173,35	26,10325	4.435,31	0,75%	33,30	0,70	4,19	7,19	0,15
Bradesco FI RFDI Premium	REF DI	BRAM-Asset	652.957.558,78	6,48931	4.237,24	0,76%	32,32	0,72	4,28	7,41	0,20
Bradesco FI RFDI Federal Extra	REF DI	BRAM-Asset	506.363.985,45	6,50922	3.296,04	0,39%	12,84	0,70	4,21	7,19	0,15
Santander FIC FI Corporate (*)	REF DI	Sant.-Asset	440.597.625,89	6,68063	2.943,47	0,00%	0,02	0,72	4,34	7,42	0,20
HSBC FI REF. DI LP	REF DI	HSBC	671.079.174,77	16,24335	10.900,57	0,42%	46,15	0,78	4,35	7,49	0,15
TOTAL							323,54				

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

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

No encerramento do mês de julho, as aplicações financeiras em fundos de investimento totalizaram R\$ 323.543.190,67 distribuídos da forma abaixo:

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

