



DIRETORIA DE INVESTIMENTOS

Relatório Mensal de Investimentos

DEZEMBRO

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

Dezembro de 2013	
CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA DO RIOPREVIDÊNCIA	(R\$)
A - Disponível	753.826.531
B - Segmento de Renda Fixa	0
1 - Carteiras Próprias	0
2- Operação Compromissada - Lastro: TPF	0
C - Segmento de Imóveis	268.319.528
1 - Carteiras Próprias	268.319.528
D - Fundos de Investimento	485.507.002
1 - Fundos de Curto Prazo	0
2 - Fundos Referenciados DI	485.507.002
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 dezembro 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 - Dezembro de 2013

Posição consolidada da carteira por tipo de risco	(R\$)	(% do total)
1- Títulos Públicos Federais	333.699.342	44,3%
1.1 - Prefixados (LTN, NTN-F)	2.739.910	0,4%
1.2 - Pós-fixados (LFT - Selic, LTN com DI-1 Selic, Op.Comp.)	330.959.432	43,9%
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)	142.383.682	18,9%
2.1 - CDB	19.754.856	2,6%
2.2 - Let. Financeira	111.200.022	14,8%
2.3 - Debêntures	7.677.400	1,0%
2.4 - DPGE	3.654.129	0,5%
2.5 - Outros Títulos	97.276	0,0%
3 - Cotas de Fundos (II)	9.423.243	1,3%
4- Tesouraria (III)	735	0,0%
5- Imóveis (IV)	268.319.528	35,6%
Total da Carteira	753.826.531	100,0%

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

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

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

(III) Recursos mantidos em Tesouraria nos fundos investidos.

(IV) Refere-se ao valor apurado em 30/11/2013.

Rioprevidência - Dezembro de 2013

Posição da Carteira em 31/12/2013, 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	485.507.002	0,52%	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		485.507.002	0,52%		
Total do Ativo (III) (Res. 3.922/10)		93.416.840.425			
Imóveis (IV)	Terrenos e Edificações	268.319.528			

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

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 e BB Institucional RF que permite a alocação em títulos privados de baixo risco de crédito.

(III) Valor total do Ativo em 30/11/2013.

(IV) Refere-se ao valor apurado em 30/11/2013.

(V) Refere-se ao valor do ativo total apurado em 30/11/2013.

Em dezembro, 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.

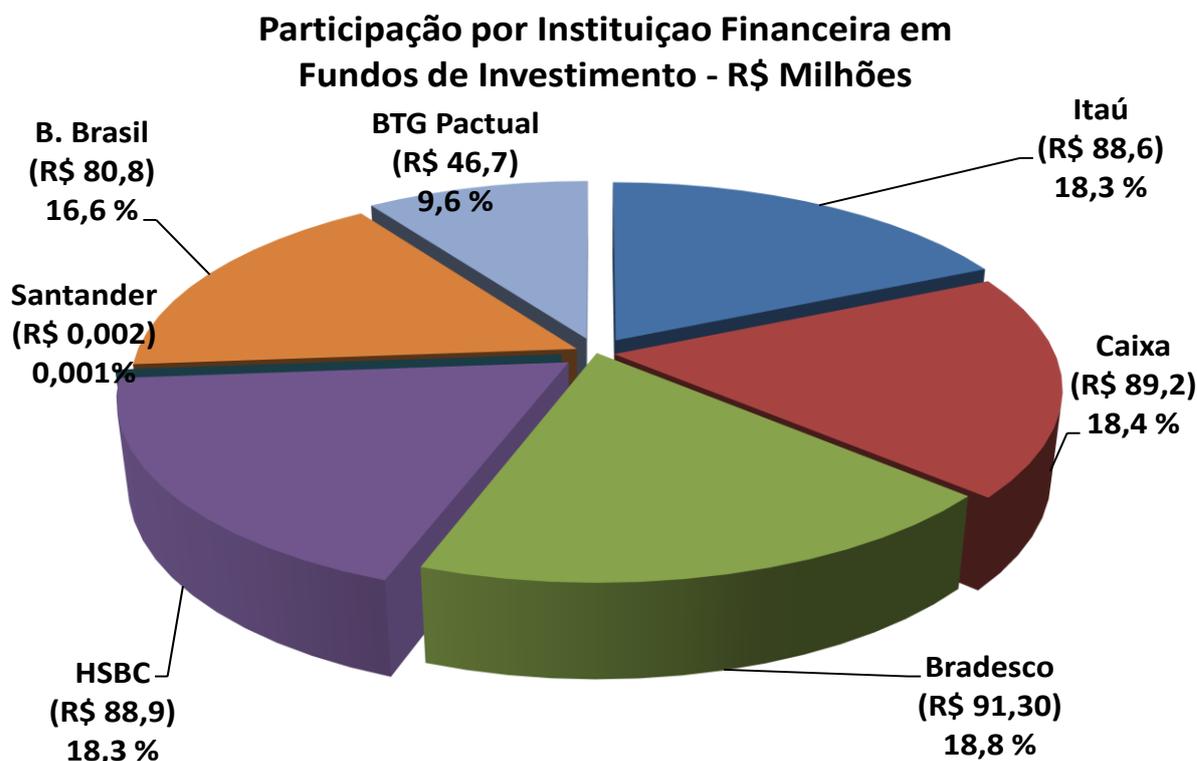
Dezembro de 2013

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	953.971.735,42	2,06470	1.969,66	4,53%	89,19	0,79	8,11	8,11	0,20
Itaú Institucional Ref. DI FI	REF DI	B. Itaú	257.796,22	1.756,87	452,91	12,77%	57,84	0,79	8,18	8,18	0,18
ITAÚ Soberano-REF. DI LP	REF DI	B. Itaú	173.137.635,58	27,06589	4.686,12	0,66%	30,77	0,77	8,03	8,03	0,15
Bradesco FI RF DI Premium	REF DI	BRAM-Asset	690.606.995,70	6,73565	4.651,68	1,62%	75,40	0,79	8,24	8,24	0,20
Bradesco FI RF DI Federal Extra	REF DI	BRAM-Asset	493.246.222,91	6,74899	3.328,91	0,48%	15,90	0,77	8,05	8,05	0,15
BTG Pactual Master Cash DI	REF DI	BTGP. Asset	311.210.250,99	1,73399	539,64	8,66%	46,74	0,77	7,96	7,96	0,20
Santander FIC FI Corporate (*)	REF DI	Sant.-Asset	512.872.930,52	6,93351	3.556,01	0,00%	0,01	0,79	8,28	8,28	0,20
BB Institucional FI Renda Fixa	R Fixa	BBDTVM	219.889.376,74	5,02566	1.105,09	7,31%	80,81	0,79	8,09	8,09	0,20
HSBC FI REF. DI LP	REF DI	HSBC	660.917.313,72	16,86662	11.147,44	0,80%	88,86	0,80	8,35	8,35	0,15
TOTAL							485,51				

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

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

No encerramento do mês de dezembro, as aplicações financeiras em fundos de investimento totalizaram R\$ 485.507.002,41 distribuídos da forma abaixo:



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 janeiro de 2014, na Sede Administrativa, à Rua da Quitanda nº 106 – Centro - Rio de Janeiro, foi aprovada a seguinte proposta:

Fundo Financeiro: A desvalorização do real em relação ao dólar tem levado o COPOM a persistir na estratégia de elevação da taxa de juros de curto prazo. A situação fiscal continua deficiente e o mercado se movimenta no sentido de uma possível redução da classificação de risco soberano, influenciando o mercado de ativos de renda fixa. 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, neste período.