



DIRETORIA DE INVESTIMENTOS

Relatório Mensal de Investimentos

AGOSTO

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 – Assessor de Risco - DIN - mat. 180.313-9

RELATÓRIO MENSAL DE INVESTIMENTOS

Agosto de 2013

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA DO RIOPREVIDÊNCIA	(R\$)
A - Disponível	960.458.601
B - Segmento de Renda Fixa	0
1 - Carteiras Próprias	0
2- Operação Compromissada - Lastro: TPF	0
C - Segmento de Imóveis	252.164.127
1 - Carteiras Próprias	252.164.127
D - Fundos de Investimento	708.294.475
1 - Fundos de Curto Prazo	0
2 - Fundos Referenciados DI	708.294.475
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 agosto 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 - Agosto de 2013

Posição consolidada da carteira por tipo de risco	(R\$)	(% do total)
1- Títulos Públicos Federais	499.355.225	52,0%
1.1 - Prefixados (LTN, NTN-F)	676.171	0,1%
1.2 - Pós-fixados (LFT - Selic, LTN com DI-1 Selic, Op.Comp.)	498.679.055	51,9%
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)	187.421.834	19,5%
2.1 - CDB	25.011.507	2,6%
2.2 - Let. Financeira	153.209.299	16,0%
2.3 - Debêntures	6.490.935	0,7%
2.4 - DPGE	2.710.093	0,3%
2.5 - N. Promissórias	1	0,0%
3 - Cotas de Fundos (II)	21.516.408	2,2%
4- Tesouraria (III)	1.007	0,0%
5- Imóveis (IV)	252.164.127	26,3%
Total da Carteira	960.458.601	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 31/07/2013.

Rioprevidência - Agosto de 2013

Posição da Carteira em 30/08/2013, 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	708.294.475	0,75%	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		708.294.475	0,75%		
Total do Ativo (III) (Res. 3.922/10)		94.656.179.129			
Imóveis (IV)	Terrenos e Edificações	252.164.127			

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 31/07/2013.

(IV) Refere-se ao valor apurado em 31/07/2013.

(V) Refere-se ao valor do ativo total apurado em 31/07/2013.

Em agosto, 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.

Agosto 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
Itaú Institucional Ref. DI FI	REF DI	B. Itaú	363.748,43	1.704,88	620,15	15,38%	95,40	0,69	4,98	7,35	0,18	
ITAÚ Soberano-REF. DI LP	REF DI	B. Itaú	182.323.386,70	26,27828	4.791,14	1,75%	83,76	0,67	4,89	7,20	0,15	
Bradesco FI RF DI Premium	REF DI	BRAM-Asset	618.423.305,97	6,53425	4.040,93	3,87%	156,57	0,69	5,00	7,41	0,20	
Bradesco FI RF DI Federal Extra	REF DI	BRAM-Asset	476.071.661,44	6,55269	3.119,55	0,61%	18,99	0,67	4,90	7,21	0,15	
Santander FIC FI Corporate (*)	REF DI	Sant.-Asset	460.102.464,30	6,72653	3.094,89	0,00%	0,02	0,69	5,05	7,41	0,20	
HSBC FI REF. DI LP	REF DI	HSBC	685.175.165,18	16,35857	11.208,49	1,21%	135,64	0,71	5,09	7,51	0,15	
TOTAL							708,29					

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

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

No encerramento do mês de agosto, as aplicações financeiras em fundos de investimento totalizaram R\$ 708.294.474,68 distribuídos da forma abaixo:

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

