



DIRETORIA DE INVESTIMENTOS

Relatório Mensal de Investimentos

OUTUBRO

**Rio de Janeiro
2012**

Diretoria de Investimentos

Antonio Paulo Vogel de Medeiros – Diretor

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

Outubro de 2012

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA DO RIOPREVIDÊNCIA		(R\$)
A - Disponível		1.009.928.713
B - Segmento de Renda Fixa		45.720.212
1 - Carteiras Próprias		45.720.212
2- Operação Compromissada - Lastro: TPF		0
C - Segmento de Imóveis		194.317.485
1 - Carteiras Próprias		194.317.485
D - Fundos de Investimento		769.891.016
1 - Fundos de Curto Prazo		0
2 - Fundos Referenciados DI		545.186.053
3 - Fundos de Renda Fixa RF IMA		224.704.963
4 - Fundos Multimercado		0
5 - Fundos de Ações		0

A composição das aplicações do RIOPREVIDÊNCIA no encerramento do mês de outubro 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 - Outubro de 2012

Posição consolidada da carteira por tipo de risco	(R\$)	(% do total)
1- Títulos Públicos Federais	560.306.278	55,5%
1.1 - Prefixados (LTN, NTN-F)	213.470.618	21,1%
1.2 - Pós-fixados (LFT - Selic, LTN com DI-1 Selic, Op.Comp.)	301.115.448	29,8%
1.3 - IPCA (NTN-B)	0	0,0%
1.4 - IGP-DI (CFT - Carteira Própria)	45.720.212	4,5%
2- Títulos Privados de Renda Fixa	255.303.456	25,3%
2.1 - Emissores de baixo risco de crédito (I)	224.238.008	22,2%
2.2 - Cotas de Fundos (II)	31.065.447	3,1%
3- Tesouraria (III)	1.495	0,0%
4- Imóveis (IV)	194.317.485	19,2%
Total da Carteira	1.009.928.713	100,0%

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

(I) Valor em Cotas do Fundo Caixa FI Brasil DI, HSBC DI LP, BB Institucional, Santander FIC Corporate, Bradesco Premium, Bradesco IRF-M1 e Itaú Institucional que está alocado em títulos privados de baixo risco de crédito.

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

(III) Recursos mantidos em Tesouraria nos fundos investidos.

(IV) Refere-se ao valor apurado em 30/09/2012.

Rioprevidência - Outubro de 2012

Posição da Carteira em 31/10/2012, 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	<u>45.720.212</u>	<u>0,06%</u>	100,0%	Até 100,0%
Renda Fixa (I)	FI/FIC RF ou Referenciado	<u>224.704.963</u>	<u>0,29%</u>	80,0%	Até 80,0%
Renda Fixa (II)	FI/FIC RF ou Referenciado	<u>545.186.053</u>	<u>0,71%</u>	4,0%	Até 30,0%
Renda Fixa	FI/FIC RF ou Referenciado (Crédito Privado)	<u>0</u>	<u>0,00%</u>	0,0%	Até 5,0%
Renda Fixa	Op. Compromissada com TPF	<u>0</u>	<u>0,00%</u>	2,8%	Até 15,0%
Total Renda Fixa		<u>815.611.228</u>	<u>1,06%</u>		
Total do Ativo (III) (Res. 3.922/10)		<u>77.292.204.145</u>			
Imóveis (IV)	Terrenos e Edificações	<u>194.317.485</u>			

Fonte: RIOPREVIDÊNCIA, B.Brasil, 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, BB Institucional, Santander FIC Corporate, Bradesco Premium, Bradesco IRF-M1 e Itaú Institucional, que permite a alocação em títulos privados de baixo risco de crédito

(III) Valor total do Ativo em 30/09/2012.

(IV) Refere-se ao valor apurado em 30/09/2012.

(V) Refere-se ao valor do ativo total apurado em 30/09/2012.

Em outubro, as aplicações financeiras do RIOPREVIDÊNCIA se concentraram em cotas de Fundos de Investimento Referenciado DI, cujos lastros são predominantemente títulos públicos federais. Uma parcela menor foi aplicada em fundos atrelados ao IRF-M1, que apresentam baixa volatilidade. A estratégia de alocação de recursos segue os critérios estabelecidos na legislação vigente, no Plano Anual de Investimentos e pelo Comitê de Investimentos.

Outubro de 2012

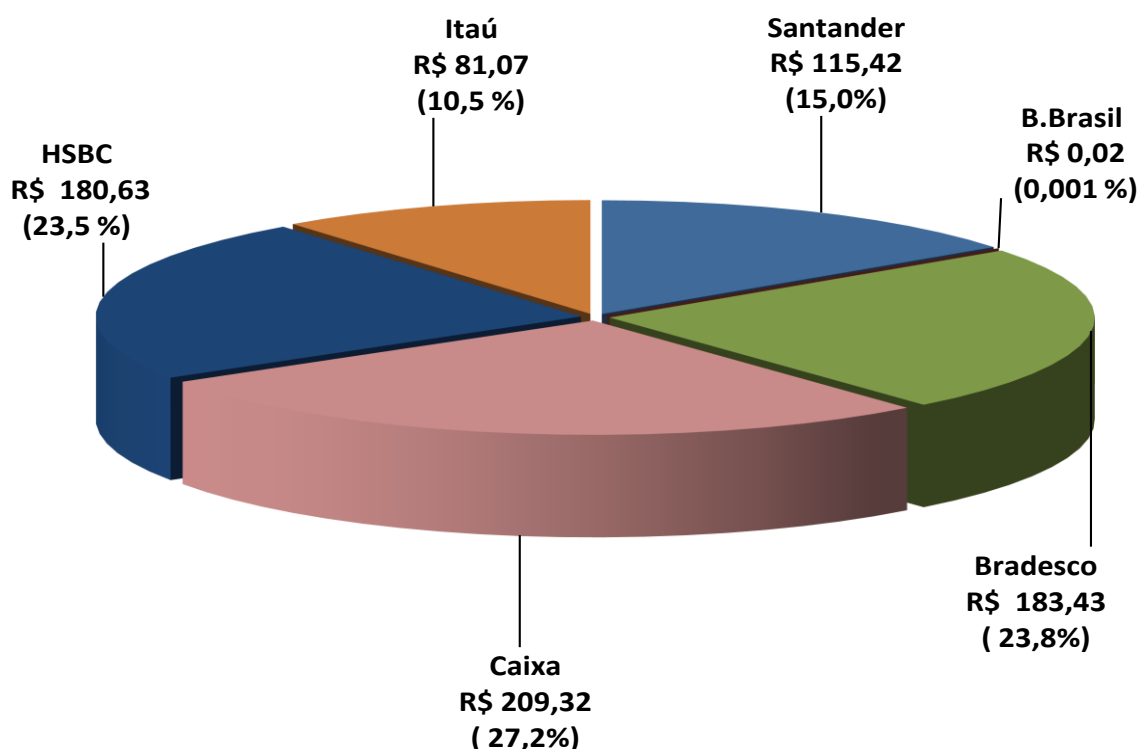
Fundos de Investimento			Participação do RIOPREVIDÊNCIA				Rent. Acum. (%) Tx. Adm.					
Nome do Fundo	Tipo de Fundo	Gestor	Quantidade Total de Cotas	Valor Unitário das Cotas	PL dos Fundos R\$ MM	Part. % no PL dos Fundos	Valor dos Fundos		Mês	Ano	12 M.	(%a.a.)
							R\$ MM	R\$ MM				
FI Brasil REF DI LP	REF DI	CAIXA	152.828.033,35	1,88918	288,72	3,77%	10,90	0,61	7,41	9,36	0,20	
FI Aliança-Renda Fixa	R Fixa	CAIXA	119.487.505,12	2,17136	259,45	17,82%	46,23	0,64	7,65	9,64	0,20	
FI Brasil IRF-M1	R Fixa	CAIXA	1.963.334.428,66	1,29205	2.536,73	6,00%	152,19	0,67	8,19	10,09	0,20	
BB Institucional FI Renda Fixa (*)	R Fixa	BBDTVM	318.995.506,22	4,60008	1.467,40	0,00%	0,02	0,64	7,40	9,31	0,20	
Bradesco FI RF DI Federal Extra	REF DI	BRAM-Asset	505.657.915,43	6,18031	3.125,13	0,10%	2,98	0,60	7,21	9,09	0,15	
Bradesco FI RF DI Premium	REF DI	BRAM-Asset	489.865.229,79	6,15431	3.014,78	3,58%	107,93	0,62	7,45	9,48	0,20	
Bradesco FI RF IRF-M1	R Fixa	BRAM-Asset	512.407.322,37	1,28281	657,32	11,03%	72,51	0,73	8,27	10,16	0,20	
Santander FIC FI Soberano	REF DI	Sant.-Asset	11.768.866,40	14,53353	171,04	2,09%	3,58	0,59	7,19	9,06	0,20	
Santander FIC FI Corporate	REF DI	Sant.-Asset	317.721.303,01	6,33432	2.012,55	5,56%	111,84	0,61	7,42	9,41	0,20	
Itaú Soberano Ref. DI LP FI	REF DI	B. Itaú	162.860.464,13	24,78783	4.036,96	0,03%	1,13	0,60	7,15	9,03	0,15	
Itaú Institucional Ref. DI FI	REF DI	B. Itaú	345.613,52	1,60651	555,23	14,40%	79,94	0,60	7,38	9,30	0,18	
HSBC FI REF. DI LP	REF DI	HSBC	684.663.539,19	15,39829	10.542,65	1,71%	180,63	0,63	7,44	9,42	0,15	
TOTAL							769,89					

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

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

No encerramento do mês de outubro, as aplicações financeiras em fundos de investimento totalizaram R\$ 769.891.016,12 distribuídos da forma abaixo:

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



Carteira Própria

Certificados Financeiros do Tesouro - Posição em Outubro de 2012

Custodiante	Ativo	Código	Data de Emissão	Data de Compra	Data de Vencimento	Quantidade	Indexador	Cupom/ Taxa (%aa)	PU Compra (R\$)	PU Atual (R\$)	Característica do Título	Valor Financeiro (R\$)	
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN_A555	14/12/99	14/12/99	15/11/2012	15.946	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.867,19	Pós-Fixado	45.720.211,74	
												15.946	45.720.211,74