



DIRETORIA DE INVESTIMENTOS

Relatório Mensal de Investimentos

NOVEMBRO

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

Novembro de 2012

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA DO RIOPREVIDÊNCIA		(R\$)
A - Disponível		966.767.940
B - Segmento de Renda Fixa		0
1 - Carteiras Próprias		0
2- Operação Compromissada - Lastro: TPF		0
C - Segmento de Imóveis		194.747.904
1 - Carteiras Próprias		194.747.904
D - Fundos de Investimento		772.020.035
1 - Fundos de Curto Prazo		0
2 - Fundos Referenciados DI		546.101.898
3 - Fundos de Renda Fixa RF IMA		225.918.137
4 - Fundos Multimercado		0
5 - Fundos de Ações		0

A composição das aplicações do RIOPREVIDÊNCIA no encerramento do mês de novembro 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 - Novembro de 2012

Posição consolidada da carteira por tipo de risco	(R\$)	(% do total)
1- Títulos Públicos Federais	525.760.404	54,4%
1.1 - Prefixados (LTN, NTN-F)	213.996.528	22,1%
1.2 - Pós-fixados (LFT - Selic, LTN com DI-1 Selic, Op.Comp.)	311.763.877	32,2%
1.3 - IPCA (NTN-B)	0	0,0%
1.4 - IGP-DI (CFT - Carteira Própria)	0	0,0%
2- Títulos Privados de Renda Fixa	244.845.359	25,3%
2.1 - Emissores de baixo risco de crédito (I)	220.842.775	22,8%
2.2 - Cotas de Fundos (II)	24.002.584	2,5%
3- Tesouraria (III)	1.414.272	0,1%
4- Imóveis (IV)	194.747.904	20,1%
Total da Carteira	966.767.940	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 31/10/2012.

Rioprevidência - Novembro de 2012

Posição da Carteira em 30/11/2012, 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	0	0,00%	100,0%	Até 100,0%
Renda Fixa (I)	FI/FIC RF ou Referenciado	225.918.137	0,29%	80,0%	Até 80,0%
Renda Fixa (II)	FI/FIC RF ou Referenciado	546.101.898	0,71%	4,0%	Até 30,0%
Renda Fixa	FI/FIC RF ou Referenciado (Crédito Privado)	0	0,00%	0,0%	Até 5,0%
Renda Fixa	Op. Compromissada com TPF	0	0,00%	2,8%	Até 15,0%
Total Renda Fixa		772.020.035	1,00%		
Total do Ativo (III) (Res. 3.922/10)		76.865.460.901			
Imóveis (IV)	Terrenos e Edificações	194.747.904			

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 31/10/2012.

(IV) Refere-se ao valor apurado em 31/10/2012.

(V) Refere-se ao valor do ativo total apurado em 31/10/2012.

Em novembro, 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.

Novembro de 2012

Fundos de Investimento		Participação do RIOPREVIDÊNCIA				Rent. Acum. (%) Tx. Adm.				
Nome do Fundo	Tipo de 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	150.048.379,88	1,89938	285,01	0,38%	1,10	0,54	7,99	9,00	0,20
FI Aliança-Renda Fixa	R Fixa CAIXA	103.484.191,82	2,18337	225,94	20,57%	46,49	0,55	8,24	9,20	0,20
FI Brasil IRF-M1	R Fixa CAIXA	1.977.738.218,00	1,29907	2.569,22	5,96%	153,02	0,54	8,77	9,65	0,20
BB Institucional FI Renda Fixa (*)	R Fixa BBTVM	318.154.700,86	4,62519	1.471,53	0,00%	0,02	0,55	7,98	8,97	0,20
Bradesco FI RF DI Premium	REF DI BRAM-Asset	506.237.476,78	6,18872	3.132,96	4,26%	133,51	0,56	8,05	9,11	0,20
Bradesco FI RF IRF-M1	R Fixa BRAM-Asset	529.132.466,99	1,28965	682,40	10,68%	72,90	0,53	8,85	9,70	0,20
Santander FIC FI Corporate	REF DI Sant.-Asset	304.476.479,60	6,36861	1.939,09	5,80%	112,45	0,54	8,00	9,01	0,20
Itaú Institucional Ref. DI FI	REF DI B. Itaú	293.239,61	1,61532	473,68	7,06%	33,42	0,55	7,97	8,96	0,18
Unibanco Institucional DI FI Ref.	R Fixa B. Itaú	267.744,17	1,58239	423,68	16,14%	68,37	0,55	7,88	8,87	0,25
HSBC FI REF. DI LP	REF DI HSBC	671.745.425,36	15,48279	10.400,50	1,45%	150,74	0,55	8,03	9,05	0,15
TOTAL						772,02				

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

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

No encerramento do mês de novembro, as aplicações financeiras em fundos de investimento totalizaram R\$ 772.020.035,41 distribuídos da forma abaixo:

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

