



---

# **DIRETORIA DE INVESTIMENTOS**

## **Relatório Mensal de Investimentos**

### **JULHO**

**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](http://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 2012

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA DO RIOPREVIDÊNCIA		(R\$)
<b>A - Disponível</b>		<b>787.019.006</b>
<b>B - Segmento de Renda Fixa</b>		<b>236.293.306</b>
1 - Carteiras Próprias		236.293.306
2- Operação Compromissada - Lastro: TPF		0
<b>C - Segmento de Imóveis</b>		<b>195.237.157</b>
1 - Carteiras Próprias		195.237.157
<b>D - Fundos de Investimento</b>		<b>355.488.543</b>
1 - Fundos de Curto Prazo		0
2 - Fundos Referenciados DI		281.410.192
3 - Fundos de Renda Fixa RF IMA		74.078.352
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 2012

Posição consolidada da carteira por tipo de risco	(R\$)	(% do total)
<b>1- Títulos Públicos Federais</b>	<b>461.379.066</b>	<b>58,6%</b>
1.1 - Prefixados (LTN, NTN-F)	74.146.640	9,4%
1.2 - Pós-fixados (LFT - Selic, LTN com DI-1 Selic, Op.Comp.)	150.939.120	19,2%
1.3 - IPCA (NTN-B)	0	0,0%
1.4 - IGP-DI (CFT - Carteira Própria)	236.293.306	30,0%
<b>2- Títulos Privados de Renda Fixa</b>	<b>130.398.424</b>	<b>16,6%</b>
2.1 - Emissores de baixo risco de crédito (I)	112.700.256	14,3%
2.2 - Cotas de Fundos (II)	17.698.168	2,2%
<b>3- Tesouraria (III)</b>	<b>4.359</b>	<b>0,0%</b>
<b>4- Imóveis (IV)</b>	<b>195.237.157</b>	<b>24,8%</b>
<b>Total da Carteira</b>	<b>787.019.006</b>	<b>100,0%</b>

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

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

(II) Valor em Cotas dos Fundos: HSBC DI LP, Bradesco Premium, Bradesco IRF-M1, BB Institucional e Santander FIC Corporate, investido em outros fundos.

(III) Recursos mantidos em Tesouraria nos fundos investidos.

(IV) Refere-se ao valor apurado em 31/06/2012.

Rioprevidência - Julho de 2012

Posição da Carteira em 31/07/2012, 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>236.293.306</u>	<u>0,30%</u>	100,0%	Até 100,0%
Renda Fixa (I)	FI/FIC RF ou Referenciado	<u>74.078.352</u>	<u>0,09%</u>	80,0%	Até 80,0%
Renda Fixa (II)	FI/FIC RF ou Referenciado	<u>281.410.192</u>	<u>0,35%</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%
<b>Total Renda Fixa</b>		<b><u>591.781.849</u></b>	<b><u>0,74%</u></b>		
<b>Total do Ativo (III) (Res. 3.922/10)</b>		<b><u>79.494.085.027</u></b>			
<b>Imóveis (IV)</b>	<b>Terrenos e Edificações</b>	<b><u>195.237.157</u></b>			

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

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 e Bradesco IRF-M1, que permite a alocação em títulos privados de baixo risco de crédito

(III) Valor total do Ativo em 30/06/2012.

(IV) Refere-se ao valor apurado em 30/06/2012.

(V) Refere-se ao valor do ativo total apurado em 30/06/2012 .

Em julho, 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.

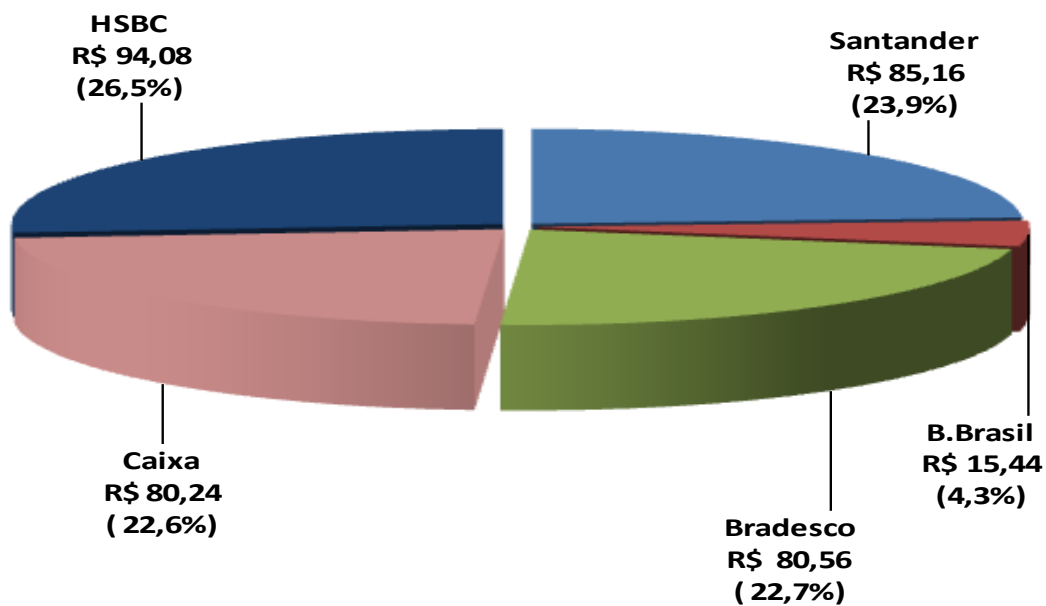
Julho de 2012

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 R\$ MM	Mês	Ano	12 Meses	(% a.a.)
FI Aliança-Renda Fixa	R Fixa	CAIXA	168.714.450,25	2,13139	359,60	4,31%	15,48	0,64	5,67	11,11	0,20
FI Brasil IRF-M1	R Fixa	CAIXA	1.796.380.804,72	1,26828	2.278,32	2,32%	52,78	0,73	6,20	12,03	0,20
BB Institucional FI Renda Fixa	R Fixa	BBDTVM	343.928.973,01	4,51490	1.552,81	0,29%	4,51	0,65	5,41	10,45	0,20
BB Previd. RF IRF-M1 T.Pub.	R Fixa	BBDTVM	2.042.057.340,57	1,33385	2.723,81	0,40%	10,93	0,71	6,15	11,96	0,30
Bradesco FI RF DI Federal Extra	REF DI	BRAM-Asset	559.832.547,03	6,07257	3.399,62	0,13%	4,51	0,59	5,34	10,29	0,15
Bradesco FI RF DI Premium	REF DI	BRAM-Asset	497.679.544,41	6,04186	3.006,91	2,18%	65,68	0,66	5,49	10,70	0,20
Bradesco FI RF IRF-M1	R Fixa	BRAM-Asset	570.960.918,60	1,25864	718,63	1,44%	10,36	0,67	6,23	12,07	0,20
Santander FIC FI Soberano	REF DI	Sant.-Asset	12.998.785,80	14,28160	185,64	2,11%	3,92	0,61	5,33	10,25	0,20
Santander FIC FI Corporate	REF DI	Sant.-Asset	306.060.613,78	6,21892	1.903,37	4,27%	81,24	0,67	5,46	10,63	0,20
HSBC FI REF. DI LP	REF DI	HSBC	687.188.168,37	15,11161	10.384,52	0,91%	94,08	0,67	5,44	10,64	0,15
<b>TOTAL</b>							<b>355,48</b>				

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

No encerramento do mês de julho, as aplicações financeiras em fundos de investimento totalizaram R\$ 355.488.543,20 distribuídos da forma abaixo:

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



### Carteira Própria Certificados Financeiros do Tesouro - Posição em Julho 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_A552	14/12/99	14/12/99	15/8/2012	23.181	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.764,02	Pós-Fixado	64.072.747,62
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN_A553	14/12/99	14/12/99	15/9/2012	23.181	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.764,02	Pós-Fixado	64.072.747,62
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN_A554	14/12/99	14/12/99	15/10/2012	23.181	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.764,02	Pós-Fixado	64.072.747,62
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	2.764,02	Pós-Fixado	44.075.062,92
						<b>85.489</b>						<b>236.293.305,78</b>