



DIRETORIA DE INVESTIMENTOS

Relatório Mensal de Investimentos

DEZEMBRO

**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

Dezembro de 2012

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA DO RIOPREVIDÊNCIA		(R\$)
A - Disponível		479.564.999
B - Segmento de Renda Fixa		0
1 - Carteiras Próprias		0
2- Operação Compromissada - Lastro: TPF		0
C - Segmento de Imóveis		193.811.913
1 - Carteiras Próprias		193.811.913
D - Fundos de Investimento		285.753.087
1 - Fundos de Curto Prazo		0
2 - Fundos Referenciados DI		217.950.233
3 - Fundos de Renda Fixa RF IMA		67.802.853
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 2012

Posição consolidada da carteira por tipo de risco	(R\$)	(% do total)
1- Títulos Públicos Federais	193.571.845	40,4%
1.1 - Prefixados (LTN, NTN-F)	64.319.827	13,4%
1.2 - Pós-fixados (LFT - Selic, LTN com DI-1 Selic, Op.Comp.)	129.252.018	27,0%
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)	84.151.319	17,5%
2.1 - CDB	22.330.556	4,7%
2.2 - Let. Financeira	49.365.635	10,3%
2.3 - Debêntures	11.678.993	2,4%
2.4 - DPGE	776.134	0,2%
3 - Cotas de Fundos (II)	8.029.378	1,7%
4- Tesouraria (III)	544	0,0%
5- Imóveis (IV)	193.811.913	40,4%
Total da Carteira	479.564.999	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 30/11/2012.

Rioprevidência - Dezembro de 2012

Posição da Carteira em 31/12/2012, 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	67.802.853	0,09%	80,0%	Até 80,0%
Renda Fixa (II)	FI/FIC RF ou Referenciado	217.950.233	0,28%	4,0%	Até 30,0%
Renda Fixa	FI/FIC RF ou Ref. (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		285.753.087	0,37%		
Total do Ativo (III) (Res. 3.922/10)		76.738.177.220			
Imóveis (IV)	Terrenos e Edificações	193.811.913			

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 30/11/2012.

(IV) Refere-se ao valor apurado em 30/11/2012.

(V) Refere-se ao valor do ativo total apurado em 30/11/2012.

Em dezembro, 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.

Dezembro 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 M.	(% a.a.)
FI Aliança-Renda Fixa	R Fixa	CAIXA	87.810.764,63	2,19501	192,75	16,46%	31,72	0,53	8,82	8,82	0,20
FI Brasil IRF-M1	R Fixa	CAIXA	1.834.331.992,00	1,30607	2.395,76	1,62%	38,71	0,54	9,36	9,36	0,20
BB Institucional FI Renda Fixa (*)	R Fixa	BBDTVM	315.726.155,34	4,64964	1.468,01	0,00%	0,02	0,53	8,55	8,55	0,20
Bradesco FI RFDI Premium	REF DI	BRAM-Asset	426.498.157,66	6,22291	2.654,06	1,76%	46,80	0,55	8,65	8,65	0,20
Bradesco FI RF IRF-M1	R Fixa	BRAM-Asset	491.042.937,49	1,29666	636,72	4,57%	29,10	0,54	9,44	9,44	0,20
Santander FIC FI Corporate	REF DI	Sant.-Asset	286.544.882,21	6,40303	1.834,76	2,21%	40,49	0,54	8,58	8,58	0,20
Itaú Institucional Ref. DI FI	REF DI	B. Itaú	270.648,97	1.624,09	439,56	9,00%	39,58	0,54	8,55	8,55	0,18
Unibanco Institucional DI FI Ref.	R Fixa	B. Itaú	224.002,38	1.590,84	356,35	1,54%	5,49	0,53	8,46	8,46	0,25
HSBC FI REF. DI LP	REF DI	HSBC	660.840.397,44	15,56660	10.287,04	0,51%	52,76	0,54	8,61	8,61	0,15
TOTAL							285,75				

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

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

No encerramento do mês de dezembro, as aplicações financeiras em fundos de investimento totalizaram R\$ 285.753.086,69 distribuídos da forma abaixo:

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

