



---

# **DIRETORIA DE INVESTIMENTOS**

## **Relatório Mensal de Investimentos**

**ABRIL**

**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

Abril de 2012

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA DO RIOPREVIDÊNCIA		(R\$)
<b>A - Disponível</b>		<b>927.990.948</b>
<b>B - Segmento de Renda Fixa</b>		<b>417.493.424</b>
1 - Carteiras Próprias		417.493.424
2 - Operação Compromissada - Lastro: TPF		0
<b>C - Segmento de Imóveis</b>		<b>198.526.209</b>
1 - Carteiras Próprias		198.526.209
<b>D - Fundos de Investimento</b>		<b>311.971.314</b>
1 - Fundos de Curto Prazo		0
2 - Fundos Referenciados DI		311.971.314
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 abril 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 - Abril de 2012

Posição consolidada da carteira por tipo de risco	(R\$)	(% do total)
<b>1- Títulos Públicos Federais</b>	<b>668.532.966</b>	<b>72,0%</b>
1.1 - Prefixados (LTN, NTN-F)	4.226.002	0,5%
1.2 - Pós-fixados (LFT - Selic, LTN com DI-1 Selic, Op.Comp.)	244.893.017	26,4%
1.3 - IPCA (NTN-B)	1.920.522	0,2%
1.4 - IGP-DI (CFT - Carteira Própria)	417.493.424	45,0%
<b>2- Títulos Privados de Renda Fixa</b>	<b>60.883.999</b>	<b>6,6%</b>
2.1 - Emissores de baixo risco de crédito (I)	55.557.174	6,0%
2.2 - Cotas de Fundos (II)	5.326.825	0,6%
<b>3- Tesouraria (III)</b>	<b>47.774</b>	<b>0,0%</b>
<b>4- Imóveis (IV)</b>	<b>198.526.209</b>	<b>21,4%</b>
<b>Total da Carteira</b>	<b>927.990.948</b>	<b>100,0%</b>

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

(I) Valor em Cotas do Fundo Caixa FI Brasil DI, BB RPPS Perfil, HSBC DI LP e BB Institucional que está alocado em títulos privados de baixo risco de crédito.

(II) Valor em Cotas do Fundo BB Perfil investido no Fundo BB TOP Tradicional e no BB Top Arrojado, do Fundo HSBC DI LP, investido no HSBC DI CASH I e CASH II, e do Santander FIC Soberano DI investido no Santander FI Tit. Públicos DI.

(III) Recursos mantidos em Tesouraria nos Fundos: BB RPPS Perfil, Caixa Brasil DI, Caixa Aliança RF, HSBC DI LP, Bradesco Federal Extra, BB Institucional e Santander FIC Soberano DI.

(IV) Refere-se ao valor apurado em 31/03/2012.

Rioprevidência - Abril de 2012

**Posição da Carteira em 30/04/2012, 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>417.493.424</u>	<u>0,51%</u>	100,0%	Até 100,0%
Renda Fixa (I)	FI/FIC RF ou Referenciado	<u>0</u>	<u>0,00%</u>	80,0%	Até 80,0%
Renda Fixa (II)	FI/FIC RF ou Referenciado	<u>311.971.314</u>	<u>0,38%</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>729.464.739</u></b>	<b><u>0,89%</u></b>		
<b>Total do Ativo (III) (Res. 3.922/10)</b>		<b><u>82.276.451.552</u></b>			
<b>Imóveis (IV)</b>	<b>Terrenos e Edificações</b>	<b><u>198.526.209</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, BB RPPS Perfil, BB Institucional e HSBC DI LP que permite a alocação em títulos privados de baixo risco de crédito.

(III) Valor total do Ativo em 31/03/2012.

(IV) Refere-se ao valor apurado em 31/03/2012.

(V) Refere-se ao valor do ativo total apurado em 31/03/2012.

Em abril, 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.

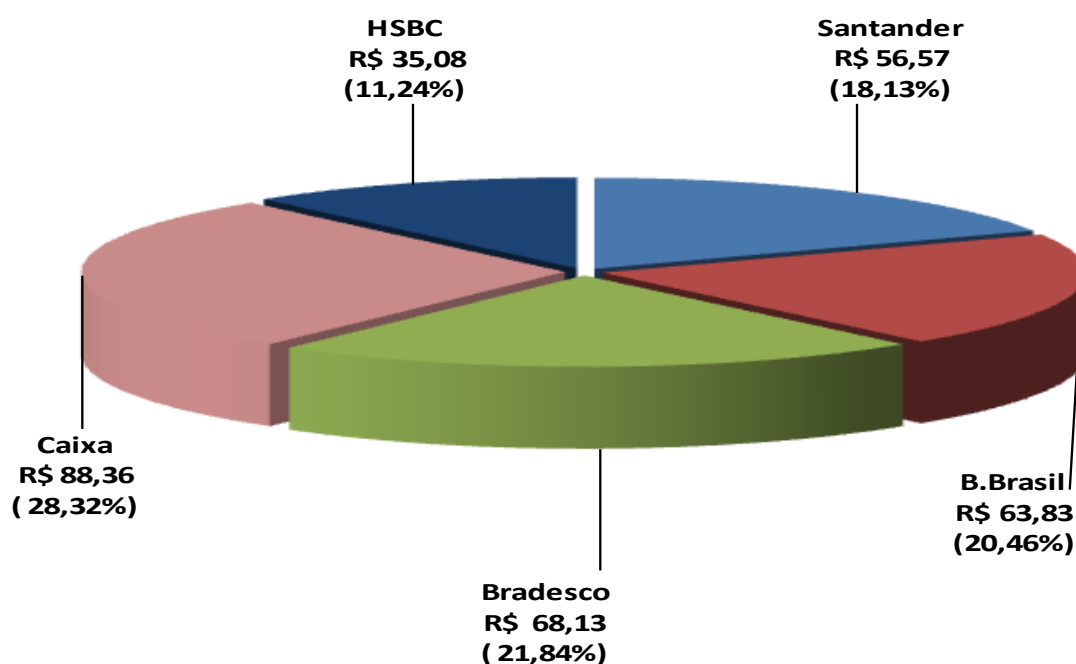
Abril de 2012

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	Tx. Adm. (% a.a.)
FI Aliança-Renda Fixa	R Fixa	CAIXA	185.224.493,72	2,08693	386,55	12,71%	49,14	0,84	3,46	11,93	0,20
BB RPPS Perfil FIC de FI	R Fixa	BBDTVM	78.356.376,99	1,11500	87,37	11,97%	10,45	0,75	3,34	11,45	0,20
BB Institucional FI Renda Fixa	R Fixa	BBDTVM	385.288.393,58	4,42414	1.704,57	3,13%	53,37	0,73	3,29	11,42	0,20
FI RF DI Federal Extra	REF DI	BRAM-Asset	492.471.949,21	5,95681	2.933,56	2,32%	68,13	0,75	3,33	11,32	0,15
Santander FIC FI Soberano	REF DI	Sant.-Asset	17.948.255,19	14,00655	251,39	22,50%	56,57	0,73	3,30	11,24	0,20
HSBC FI REF. DI LP	REF DI	HSBC	702.306.778,12	14,79748	10.392,37	0,34%	35,08	0,71	3,25	11,61	0,15
<b>TOTAL</b>							<b>311,97</b>				

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

No encerramento do mês de abril, as aplicações financeiras em fundos de investimento totalizaram R\$ 311.971.314,25 distribuídos da forma abaixo:

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



### Carteira Própria - Certificados Financeiros do Tesouro - Posição em Abril 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_A549	14/12/99	14/12/99	15/5/2012	23.181	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.692,95	Pós-Fixado	62.425.273,95
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN_A550	14/12/99	14/12/99	15/6/2012	23.181	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.692,95	Pós-Fixado	62.425.273,95
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN_A551	14/12/99	14/12/99	15/7/2012	23.181	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.692,95	Pós-Fixado	62.425.273,95
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	2.692,95	Pós-Fixado	62.425.273,95
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	2.692,95	Pós-Fixado	62.425.273,95
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	2.692,95	Pós-Fixado	62.425.273,95
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	2.692,95	Pós-Fixado	42.941.780,70
<b>155.032</b>												<b>417.493.424,40</b>