



DIRETORIA DE INVESTIMENTOS

Relatório Mensal de Investimentos

MARÇO

Rio de Janeiro

2013

Diretoria de Investimentos

Gustavo de Oliveira Barbosa – Diretor Presidente

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

Março de 2013

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA DO RIOPREVIDÊNCIA		(R\$)
A - Disponível		266.753.178
B - Segmento de Renda Fixa		0
1 - Carteiras Próprias		0
2- Operação Compromissada - Lastro: TPF		0
C - Segmento de Imóveis		228.493.408
1 - Carteiras Próprias		228.493.408
D - Fundos de Investimento		38.259.770
1 - Fundos de Curto Prazo		0
2 - Fundos Referenciados DI		38.259.770
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 março 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 - Março de 2013

Posição consolidada da carteira por tipo de risco	(R\$)	(% do total)
1- Títulos Públicos Federais	25.677.727	9,6%
1.1 - Prefixados (LTN, NTN-F)	43.955	0,0%
1.2 - Pós-fixados (LFT - Selic, LTN com DI-1 Selic, Op.Comp.)	25.633.772	9,6%
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)	11.476.062	4,3%
2.1 - CDB	2.992.927	1,1%
2.2 - Let. Financeira	7.114.355	2,7%
2.3 - Debêntures	1.251.642	0,5%
2.4 - DPGE	105.422	0,0%
2.5 - N. Promissórias	11.717	0,0%
3 - Cotas de Fundos (II)	1.105.881	0,4%
4- Tesouraria (III)	100	0,0%
5- Imóveis (IV)	228.493.408	85,7%
Total da Carteira	266.753.178	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, 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 28/02/2013.

Rioprevidência - Março de 2013

Posição da Carteira em 28/03/2013, 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	0	0,00%	80,0%	Até 80,0%
Renda Fixa (II)	FI/FIC RF ou Referenciado	38.259.770	0,04%	4,0%	Até 30,0%
Renda Fixa	FI/FIC RF ou Ref. (Crédito Privado)	0	0,00%	1,5%	Até 5,0%
Renda Fixa	Op. Compromissada com TPF	0	0,00%	2,8%	Até 15,0%
Total Renda Fixa		38.259.770	0,04%		
Total do Ativo (III) (Res. 3.922/10)		97.506.275.132			
Imóveis (IV)	Terrenos e Edificações	228.493.408			

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 DI, que permite a alocação em títulos privados de baixo risco de crédito.

(III) Valor total do Ativo em 28/02/2013.

(IV) Refere-se ao valor apurado em 28/02/2013.

(V) Refere-se ao valor do ativo total apurado em 28/02/2013.

Em março, 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.

Março de 2013

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 Brasil REF DI LP	REF DI	CAIXA	242.978.482,19	1,94163	471,77	1,42%	6,71	0,56	1,67	7,59	0,20
ITAÚ Soberano-REF. DI LP	R Fixa	ITAÚ	171.376.655,21	25,46209	4.363,61	0,19%	8,50	0,55	1,63	7,39	0,15
BB Institucional FI Renda Fixa (*)	R Fixa	BBDTVM	391.974.864,05	4,72636	1.852,61	0,00%	0,02	0,55	1,65	7,70	0,20
Bradesco FI RF DI Premium	REF DI	BRAM-Asset	490.380.597,93	6,32667	3.102,48	0,50%	15,42	0,56	1,67	7,66	0,20
Santander FIC FI Corporate (*)	REF DI	Sant.-Asset	287.877.547,29	6,50900	1.873,80	0,00%	0,02	0,55	1,66	7,65	0,20
HSBC FI REF. DI LP	REF DI	HSBC	650.237.506,80	15,82681	10.291,19	0,07%	7,59	0,57	1,67	7,72	0,15
TOTAL							38,26				

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

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

No encerramento do mês de março, as aplicações financeiras em fundos de investimento totalizaram R\$ 38.259.770,44 distribuídos da forma abaixo:

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

