



---

# **DIRETORIA DE INVESTIMENTOS**

## **Relatório Mensal de Investimentos**

**JANEIRO**

Rio de Janeiro

2013

## **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

Janeiro de 2013

| CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA DO RIOPREVIDÊNCIA |  | (R\$)              |
|--|--|--------------------|
| <b>A - Disponível</b>                      |  | <b>385.358.351</b> |
| <b>B - Segmento de Renda Fixa</b>          |  | <b>0</b>           |
| 1 - Carteiras Próprias                     |  | 0                  |
| 2- Operação Compromissada - Lastro: TPF    |  | 0                  |
| <b>C - Segmento de Imóveis</b>             |  | <b>228.493.408</b> |
| 1 - Carteiras Próprias                     |  | 228.493.408        |
| <b>D - Fundos de Investimento</b>          |  | <b>156.864.943</b> |
| 1 - Fundos de Curto Prazo                  |  | 0                  |
| 2 - Fundos Referenciados DI                |  | 141.765.053        |
| 3 - Fundos de Renda Fixa RF IMA            |  | 15.099.890         |
| 4 - Fundos Multimercado                    |  | 0                  |
| 5 - Fundos de Ações                        |  | 0                  |

A composição das aplicações do RIOPREVIDÊNCIA no encerramento do mês de janeiro 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 - Janeiro de 2013

| Posição consolidada da carteira por tipo de risco             | (R\$)              | (% do total)  |
|---|--------------------|---------------|
| <b>1- Títulos Públicos Federais</b>                           | <b>98.507.711</b>  | <b>25,6%</b>  |
| 1.1 - Prefixados (LTN, NTN-F)                                 | 13.816.784         | 3,6%          |
| 1.2 - Pós-fixados (LFT - Selic, LTN com DI-1 Selic, Op.Comp.) | 84.690.928         | 22,0%         |
| 1.3 - IPCA (NTN-B)  | 0                  | 0,0%          |
| 1.4 - IGP-DI (CFT - Carteira Própria)                         | 0                  | 0,0%          |
| <b>2- Títulos Privados de Baixo Risco de Crédito (I)</b>      | <b>55.223.812</b>  | <b>14,3%</b>  |
| 2.1 - CDB   | 13.603.444         | 3,5%          |
| 2.2 - Let. Financeira   | 33.457.688         | 8,7%          |
| 2.3 - Debêntures  | 7.616.439          | 2,0%          |
| 2.4 - DPGE  | 546.241            | 0,1%          |
| <b>3 - Cotas de Fundos (II)</b>                               | <b>3.132.690</b>   | <b>0,8%</b>   |
| <b>4- Tesouraria (III)</b>                                    | <b>729</b>         | <b>0,0%</b>   |
| <b>5- Imóveis (IV)</b>  | <b>228.493.408</b> | <b>59,3%</b>  |
| <b>Total da Carteira</b>                                      | <b>385.358.351</b> | <b>100,0%</b> |

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 31/12/2012.

Rioprevidência - Janeiro de 2013

Posição da Carteira em 31/01/2013, 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           | 15.099.890            | 0,02%        | 80,0%                 | Até 80,0%                  |
| Renda Fixa (II)                             | FI/FIC RF ou Referenciado           | 141.765.053           | 0,15%        | 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%                  |
| <b>Total Renda Fixa</b>                     |                                     | <b>156.864.943</b>    | <b>0,16%</b> |                       |                            |
| <b>Total do Ativo (III) (Res. 3.922/10)</b> |                                     | <b>97.737.275.448</b> |              |                       |                            |
| <b>Imóveis (IV)</b>                         | <b>Terrenos e Edificações</b>       | <b>228.493.408</b>    |              |                       |                            |

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 31/12/2012.

(IV) Refere-se ao valor apurado em 31/12/2012.

(V) Refere-se ao valor do ativo total apurado em 31/12/2012.

Em janeiro, 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.

Janeiro 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                | REFDI         | CAIXA       | 173.559.810,25                 | 1,92141                  | 333,48               | 16,50%                   | 55,04                    | 0,61 | 0,61  | 8,26     | 0,20 |
| FI Aliança-Renda Fixa              | R Fixa        | CAIXA       | 96.539.487,02                  | 2,20559                  | 212,93               | 1,70%                    | 3,62                     | 0,48 | 0,48  | 8,34     | 0,20 |
| FI Brasil IRF-M1                   | R Fixa        | CAIXA       | 1.600.940.206,00               | 1,31326                  | 2.102,45             | 0,28%                    | 5,87                     | 0,55 | 0,55  | 8,78     | 0,20 |
| BB Institucional FI Renda Fixa (*) | R Fixa        | BBDTVM      | 352.170.474,18                 | 4,67773                  | 1.647,36             | 0,00%                    | 0,02                     | 0,60 | 0,60  | 8,24     | 0,20 |
| Bradesco FI RFDI Premium           | REFDI         | BRAM-Asset  | 411.670.977,39                 | 6,26038                  | 2.577,22             | 2,01%                    | 51,92                    | 0,60 | 0,60  | 8,33     | 0,20 |
| Bradesco FI RFIRF-M1               | R Fixa        | BRAM-Asset  | 464.638.707,67                 | 1,30385                  | 605,82               | 1,52%                    | 9,23                     | 0,55 | 0,55  | 8,85     | 0,20 |
| Santander FIC FI Corporate         | REFDI         | Sant.-Asset | 281.224.659,10                 | 6,44155                  | 1.811,52             | 0,00%                    | 0,71                     | 0,60 | 0,60  | 8,26     | 0,20 |
| Itaú Institucional Ref. DI FI      | REFDI         | B. Itaú     | 274.828,80                     | 1.633,74                 | 449,00               | 2,82%                    | 12,67                    | 0,59 | 0,59  | 8,22     | 0,18 |
| HSBC FI REF. DI LP                 | REFDI         | HSBC        | 644.021.423,92                 | 15,66017                 | 10.085,49            | 0,18%                    | 17,79                    | 0,60 | 0,60  | 8,28     | 0,15 |
| <b>TOTAL</b>                       |               |             |                                |                          |                      |                          | <b>156,86</b>            |      |       |          |      |

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

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

No encerramento do mês de janeiro, as aplicações financeiras em fundos de investimento totalizaram R\$ 156.864.942,66 distribuídos da forma abaixo:

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

