



---

# **DIRETORIA DE INVESTIMENTOS**

## **Relatório Mensal de Investimentos**

**FEVEREIRO**

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](http://www.rioprevidencia.rj.gov.br)

Elaborado por : Carlos Augusto B. Fernandes – Assessor de Risco - DIN - mat. 180.313-9

## RELATÓRIO MENSAL DE INVESTIMENTOS

Fevereiro de 2013

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA DO RIOPREVIDÊNCIA		(R\$)
<b>A - Disponível</b>		<b>286.956.778</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>58.463.370</b>
1 - Fundos de Curto Prazo		0
2 - Fundos Referenciados DI		58.463.370
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 fevereiro 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 - Fevereiro de 2013

Posição consolidada da carteira por tipo de risco	(R\$)	(% do total)
<b>1- Títulos Públicos Federais</b>	<b>32.454.017</b>	<b>11,3%</b>
1.1 - Prefixados (LTN, NTN-F)	20.653	0,0%
1.2 - Pós-fixados (LFT - Selic, LTN com DI-1 Selic, Op.Comp.)	32.433.363	11,3%
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>23.489.527</b>	<b>8,2%</b>
2.1 - CDB	6.870.042	2,4%
2.2 - Let. Financeira	14.146.728	4,9%
2.3 - Debêntures	2.232.990	0,8%
2.4 - DPGE	239.767	0,1%
<b>3 - Cotas de Fundos (II)</b>	<b>2.519.635</b>	<b>0,9%</b>
<b>4- Tesouraria (III)</b>	<b>191</b>	<b>0,0%</b>
<b>5- Imóveis (IV)</b>	<b>228.493.408</b>	<b>79,6%</b>
<b>Total da Carteira</b>	<b>286.956.778</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, 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 - Fevereiro de 2013

Posição da Carteira em 28/02/2013, 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	58.463.370	0,06%	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>58.463.370</b>	<b>0,06%</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 DI, 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 fevereiro, 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.

Fevereiro 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	197.209.468,60	1,93089	380,79	5,29%	20,13	0,49	1,11	7,98	0,20
FI Aliança-Renda Fixa	R Fixa	CAIXA	91.943.007,00	2,21505	203,66	0,07%	0,14	0,43	0,91	7,96	0,20
BB Institucional FI Renda Fixa (*)	R Fixa	BBDTVM	349.476.018,74	4,70042	1.642,68	0,00%	0,02	0,49	1,09	8,00	0,20
Bradesco FI RFDI Premium	REF DI	BRAM-Asset	430.356.640,76	6,29172	2.707,68	0,78%	21,23	0,50	1,11	8,05	0,20
Santander FIC FI Corporate	REF DI	Sant.-Asset	282.500.210,64	6,47326	1.828,70	0,00%	0,02	0,49	1,10	7,97	0,20
HSBC FI REF. DI LP	REF DI	HSBC	661.591.757,07	15,73773	10.411,95	0,16%	16,93	0,50	1,10	7,99	0,15
<b>TOTAL</b>							<b>58,46</b>				

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

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

No encerramento do mês de fevereiro, as aplicações financeiras em fundos de investimento totalizaram R\$ 58.463.369,74 distribuídos da forma abaixo:

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

