



DIRETORIA DE INVESTIMENTOS

Relatório Mensal de Investimentos

ABRIL

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

Abril de 2013

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA DO RIOPREVIDÊNCIA		(R\$)
A - Disponível		679.639.165
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		451.145.757
1 - Fundos de Curto Prazo		0
2 - Fundos Referenciados DI		451.063.397
3 - Fundos de Renda Fixa RF IMA		82.360
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 2013

Posição consolidada da carteira por tipo de risco	(R\$)	(% do total)
1- Títulos Públicos Federais	410.127.339	60,3%
1.1 - Prefixados (LTN, NTN-F)	764.346	0,1%
1.2 - Pós-fixados (LFT - Selic, LTN com DI-1 Selic, Op.Comp.)	409.362.993	60,2%
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)	40.634.662	6,0%
2.1 - CDB	9.777.676	1,4%
2.2 - Let. Financeira	27.130.539	4,0%
2.3 - Debêntures	3.471.047	0,5%
2.4 - DPGE	212.292	0,0%
2.5 - N. Promissórias	43.108	0,0%
3 - Cotas de Fundos (II)	382.312	0,1%
4- Tesouraria (III)	1.444	0,0%
5- Imóveis (IV)	228.493.408	33,6%
Total da Carteira	679.639.165	100,0%

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

(I) Valor em Cotas do Fundo Caixa FI Brasil DI, HSBC DI LP, 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 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 31/03/2013.

Rioprevidência - Abril de 2013

Posição da Carteira em 30/04/2013, 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	82.360	0,00%	80,0%	Até 80,0%
Renda Fixa (II)	FI/FIC RF ou Referenciado	451.063.397	0,47%	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		451.145.757	0,47%		
Total do Ativo (III) (Res. 3.922/10)		96.636.879.996			
Imóveis (IV)	Terrenos e Edificações	228.493.408			

Fonte: RIOPREVIDÊNCIA, 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, Santander FIC Corporate DI e Bradesco Premium DI, que permite a alocação em títulos privados de baixo risco de crédito.

(III) Valor total do Ativo em 31/03/2013.

(IV) Refere-se ao valor apurado em 31/03/2013.

(V) Refere-se ao valor do ativo total apurado em 31/03/2013.

Em abril, 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.

Abril 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	464.770.791,35	1,95346	907,91	18,78%	170,52	0,61	2,29	7,44	0,20
FI Caixa Aliança TP RF	R Fixa	CAIXA	146.576.016,86	2,23941	328,24	18,30%	60,06	0,60	2,02	7,31	0,20
FI Caixa Brasil TP RF LP	R Fixa	CAIXA	824.237.146,29	2,12808	1.754,04	9,93%	174,12	0,61	2,08	7,55	0,20
FI Caixa Brasil IRF-M1 TP RF	R Fixa	CAIXA	2.179.226.543,69	1,33156	2.901,78	0,00%	0,08	0,56	1,95	7,37	0,20
ITAÚ Soberano-REF. DI LP	REFDI	ITAÚ	175.235.383,69	25,61710	4.489,02	0,45%	20,07	0,61	2,25	7,27	0,15
Bradesco FI RF DI Premium	REFDI	BRAM-Asset	585.993.064,92	6,36513	3.729,92	0,66%	24,57	0,61	2,29	7,52	0,20
Santander FIC FI Corporate (*)	REFDI	Sant.-Asset	329.668.184,52	6,55311	2.160,35	0,00%	0,02	0,68	2,34	7,60	0,20
HSBC FI REF. DI LP	REFDI	HSBC	653.541.489,31	15,92063	10.404,79	0,02%	1,70	0,59	2,27	7,59	0,15
TOTAL							451,14				

Fonte: RIOPREVIDÊNCIA, Itaú, Bradesco, Caixa, HSBC, Santander

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

No encerramento do mês de abril, as aplicações financeiras em fundos de investimento totalizaram R\$ 451.145.756,96 distribuídos da forma abaixo:

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

