



DIRETORIA DE INVESTIMENTOS

Relatório Mensal de Investimentos

JANEIRO

**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
Diego Messias dos Santos

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

Janeiro de 2012	
CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA DO RIOPREVIDÊNCIA	(R\$)
A - Disponível	1.650.833.578
B - Segmento de Renda Fixa	809.789.669
1 - Carteiras Próprias	599.204.278
2- Operação Compromissada - Lastro: TPF	210.585.391
C - Segmento de Imóveis	202.763.651
1 - Carteiras Próprias	202.763.651
D - Fundos de Investimento	638.280.257
1 - Fundos de Curto Prazo	0
2 - Fundos Referenciados DI	638.280.257
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 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 2012

Posição consolidada da carteira por tipo de risco	(R\$)	(% do total)
1- Títulos Públicos Federais	1.280.087.826	77,5%
1.1 - Prefixados (LTN, NTN-F)	1.607.456	0,1%
1.2 - Pós-fixados (LFT - Selic, LTN com DI-1 Selic, Op.Comp.)	676.591.515	41,0%
1.3 - IPCA (NTN-B)	2.684.577	0,2%
1.4 - IGP-DI (CFT - Carteira Própria)	599.204.278	36,3%
2- Títulos Privados de Renda Fixa	167.980.502	10,2%
2.1 - Emissores de baixo risco de crédito (I)	149.670.179	9,1%
2.2 - Cotas de Fundos (II)	18.310.323	1,1%
3- Tesouraria (III)	1.599	0,0%
4- Imóveis (IV)	202.763.651	12,3%
Total da Carteira	1.650.833.578	100,0%

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

(I) Valor em Cotas do Fundo Caixa FI Brasil DI, BB RPPS Perfil e HSBC DI LP 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 Bradesco Premium investido no CEEE III-GT, FIDC Energisa e outros.

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

(IV) Refere-se ao valor apurado em 31/12/2011.

Rioprevidência - Janeiro de 2012
Posição da Carteira em 31/01/2012, 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	599.204.278	0,72%	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	638.280.257	0,77%	4,0%	Até 30,0%
Renda Fixa	FI/FIC RF ou Referenciado (Crédito Privado)	0	0,00%	0,0%	Até 5,0%
Renda Fixa	Op. Compromissada com TPF	210.585.391	0,25%	2,8%	Até 15,0%
Total Renda Fixa		1.448.069.926	1,74%		
Total do Ativo (III) (Res. 3.922/10)		83.368.777.637			
Imóveis (IV)	Terrenos e Edificações	202.763.651			

Fonte: RIOPREVIDÊNCIA, B.Brasil, Bradesco, HSBC, Caixa, B.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, BB RPPS Perfil, Bradesco Premium e HSBC DI LF que permite a alocação em títulos privados de baixo risco de crédito.

(III) Valor total do Ativo em 31/12/2011

(IV) Refere-se ao valor apurado em 31/12/2011.

(V) Refere-se ao valor do ativo total apurado em 31/12/2011

Em janeiro, as aplicações financeiras do RIOPREVIDÊNCIA se concentraram em cotas de Fundos de Investimento Referenciado DI, cujos lastros são predominantemente títulos públicos federais. Destaca-se ainda no mês, a operação compromissada indexada ao CDI.

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 2012

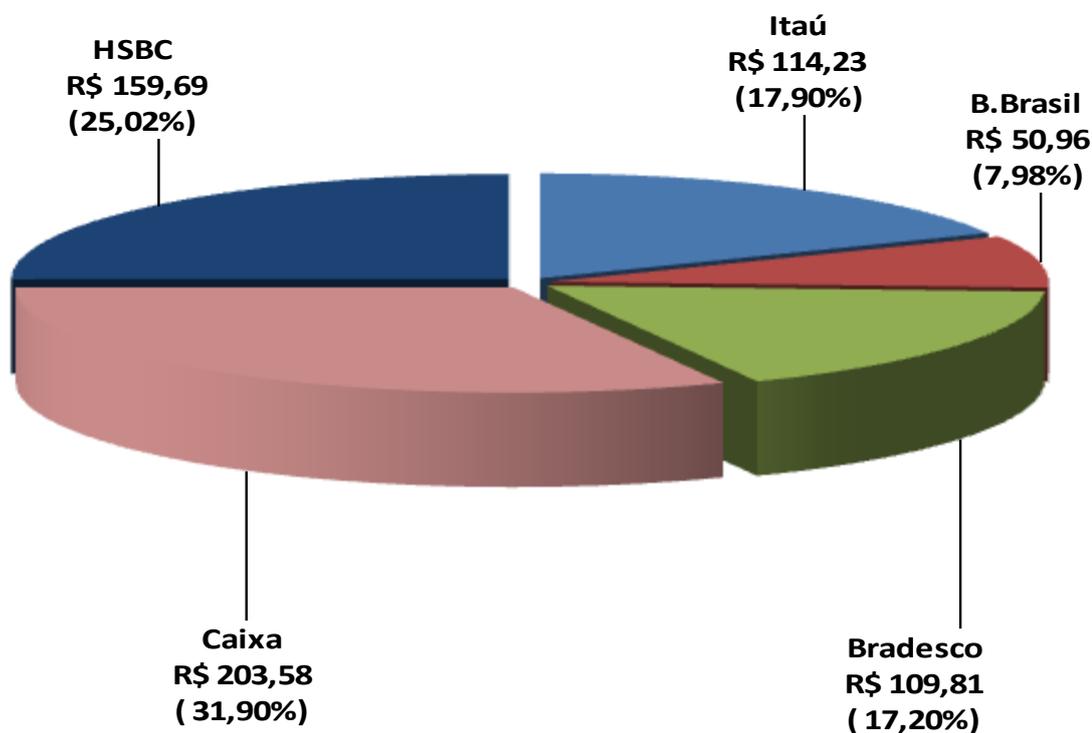
Fundo de Investimento	Participação do RIOPREVIDÊNCIA							Rent. Acum. (%)			Tx. Adm. (% a.a.)
	Tipo de Fundo	Gestor	Quantidade Total de Cotas	Valor Unitário das Cotas	PL dos Fundos R\$ MM	Part. % no PL dos Fundos	Valor dos Fundos R\$ MM	Mês	Ano	12 Meses	
FI Brasil REF DI LP	REF DI	CAIXA	335.487.771,30	1,77477	595,41	17,32%	103,11	0,91	0,91	11,82	0,20
ITAÚ -Soberano -REF. DI LP	REF DI	ITAÚ	125.923.034,03	23,33710	2.938,68	3,32%	97,64	0,88	0,88	11,48	0,15
ITAÚ -Institucional -REF. DI	REF DI	ITAÚ	278.995,40	1.509,64	421,18	3,94%	16,59	0,90	0,90	11,85	0,18
BB RPPS Perfil FIC de FI (I)	R Fixa	BBDTVM	193.874.118,90	1,08869	211,07	24,14%	50,96	0,90	0,90	-	0,20
FI RF DI Federal Extra	REF DI	BRAM-Asset	515.881.031,91	5,81577	3.000,25	3,21%	96,37	0,89	0,89	11,49	0,15
FI RF DI Premium	REF DI	BRAM-Asset	379.591.051,57	5,77911	2.193,70	0,61%	13,44	0,90	0,90	11,97	0,20
FI Aliança-Renda Fixa	R Fixa	CAIXA	268.917.244,90	2,03577	547,45	18,35%	100,47	0,93	0,93	12,12	0,20
HSBC FI REF. DI LP	REF DI	HSBC	710.408.678,22	14,46222	10.274,09	1,55%	159,69	0,91	0,91	11,98	0,15
TOTAL							638,28				

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

(I) Fundo criado em abril/2011.

No encerramento do mês de janeiro, as aplicações financeiras em fundos de investimento totalizaram R\$ 638.280.257,21 distribuídos da forma abaixo:

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



Janeiro de 2012

Operações Compromissadas

Instituição	CNPJ	Data da Contratação	Vencimento da Operação	% do Indexador	Lastro	Quantidade	P. Unitário (I)	Valor (I) Financeiro (R\$)
BRADESCO	60746948/0001-12	8/12/2011	9/4/2012	100,10% do CDI	LTN	255.581	823,948	210.585.391,36
TOTAL								210.585.391,36

Fonte: Bradesco

(I) - Posição em 31-01-2012



RIOPREVIDÊNCIA
FUNDO ÚNICO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO ESTADO DO RIO DE JANEIRO

Carteira Própria Certificados Financeiros do Tesouro - Posição em Janeiro 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__A546	14/12/99	14/12/99	15/2/2012	23.181	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.668,17	Pós-Fixado	61.850.848,77
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN__A547	14/12/99	14/12/99	15/3/2012	23.181	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.668,17	Pós-Fixado	61.850.848,77
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN__A548	14/12/99	14/12/99	15/4/2012	23.181	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.668,17	Pós-Fixado	61.850.848,77
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	2.668,17	Pós-Fixado	61.850.848,77
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	2.668,17	Pós-Fixado	61.850.848,77
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	2.668,17	Pós-Fixado	61.850.848,77
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	2.668,17	Pós-Fixado	61.850.848,77
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	2.668,17	Pós-Fixado	61.850.848,77
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	2.668,17	Pós-Fixado	61.850.848,77
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	2.668,17	Pós-Fixado	42.546.638,82
											224.575	599.204.277,75

Fonte: Rioprevidência / Itaú Custódia