



---

# **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](http://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\$)
<b>A - Disponível</b>	<b>1.650.833.578</b>
<b>B - Segmento de Renda Fixa</b>	<b>809.789.669</b>
1 - Carteiras Próprias	599.204.278
2- Operação Compromissada - Lastro: TPF	210.585.391
<b>C - Segmento de Imóveis</b>	<b>202.763.651</b>
1 - Carteiras Próprias	202.763.651
<b>D - Fundos de Investimento</b>	<b>638.280.257</b>
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)
<b>1- Títulos Públicos Federais</b>	<b>1.280.087.826</b>	<b>77,5%</b>
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%
<b>2- Títulos Privados de Renda Fixa</b>	<b>167.980.502</b>	<b>10,2%</b>
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%
<b>3- Tesouraria (III)</b>	<b>1.599</b>	<b>0,0%</b>
<b>4- Imóveis (IV)</b>	<b>202.763.651</b>	<b>12,3%</b>
<b>Total da Carteira</b>	<b>1.650.833.578</b>	<b>100,0%</b>

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	<u>599.204.278</u>	<u>0,72%</u>	100,0%	Até 100,0%
Renda Fixa (I)	FI/FIC RF ou Referenciado	<u>0</u>	<u>0,00%</u>	80,0%	Até 80,0%
Renda Fixa (II)	FI/FIC RF ou Referenciado	<u>638.280.257</u>	<u>0,77%</u>	4,0%	Até 30,0%
Renda Fixa	FI/FIC RF ou Referenciado (Crédito Privado)	<u>0</u>	<u>0,00%</u>	0,0%	Até 5,0%
Renda Fixa	Op. Compromissada com TPF	<u>210.585.391</u>	<u>0,25%</u>	2,8%	Até 15,0%
<b>Total Renda Fixa</b>		<b><u>1.448.069.926</u></b>	<b><u>1,74%</u></b>		
<b>Total do Ativo (III) (Res. 3.922/10)</b>		<b><u>83.368.777.637</u></b>			
<b>Imóveis (IV)</b>	<b>Terrenos e Edificações</b>	<b><u>202.763.651</u></b>			

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**

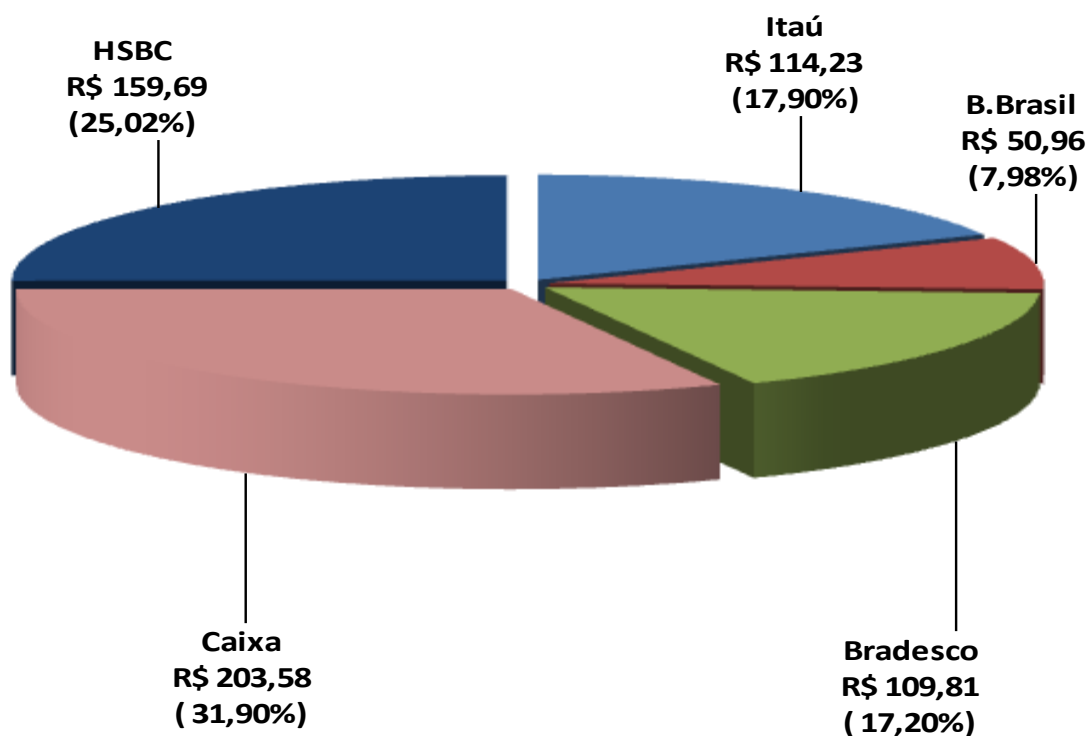
Fundo de Investimento	Participação do RIOPREVIDÊNCIA							Rent. Acum. (%)			Tx. Adm. (% a.a.)
	Nome do Fundo	Tipo de Fundo	Gestor	Quantidade Total de Cotas	Valor Unitário das Cotas	PL dos Fundos R\$ MM	Part. % no PL dos Fundos	Valor dos Fundos R\$ MM	Mês	Ano	
FI Brasil REF DI LP	REF DI	CAIXA	335.487.771,30	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
<b>TOTAL</b>							<b>638,28</b>				

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
<b>TOTAL</b>								<b>210.585.391,36</b>

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
											<b>224.575</b>	<b>599.204.277,75</b>

Fonte: Rioprevidência / Itaú Custódia