



DIRETORIA DE INVESTIMENTOS

Relatório Mensal de Investimentos

FEVEREIRO

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

RELATÓRIO MENSAL DE INVESTIMENTOS

Fevereiro de 2012

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA DO RIOPREVIDÊNCIA		(R\$)
A - Disponível		1.437.442.296
B - Segmento de Renda Fixa		751.109.508
1 - Carteiras Próprias		538.960.553
2 - Operação Compromissada - Lastro: TPF		212.148.955
C - Segmento de Imóveis		202.592.311
1 - Carteiras Próprias		202.763.651
D - Fundos de Investimento		483.740.476
1 - Fundos de Curto Prazo		0
2 - Fundos Referenciados DI		483.740.476
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 2012

Posição consolidada da carteira por tipo de risco	(R\$)	(% do total)
1- Títulos Públicos Federais	1.089.810.866	75,8%
1.1 - Prefixados (LTN, NTN-F)	564.932	0,0%
1.2 - Pós-fixados (LFT - Selic, LTN com DI-1 Selic, Op.Comp.)	548.898.441	38,2%
1.3 - IPCA (NTN-B)	1.386.940	0,1%
1.4 - IGP-DI (CFT - Carteira Própria)	538.960.553	37,5%
2- Títulos Privados de Renda Fixa	145.038.043	10,1%
2.1 - Emissores de baixo risco de crédito (I)	127.394.450	8,9%
2.2 - Cotas de Fundos (II)	17.643.592	1,2%
3- Tesouraria (III)	1.076	0,0%
4- Imóveis (IV)	202.592.311	14,1%
Total da Carteira	1.437.442.296	100,0%

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

(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.

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

(IV) Refere-se ao valor apurado em 31/01/2012.

Rioprevidência - Fevereiro de 2012

Posição da Carteira em 29/02/2012, 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>538.960.553</u>	<u>0,64%</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>483.740.476</u>	<u>0,58%</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>212.148.955</u>	<u>0,25%</u>	2,8%	Até 15,0%
Total Renda Fixa		<u>1.234.849.985</u>	<u>1,48%</u>		
Total do Ativo (III) (Res. 3.922/10)		<u>83.563.828.840</u>			
Imóveis (IV)	Terrenos e Edificações	<u>202.592.311</u>			

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

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 e HSBC DI LP que permite a alocação em títulos privados de baixo risco de crédito.

(III) Valor total do Ativo em 31/01/2012.

(IV) Refere-se ao valor apurado em 31/01/2012.

(V) Refere-se ao valor do ativo total apurado em 31/01/2012.

Em fevereiro, as aplicações financeiras do RIOPREVIDÊNCIA se concentraram em cotas de Fundos de Investimento Referenciado DI, cujos lastros são predominantemente títulos públicos federais. 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.

Fevereiro de 2012

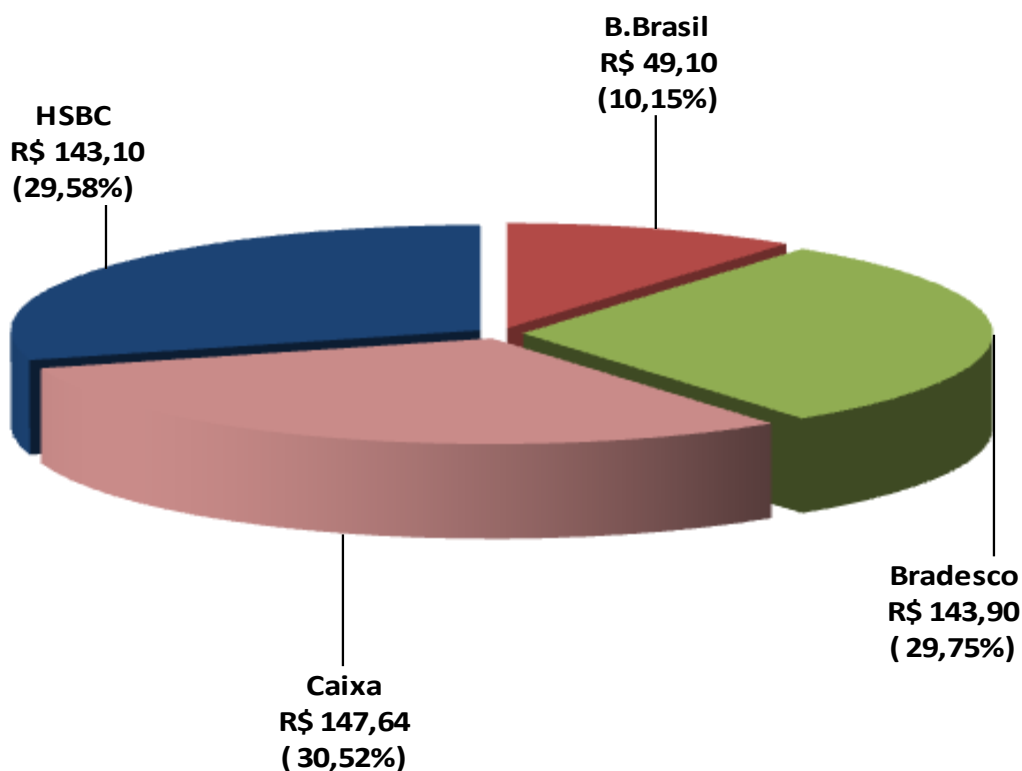
Fundos de Investimento			Participação do RIOPREVIDÊNCIA				Rent. Acum. (%)			Tx. Adm.	
Nome do Fundo	Tipo de Fundo	Gestor	Quantidade Total de Cotas	Valor Unitário das Cotas	PL dos Fundos R\$ MM	Part. % no PL dos Fundos	Valor dos Fundos R\$ MM	Mês	Ano	12 Meses	(% a.a.)
FI Brasil REF DI LP	REF DI	CAIXA	300.668.203,19	1,78823	537,66	19,38%	104,18	0,76	1,67	11,73	0,20
FI Aliança-Renda Fixa	R Fixa	CAIXA	221.713.173,54	2,05167	454,88	9,55%	43,46	0,78	1,71	12,03	0,20
BB RPPS Perfil FIC de FI (I)	R Fixa	BBTVM	150.173.221,70	1,09696	164,73	29,81%	49,10	0,76	1,67	-	0,20
FI RF DI Federal Extra	REF DI	BRAM-Asset	542.340.724,17	5,85911	3.177,63	4,53%	143,90	0,75	1,64	11,40	0,15
HSBC FI REF. DI LP	REF DI	HSBC	712.499.693,54	14,57208	10.382,60	1,38%	143,10	0,76	1,67	11,89	0,15
TOTAL							483,74				

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

(I) Fundo criado em abril/2011.

No encerramento do mês de fevereiro, as aplicações financeiras em fundos de investimento totalizaram R\$ 483.740.476,48 distribuídos da forma abaixo:

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



Fevereiro 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	830,065	212.148.954,94
TOTAL								212.148.954,94

Fonte: Bradesco

(I) - Posição em 29-02-2012

Carteira Própria Certificados Financeiros do Tesouro - Posição em Fevereiro 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__A547	14/12/99	14/12/99	15/3/2012	23.181	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.676,15	Pós-Fixado	62.035.833,15
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	2.676,15	Pós-Fixado	62.035.833,15
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	2.676,15	Pós-Fixado	62.035.833,15
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	2.676,15	Pós-Fixado	62.035.833,15
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	2.676,15	Pós-Fixado	62.035.833,15
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	2.676,15	Pós-Fixado	62.035.833,15
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	2.676,15	Pós-Fixado	62.035.833,15
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	2.676,15	Pós-Fixado	62.035.833,15
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	2.676,15	Pós-Fixado	42.673.887,90
201.394											538.960.553,10	