



DIRETORIA DE INVESTIMENTOS

Relatório Mensal de Investimentos

SETEMBRO

Rio de Janeiro
2011

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

Setembro de 2011

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA DO RIOPREVIDÊNCIA		(R\$)
A - Disponível		2.374.932.756
B - Segmento de Renda Fixa		1.202.691.028
1 - Carteiras Próprias		842.427.800
2 - Operação Compromissada - Lastro: TPF		360.263.227
C - Segmento de Imóveis		233.990.670
1 - Carteiras Próprias		233.990.670
D - Fundos de Investimento		938.251.059
1 - Fundos de Curto Prazo		0
2 - Fundos Referenciados DI		851.778.696
3 - Fundos de Renda Fixa RF IMA		86.472.363
4 - Fundos Multimercado		0
5 - Fundos de Ações		0

A composição das aplicações do RIOPREVIDÊNCIA no encerramento do mês de setembro se apresentou conforme as tabelas abaixo, dentro dos limites estabelecidos na Resolução nº 3.922/10 do CMN, e do Plano Anual de Investimentos.

Setembro de 2011

Posição consolidada da carteira do RIOPREVIDÊNCIA por tipo de risco	(R\$)	(% do total)
1- Títulos Públicos Federais	2.068.468.621	85,45%
1.1 - Prefixados (LTN, NTN-F)	69.187.735	0,93%
1.2 - Pós-fixados (LFT - Selic, LTN com DI-1 Selic, Op.Comp.)	1.156.608.761	32,87%
1.3 - IPCA (NTN-B)	244.325	0,01%
1.4 - IGP-DI (CFT - Carteira Própria)	842.427.800	51,65%
2- Títulos Privados de Renda Fixa	72.471.625	2,09%
2.1 - Emissores de baixo risco de crédito (I)	71.955.522	2,08%
2.2 - Cotas de Fundos (II)	516.104	0,01%
3- Tesouraria (III)	1.840	0,00%
4- Imóveis (IV)	233.990.670	12,46%
Total da Carteira	2.374.932.756	100,00%

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

(I) Valor em Cotas do Fundo Caixa FI Brasil DI e BB RPPS Perfil que está alocado em títulos privados de baixo risco de crédito

(II) Valor em Cotas do Fundo BB RPPS Perfil investido nos Fundos BB TOP RF Tradicional FI RF LP e BB TOP RF Arrojado FI, e do Fundo HSBC DI LP Tit. Públicos investido no Fundo HSBC FI Refer. DI Cash II.

(III) Recursos mantidos em Tesouraria nos Fundos: Itaú Soberano, BB RPPS Liquidez, BB RPPS Perfil, HSBC, Caixa BR IRFM-1, Caixa Brasil DI e Bradesco Federal Extra.

(IV) Refere-se ao valor apurado em 31/08/2011

Setembro de 2011

Posição da Carteira por Limites do PAI e Resolução nº 3.922/10

Segmento	Tipo de Ativo	Valores (R\$)	% (V)	Limites PAI (% total) (V)	Limite da Res. nº 3.922/10
Renda Fixa	TPF	<u>842.427.800</u>	<u>1,36%</u>	100,0%	Até 100,0%
Renda Fixa (I)	FI/FIC RF ou Referenciado	<u>86.472.363</u>	<u>0,14%</u>	80,0%	Até 80,0%
Renda Fixa (II)	FI/FIC RF ou Referenciado	<u>851.778.696</u>	<u>1,38%</u>	2,1%	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>360.263.227</u>	<u>0,58%</u>	2,1%	Até 15,0%
Total Renda Fixa		<u>2.140.942.086</u>	<u>3,47%</u>		

Total do Ativo (III) (Res. 3.922/10) 61.723.716.407

Imóveis (IV) Terrenos e Edificações 233.990.670

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

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 do Fundo Caixa FI Brasil e BB RPPS Perfil que permite a alocação em títulos privados de baixo risco de crédito.

(III) Valor total do Ativo em 31/08/2011.

(IV) Refere-se ao valor apurado em 31/08/2011.

Em setembro, as aplicações financeiras do RIOPREVIDÊNCIA se concentraram em cotas de Fundos de Investimento Referenciado DI, cujos lastros são predominantemente títulos públicos federais, e em aplicações atreladas ao IMA. Destaca-se ainda no mês, as operações compromissadas indexadas 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.

Setembro de 2011

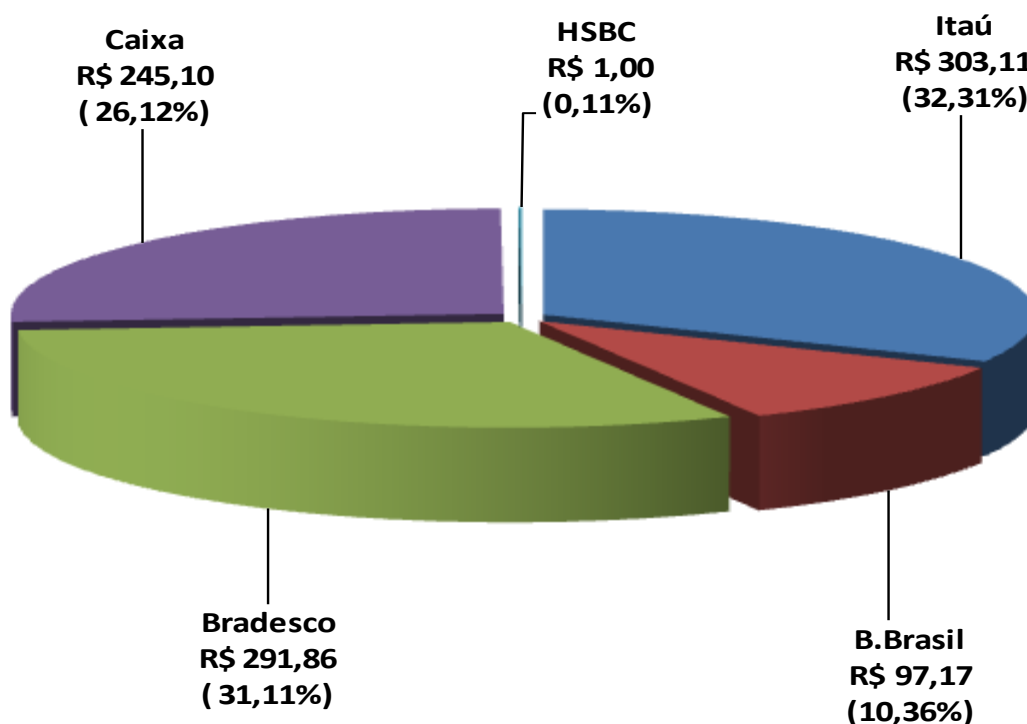
Fundos de Investimento			Participação do RIOPREVIDÊNCIA nos Fundos de Investimento					Rent. Acum. (%)			Tx. Adm.
Nome do Fundo	Tipo de Fundo	Gestor	Quantidade Total de Cotas	Valor Unitário das Cotas	PL dos Fundos R\$ MM	Part. % no PL dos Fundos	Valor dos Fundos R\$ MM	Mês	Ano	12 Meses	(% a.a.)
ITAÚ -Soberano -REF. DI LP	REF DI	ITAÚ	133.135.566,85	22,53833	3.000,65	10,10%	303,11	0,93	8,58	11,32	0,15
BB RPPS Perfil FIC de FI (I)	R Fixa	BBDTVM	137.999.325,57	1,05065	144,99	24,41%	35,40	0,95	5,07	-	0,20
FI RF DI Federal Extra	REF DI	BRADESCO	554.244.736,16	5,61625	3.112,78	9,38%	291,86	0,93	8,58	11,32	0,15
FI Brasil IRF-M1 TP RF	R Fixa	CAIXA	1.020.397.583,59	1,16433	1.188,08	2,08%	24,69	1,26	9,52	12,18	0,20
FI Aliança-Renda Fixa	R Fixa	CAIXA	259.449.871,51	1,96354	509,44	1,42%	7,23	0,93	8,98	11,76	0,20
HSBC FI Ref. DI LP TP	REF DI	HSBC	127.398.944,73	10,08367	1.284,65	0,08%	1,00	0,91	8,46	11,18	0,25
BB RPPS Liquidez FIC de FI	R Fixa	BBDTVM	1.431.910.805,91	1,22529	1.754,51	3,52%	61,78	1,27	9,44	12,07	0,30
TOTAL							938,25				

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

(I) Fundo criado em abril/2011.

No encerramento do mês de setembro, as aplicações financeiras em fundos de investimento totalizaram R\$ 938.251.058,83 distribuídos da forma abaixo:

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



Operações Compromissadas

Setembro de 2011

Instituição	CNPJ	Data da Contratação	Vencimento da Operação	% do Indexador	Lastro	Quantidade	P. Unitário (I)	Valor (I) Financeiro (R\$)
BRADESCO	60746948/0001-12	10/8/2011	8/12/2011	100,10% do CDI	LTN	235.168	864,470	203.295.698,00
BRADESCO	60746948/0001-12	6/9/2011	6/1/2012	100,10% do CDI	LTN	178.949	877,163	156.967.529,36
TOTAL								360.263.227,36

Fonte: Bradesco

(I) - Posição em 30-09-2011

Carteira Própria
Certificados Financeiros do Tesouro - Posição em Setembro de 2011

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_A542	14/12/99	14/12/99	15/10/2011	24.155	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.630,77	Pós-Fixado	63.546.249,35
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN_A543	14/12/99	14/12/99	15/11/2011	24.155	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.630,77	Pós-Fixado	63.546.249,35
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN_A544	14/12/99	14/12/99	15/12/2011	24.155	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.630,77	Pós-Fixado	63.546.249,35
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN_A545	14/12/99	14/12/99	15/1/2012	23.181	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.630,77	Pós-Fixado	60.983.879,37
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	2.630,77	Pós-Fixado	60.983.879,37
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	2.630,77	Pós-Fixado	60.983.879,37
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	2.630,77	Pós-Fixado	60.983.879,37
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	2.630,77	Pós-Fixado	60.983.879,37
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	2.630,77	Pós-Fixado	60.983.879,37
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	2.630,77	Pós-Fixado	60.983.879,37
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	2.630,77	Pós-Fixado	60.983.879,37
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	2.630,77	Pós-Fixado	60.983.879,37
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	2.630,77	Pós-Fixado	60.983.879,37
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	2.630,77	Pós-Fixado	41.950.258,42
						320.221						842.427.800,17