



DIRETORIA DE INVESTIMENTOS

Relatório Mensal de Investimentos

OUTUBRO

**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

Outubro de 2011

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA DO RIOPREVIDÊNCIA		(R\$)
A - Disponível		1.930.562.517
B - Segmento de Renda Fixa		1.148.180.519
1 - Carteiras Próprias		784.734.776
2 - Operação Compromissada - Lastro: TPF		363.445.743
C - Segmento de Imóveis		235.186.890
1 - Carteiras Próprias		235.186.890
D - Fundos de Investimento		547.195.108
1 - Fundos de Curto Prazo		0
2 - Fundos Referenciados DI		547.195.108
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 outubro se apresentou conforme as tabelas abaixo, dentro dos limites estabelecidos na Resolução nº 3.922/10 do CMN, e do Plano Anual de Investimentos.

Outubro de 2011

Posição consolidada da carteira do RIOPREVIDÊNCIA por tipo de risco	(R\$)	(% do total)
1- Títulos Públicos Federais	1.582.048.594	85,45%
1.1 - Prefixados (LTN, NTN-F)	316.816	0,93%
1.2 - Pós-fixados (LFT - Selic, LTN com DI-1 Selic, Op.Comp.)	796.862.820	32,87%
1.3 - IPCA (NTN-B)	134.182	0,01%
1.4 - IGP-DI (CFT - Carteira Própria)	784.734.776	51,65%
2- Títulos Privados de Renda Fixa	112.868.691	2,09%
2.1 - Emissores de baixo risco de crédito (I)	103.161.056	2,08%
2.2 - Cotas de Fundos (II)	9.707.635	0,01%
3- Tesouraria (III)	458.342	0,00%
4- Imóveis (IV)	235.186.890	12,46%
Total da Carteira	1.930.562.517	100,00%

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

(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 RPPS Perfil investido nos Fundos BB TOP RF Tradicional FI RF LP e BB Top RF Arrojado e do Fundo HSBC DI LP, investido nos Fundos HSBC FI Refer. DI Cash I e HSBC FI Refer. DI Cash II.

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

(IV) Refere-se ao valor apurado em 30/09/2011

Outubro 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>784.734.776</u>	<u>1,28%</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>547.195.108</u>	<u>0,89%</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>363.445.743</u>	<u>0,59%</u>	2,1%	Até 15,0%
Total Renda Fixa		<u>1.695.375.627</u>	<u>2,77%</u>		

Total do Ativo (III) (Res. 3.922/10) 61.190.554.112

Imóveis (IV) Terrenos e Edificações 235.186.890

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, 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 30/09/2011.

(IV) Refere-se ao valor apurado em 30/09/2011.

Em outubro, 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, 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.

Outubro de 2011

Fundos de Investimento Participação do RIOPREVIDÊNCIA nos Fundos de Investimento Rent. Acum. (%) Tx. Adm.

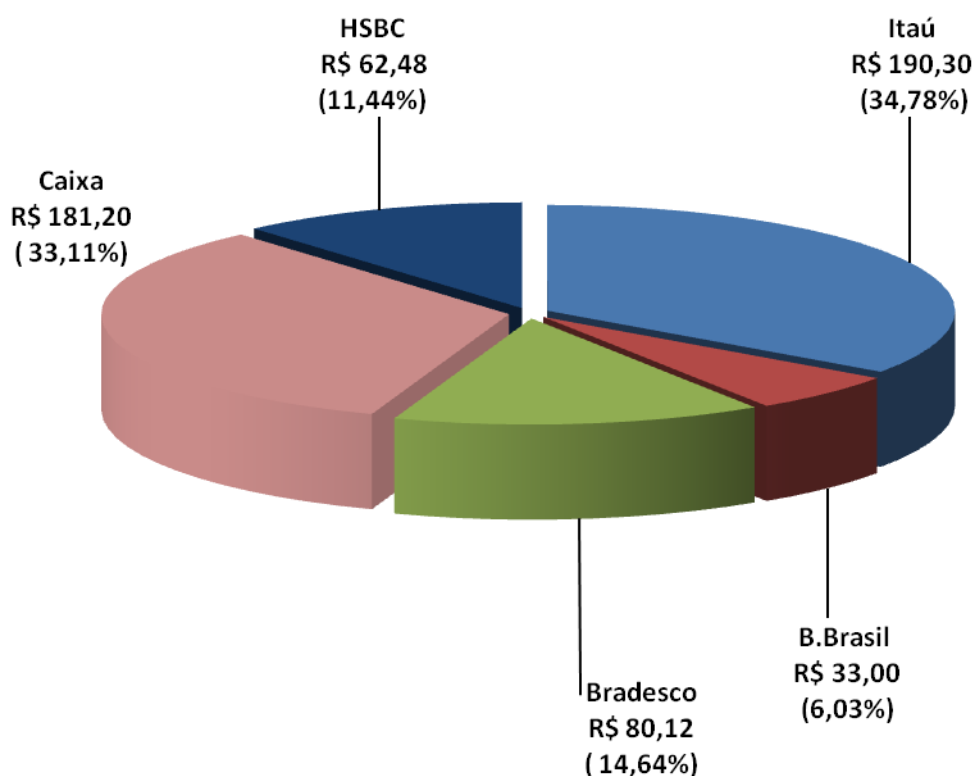
Nome do Fundo	Tipo de Fundo	Gestor	Quantidade Total de Cotas	Valor Unitário das Cotas	PL dos Fundos R\$ MM	Part. % no PL dos Fundos	Valor dos Fundos			Tx. Adm. (% a.a.)	
							R\$ MM	Mês	Ano		12 Meses
FI Brasil REF DI LP	REF DI	CAIXA	424.143.238,22	1,72756	732,73	24,21%	177,43	0,89	9,79	11,72	0,20
ITAÚ -Soberano -REF. DI LP	REF DI	ITAÚ	128.490.162,19	22,73483	2.921,20	6,51%	190,30	0,87	9,53	11,41	0,15
BB RPPS Perfil FIC de FI (I)	R Fixa	BBDTVM	134.628.757,45	1,06001	142,71	23,12%	33,00	0,89	6,00	-	0,20
FI RF DI Federal Extra	REF DI	BRABESCO	516.122.529,17	5,66517	2.923,92	2,74%	80,12	0,87	9,53	11,41	0,15
FI Aliança-Renda Fixa	R Fixa	CAIXA	246.041.823,01	1,98054	487,29	0,77%	3,77	0,87	9,93	11,80	0,20
HSBC FI Ref. DI LP	REF DI	HSBC	690.623.728,12	14,07242	9.718,75	0,64%	62,58	0,90	9,91	11,85	0,15
TOTAL							547,19				

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

(I) Fundo criado em abril/2011.

No encerramento do mês de outubro, as aplicações financeiras em fundos de investimento totalizaram R\$ 547.195.108,04 distribuídos da forma abaixo:

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



Operações Compromissadas

Outubro 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	872,107	205.091.584,00
BRADESCO	60746948/0001-12	6/9/2011	6/1/2012	100,10% do CDI	LTN	178.949	884,912	158.354.159,43
TOTAL								363.445.743,43

Fonte: Bradesco

(I) - Posição em 31-10-2011

Carteira Própria Certificados Financeiros do Tesouro - Posição em Outubro 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_A543	14/12/99	14/12/99	15/11/2011	24.155	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.650,54	Pós-Fixado	64.023.793,70
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	2.650,54	Pós-Fixado	64.023.793,70
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	2.650,54	Pós-Fixado	61.442.167,74
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	2.650,54	Pós-Fixado	61.442.167,74
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	2.650,54	Pós-Fixado	61.442.167,74
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	2.650,54	Pós-Fixado	61.442.167,74
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	2.650,54	Pós-Fixado	61.442.167,74
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	2.650,54	Pós-Fixado	61.442.167,74
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	2.650,54	Pós-Fixado	61.442.167,74
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	2.650,54	Pós-Fixado	61.442.167,74
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	2.650,54	Pós-Fixado	61.442.167,74
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	2.650,54	Pós-Fixado	61.442.167,74
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	2.650,54	Pós-Fixado	42.265.510,84
296.066											784.734.775,64	