



DIRETORIA DE INVESTIMENTOS

Relatório Mensal de Investimentos

MAIO

**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 – Técnico Previdenciário Nível I - mat. 180.313-9

RELATÓRIO MENSAL DE INVESTIMENTOS

Maio de 2011

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA DO RIOPREVIDÊNCIA		(R\$)
A - Disponível		2.786.430.534
B - Segmento de Renda Fixa		2.060.227.917
1 - Carteiras Próprias		1.857.944.685
2- Operação Compromissada - Lastro: TPF		202.283.232
C - Segmento de Renda Variável		1.600
1 - Ativos em Enquadramento - Ações		1.600
D - Segmento de Imóveis		197.692.925
1 - Carteiras Próprias		197.692.925
E - Fundos de Investimento		528.508.092
1 - Fundos de Curto Prazo		0
2 - Fundos Referenciados DI		426.497.684
3 - Fundos de Renda Fixa RF IMA		102.010.408
4 - Fundos Multimercado		0
5 - Fundos de Ações		0

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

Maio de 2011

Posição consolidada da carteira do RIOPREVIDÊNCIA por tipo de risco	(R\$)	(% do total)
1- Títulos Públicos Federais	<u>2.563.844.589</u>	<u>92,01%</u>
1.1 - Prefixados (LTN, NTN-F)	89.835.585	3,22%
1.2 - Pós-fixados (LFT - Selic, LTN com DI-1 Selic, Op. Comp.)	614.935.584	22,07%
1.3 - IPCA (NTN-B)	1.128.736	0,04%
1.4 - IGP-DI (CFT - Carteira Própria)	1.857.944.685	66,68%
2- Títulos Privados de Renda Fixa	<u>24.125.353</u>	<u>0,87%</u>
2.1 - Emissores de baixo risco de crédito (I)	24.103.510	0,87%
2.2 - Cotas de Fundos (II)	21.843	0,00%
3- Tesouraria (III)	<u>766.067</u>	<u>0,03%</u>
4- Imóveis (IV)	<u>197.692.925</u>	<u>7,09%</u>
5- Ativos em enquadramento - Ações (V)	<u>1.600</u>	<u>0,00%</u>
Total da Carteira	<u>2.786.430.534</u>	<u>100,00%</u>

Fonte: RIOPREVIDÊNCIA, B.Brasil, Bradesco, Caixa, Itaú, BNP Paribas.

(I) Valor em Cotas do Fundo Caixa FI Brasil RF DI LP que está alocado em títulos privados de baixo risco de crédito

(II) Valor em Cotas do Fundo BB RPPS Perfil investido no Fundo BB TOP RF Tradicional FI RF LP

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

(IV) Refere-se ao valor apurado em 29/04/2011

(V) Ativos em enquadramento recebidos do IPERJ

Maio 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)	Limite da Res. nº 3.922/10
Renda Fixa	TPF	<u>1.857.944.685</u>	<u>2,91%</u>	100,0%	Até 100,0%
Renda Fixa (I)	FI/FIC RF ou Referenciado	<u>47.922.380</u>	<u>0,07%</u>	80,0%	Até 80,0%
Renda Fixa (II)	FI/FIC RF ou Referenciado	<u>480.589.712</u>	<u>0,75%</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>202.283.232</u>	<u>0,32%</u>	2,1%	Até 15,0%
Renda Variável (III)	Ações (em enquadramento)	<u>1.600</u>	<u>0,00%</u>	N.A.	Até 30,0%
Total Renda Fixa e Variável		<u>2.588.741.610</u>	<u>4,05%</u>		
Total do Ativo (IV) (Res. 3.922/10)		<u>63.942.810.821</u>			

Imóveis (V) Terrenos e Edificações 197.692.925

Fonte: RIOPREVIDÊNCIA, B.Brasil, Caixa, B.Itaú, BNP Paribas.

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 que permite a alocação em títulos privados de baixo risco de crédito.

(III) Ativos em enquadramento recebidos do IPERJ

(IV) Valor total do Ativo em 29/04/2011.

(V) Refere-se ao valor apurado em 29/04/2011.

Em maio, 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.

Maio de 2011

Fundos de Investimento			Participação do RIOPREVIDÊNCIA nos Fundos de Investimento				Rent. Acum. (%)			Tx. Adm.	
Nome do Fundo	Tipo de Fundo	Gestor	Quantidade	Valor	PL dos	Part. %	Valor		12 Meses	(% a.a.)	
			Total de Cotas	Unitário das Cotas	Fundos R\$ MM	no PL dos Fundos	dos Fundos R\$ MM	Mês			Ano
FI BRASIL REF DI LP	REF DI	CAIXA	314.340.682,24	1,64506	517,11	19,76%	102,16	1,00	4,54	10,89	0,20
Itaú-SOBERANO-REF. DI LP	REF DI	ITAÚ	131.865.605,72	21,68354	2.859,31	4,26%	121,85	0,97	4,46	10,71	0,15
BB RPPS PERFIL (I)	R Fixa	BBDTVM	17.750.693,52	1,01027	17,93	14,83%	2,66	0,98	1,03	-	0,20
FI RF DI FEDERAL EXTRA	REF DI	BRADESCO	530.351.780,15	5,40319	2.865,59	4,34%	124,41	0,97	4,46	10,71	0,15
FI BRASIL IRF-M1 TP	R Fixa	CAIXA	544.440.129,25	1,11074	604,73	7,58%	45,86	0,98	4,48	11,04	0,20
FI ALIANÇA-Renda Fixa	R Fixa	CAIXA	369.769.405,51	1,88335	696,41	6,50%	45,26	1,01	4,53	10,97	0,20
BB RPPS LIQUIDEZ FIC FI (II)	R Fixa	BBDTVM	1.202.852.304,61	1,16913	1.406,29	3,85%	54,09	0,97	4,42	-	0,30
BNP Paribas Sovereign DI FI	REF DI	BNP Asset	2.041.044,01	129,54283	264,40	11,41%	30,16	0,96	4,46	10,79	0,10
BNP Paribas Fix IRF-M1 (III)	R Fixa	BNP Asset	117.187,86	108,18352	12,68	16,23%	2,06	0,96	4,40	-	0,20
TOTAL							528,51				

Fonte: RIOPREVIDÊNCIA, B.Brasil, Bradesco, Caixa, B.Itaú, BNP Paribas.

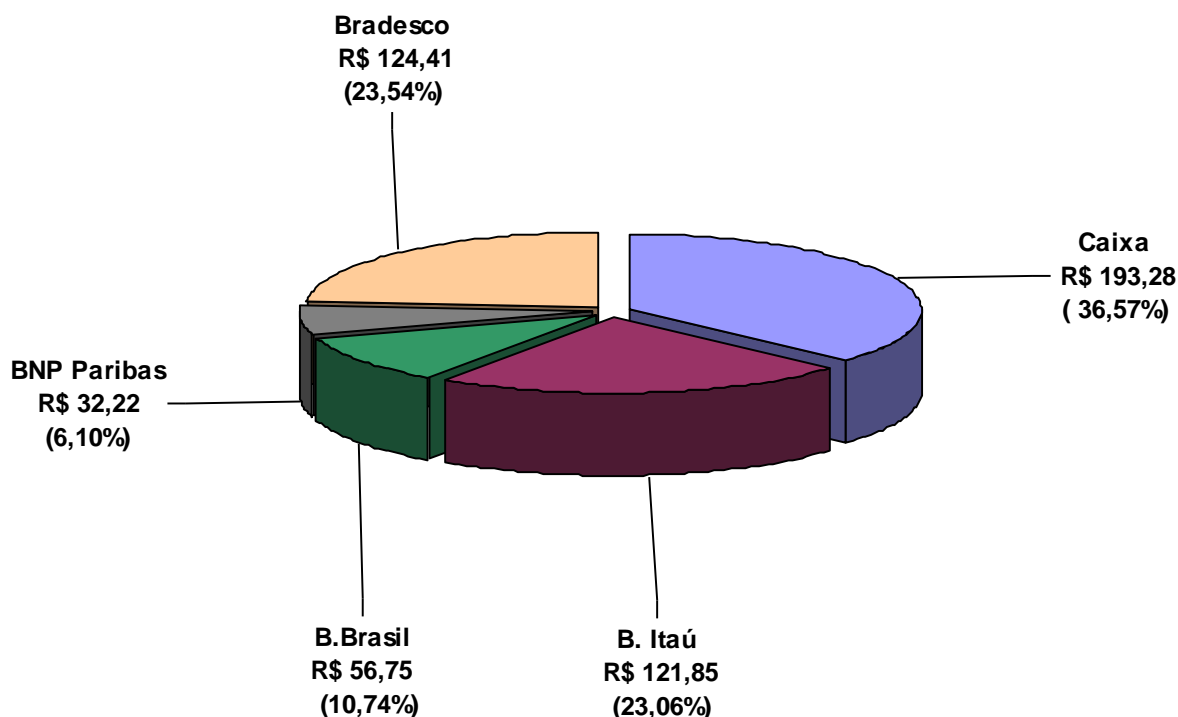
(I) Fundo criado em abril/2011.

(III) Fundo criado em agosto/2010.

(II) Fundo adaptado em jun/2010.

No encerramento do mês de maio, as aplicações financeiras em fundos de investimento totalizaram R\$ 528.508.092,39, distribuídos da forma abaixo:

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



Operações Compromissadas

Maio 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	19/4/2011	17/8/2011	100,10% do CDI	LTN	62.602	820,161	51.343.735,79
BRADESCO	60746948/0001-12	11/5/2011	8/9/2011	100,10% do CDI	LTN	183.595	822,133	150.939.496,50
TOTAL								202.283.232,29

Fonte: Caixa

(I) - Posição em 31-05-2011

Carteira Própria Certificados Financeiros do Tesouro - Posição em Maio 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_A538	14/12/99	14/12/99	15/6/2011	24.155	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.619,31	Pós-Fixado	63.269.433,05
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN_A539	14/12/99	14/12/99	15/7/2011	316.640	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.619,31	Pós-Fixado	829.378.318,40
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN_A540	14/12/99	14/12/99	15/8/2011	24.155	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.619,31	Pós-Fixado	63.269.433,05
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN_A541	14/12/99	14/12/99	15/9/2011	24.155	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.619,31	Pós-Fixado	63.269.433,05
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	2.619,31	Pós-Fixado	63.269.433,05
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	2.619,31	Pós-Fixado	63.269.433,05
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	2.619,31	Pós-Fixado	63.269.433,05
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	2.619,31	Pós-Fixado	60.718.225,11
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	2.619,31	Pós-Fixado	60.718.225,11
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	2.619,31	Pós-Fixado	60.718.225,11
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	2.619,31	Pós-Fixado	60.718.225,11
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	2.619,31	Pós-Fixado	60.718.225,11
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	2.619,31	Pós-Fixado	60.718.225,11
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	2.619,31	Pós-Fixado	60.718.225,11
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	2.619,31	Pós-Fixado	60.718.225,11
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	2.619,31	Pós-Fixado	60.718.225,11
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	2.619,31	Pós-Fixado	60.718.225,11
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	2.619,31	Pós-Fixado	41.767.517,26
709.326												1.857.944.685,06

Com a extinção do IPERJ, foram transferidas ao RIOPREVIDÊNCIA as ações de empresas de propriedade daquele Instituto. Contudo, para efeitos de enquadramento à Resolução CMN nº 3.922/10, essas ações estão em processo de negociação.

Ativos em Enquadramento - Posição Acionária em 31/05/2011 - RIOPREVIDÊNCIA

AÇÕES	TIPO	QTD	COTAÇÃO 31/5/2011	VALOR	
Brasil Telecom S/A	BRT03	100/unit.	92	17,39	R\$ 1.599,88
TOTAL				R\$ 1.599,88	

Fonte: Banco Itaú