



---

# **DIRETORIA DE INVESTIMENTOS**

## **Relatório Mensal de Investimentos**

### **JUNHO**

---

**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](http://www.rioprevidencia.rj.gov.br)

Elaborado por : Carlos Augusto B. Fernandes – Técnico Previdenciário Nível I - mat. 180.313-9

## RELATÓRIO MENSAL DE INVESTIMENTOS

Junho de 2011

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA DO RIOPREVIDÊNCIA		(R\$)
<b>A - Disponível</b>		<b>2.382.172.807</b>
<b>B - Segmento de Renda Fixa</b>		<b>1.999.001.813</b>
1 - Carteiras Próprias		1.794.791.731
2- Operação Compromissada - Lastro: TPF		204.210.082
<b>C - Segmento de Imóveis</b>		<b>233.427.924</b>
1 - Carteiras Próprias		233.427.924
<b>D - Fundos de Investimento</b>		<b>149.743.070</b>
1 - Fundos de Curto Prazo		0
2 - Fundos Referenciados DI		124.494.370
3 - Fundos de Renda Fixa RF IMA		25.248.700
4 - Fundos Multimercado		0
5 - Fundos de Ações		0

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

Junho de 2011

Posição consolidada da carteira do RIOPREVIDÊNCIA por tipo de risco	(R\$)	(% do total)
<b>1- Títulos Públicos Federais</b>	<b>2.121.110.150</b>	<b>89,04%</b>
1.1 - Prefixados (LTN, NTN-F)	23.030.291	0,97%
1.2 - Pós-fixados (LFT - Selic, LTN com DI-1 Selic, Op.Comp.)	303.126.259	12,72%
1.3 - IPCA (NTN-B)	161.869	0,01%
1.4 - IGP-DI (CFT - Carteira Própria)	1.794.791.731	75,34%
<b>2- Títulos Privados de Renda Fixa</b>	<b>27.583.643</b>	<b>1,16%</b>
2.1 - Emissores de baixo risco de crédito (I)	27.543.480	1,16%
2.2 - Cotas de Fundos (II)	40.163	0,00%
<b>3- Tesouraria (III)</b>	<b>51.090</b>	<b>0,00%</b>
<b>4- Imóveis (IV)</b>	<b>233.427.924</b>	<b>9,80%</b>
<b>Total da Carteira</b>	<b>2.382.172.807</b>	<b>100,00%</b>

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

(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 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 31/05/2011

Junho 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>1.794.791.731</u>	<u>2,83%</u>	100,0%	Até 100,0%
Renda Fixa (I)	FI/FIC RF ou Referenciado	<u>12.728.560</u>	<u>0,02%</u>	80,0%	Até 80,0%
Renda Fixa (II)	FI/FIC RF ou Referenciado	<u>137.014.510</u>	<u>0,22%</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>204.210.082</u>	<u>0,32%</u>	2,1%	Até 15,0%
<b>Total - Renda Fixa</b>		<b><u>2.148.744.883</u></b>	<b><u>3,38%</u></b>		

**Total do Ativo (III) (Res. 3.922/10) 63.490.277.002**

**Imóveis (IV) Terrenos e Edificações 233.427.924**

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 e BB RPPS Perfil que permite a alocação em títulos privados de baixo risco de crédito.

(III) Valor total do Ativo em 31/05/2011.

(IV) Refere-se ao valor apurado em 31/05/2011.

(V) Refere-se ao valor do ativo total apurado em 31/05/2011.

Em junho, 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.

Junho 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.)
FI Brasil REF DI LP	REF DI	CAIXA	346.017.194,18	1,66091	574,70	17,10%	98,29	0,96	5,55	11,09	0,20
ITAÚ -Soberano -REF. DI LP	REF DI	ITAÚ	118.625.169,37	21,88780	2.596,44	0,23%	5,89	0,94	5,45	10,89	0,15
BB RPPS Perfil FIC de FI (I)	R Fixa	BBDTVM	23.301.107,87	1,01976	23,76	20,39%	4,85	0,94	1,98	-	0,20
FI RF DI Federal Extra	REF DI	BRDESCO	505.994.707,21	5,45410	2.759,75	0,22%	6,16	0,94	5,45	10,89	0,15
FI Brasil IRF-M1 TP RF	R Fixa	CAIXA	591.664.365,57	1,12092	663,21	1,76%	11,65	0,92	5,44	11,26	0,20
FI Aliança-Renda Fixa	R Fixa	CAIXA	333.599.303,85	1,89983	633,78	0,93%	5,88	0,88	5,45	10,86	0,20
BB RPPS Liquidez FIC de FI	R Fixa	BBDTVM	1.192.020.033,11	1,17975	1.406,29	0,89%	12,52	0,91	5,37	11,45	0,30
BNP Paribas Sovereign DI FI	REF DI	BNP Asset	1.620.236,04	130,76366	211,87	1,62%	3,43	0,94	5,44	10,94	0,10
BNP Paribas Fix IRF-M1 (II)	R Fixa	BNP Asset	108.025,26	109,13933	11,79	9,14%	1,08	0,88	5,32	-	0,20
<b>TOTAL</b>							<b>149,74</b>				

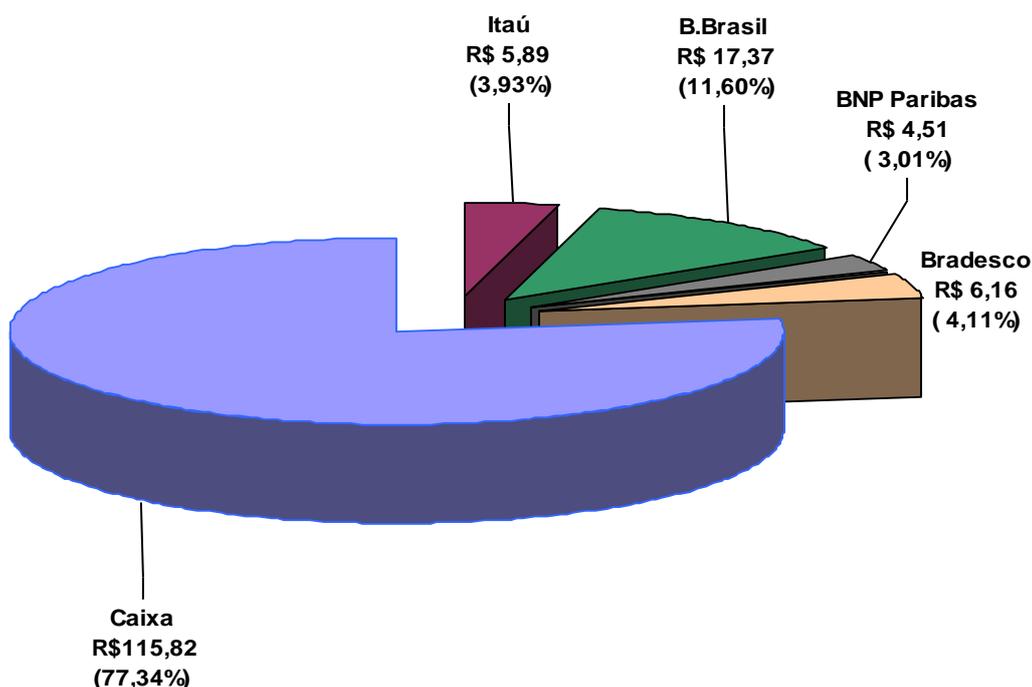
Fonte: RIOPREVIDÊNCIA, B.Brasil, Bradesco, Caixa, B.Itaú, BNP Paribas.

(I) Fundo criado em abril/2011.

(II) Fundo criado em agosto/2010.

No encerramento do mês de junho, as aplicações financeiras em fundos de investimento totalizaram R\$ 149.743.070,22, distribuídos da forma abaixo:

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



**Operações Compromissadas**

Junho de 2011

Instituição	CNPJ	Data da Contratação	Vencimento da Operação	% do Indexador	Lastro	Quantidade	P. Unitário (I)	Valor (I) Financeiro (R\$)
<b>BRADESCO</b>	60746948/0001-12	19/4/2011	17/8/2011	100,10% do CDI	LTN	62.602	827,974	51.832.811,07
<b>BRADESCO</b>	60746948/0001-12	11/5/2011	8/9/2011	100,10% do CDI	LTN	183.595	829,964	152.377.270,50
<b>TOTAL</b>								<b>204.210.081,57</b>

Fonte: Caixa

(I) - Posição em 30-06-2011



**RIOPREVIDÊNCIA**  
FUNDO ÚNICO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO ESTADO DO RIO DE JANEIRO

**Carteira Própria**

**Certificados Financeiros do Tesouro - Posição em Junho 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_A539	14/12/99	14/12/99	15/7/2011	316.640	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.619,48	Pós-Fixado	829.432.147,20
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	2.619,48	Pós-Fixado	63.273.539,40
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	2.619,48	Pós-Fixado	63.273.539,40
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	2.619,48	Pós-Fixado	63.273.539,40
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	2.619,48	Pós-Fixado	63.273.539,40
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	2.619,48	Pós-Fixado	63.273.539,40
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	2.619,48	Pós-Fixado	60.722.165,88
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	2.619,48	Pós-Fixado	60.722.165,88
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	2.619,48	Pós-Fixado	60.722.165,88
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	2.619,48	Pós-Fixado	60.722.165,88
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	2.619,48	Pós-Fixado	60.722.165,88
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	2.619,48	Pós-Fixado	60.722.165,88
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	2.619,48	Pós-Fixado	60.722.165,88
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	2.619,48	Pós-Fixado	60.722.165,88
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	2.619,48	Pós-Fixado	60.722.165,88
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	2.619,48	Pós-Fixado	60.722.165,88
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	2.619,48	Pós-Fixado	41.770.228,08
<b>685.171</b>												
<b>1.794.791.731,08</b>												