



DIRETORIA DE INVESTIMENTOS

Relatório Mensal de Investimentos

JANEIRO

**Rio de Janeiro
2011**

Diretoria de Investimentos

Antonio Paulo Vogel de Medeiros – Diretor

Gerência de Operações e Planejamento

Carlos Alexandre Lima Nogueira – Gerente
Flávia Affonso Teixeira – Coordenadora de Planejamento
Marcio Martins Rocha Ramos - Coordenador de Operações
Angela Maria Monteiro Pandolfo
Carlos Augusto Bastos Fernandes
Ubirajara da Silva Coelho
Luciana Pinto Venâncio

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

Janeiro de 2011

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA DO RIOPREVIDÊNCIA		(R\$)
A - Disponível		3.359.525.637
B - Segmento de Renda Fixa		2.899.324.444
1 - Carteiras Próprias		2.643.714.072
2- Operação Compromissada - Lastro: TPF		255.610.372
C - Segmento de Renda Variável		9.979
1 - Ativos em Enquadramento - Ações		9.979
D - Segmento de Imóveis		362.519.457
1 - Carteiras Próprias		362.519.457
E - Fundos de Investimento		97.671.758
1 - Fundos de Curto Prazo		0
2 - Fundos Referenciados DI		56.868.939
3 - Fundos de Renda Fixa RF IMA		40.802.819
4 - Fundos Multimercado		0
5 - Fundos de Ações		0

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

Janeiro de 2011

Posição consolidada da carteira do RIOPREVIDÊNCIA por tipo de risco	(R\$)	(% do total)
1- Títulos Públicos Federais	2.992.727.452	89,08%
1.1 - Prefixados (LTN, NTN-F)	34.240.602	1,02%
1.2 - Pós-fixados (LFT - Selic, LTN com DI-1 Selic, Op.Comp.)	314.755.540	9,37%
1.3 - IPCA (NTN-B)	17.238	0,00%
1.4 - IGP-DI (CFT - Carteira Própria)	2.643.714.072	78,69%
2- Títulos Privados	4.161.605	0,12%
2.1 - Emissores de baixo risco de crédito (I)	4.161.605	0,12%
3- Tesouraria (II)	107.145	0,00%
4- Imóveis (III)	362.519.457	10,79%
5- Ativos em enquadramento - Ações (IV)	9.979	0,00%
Total da Carteira	3.359.525.637	100,00%

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

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

(II) Recursos mantidos em Tesouraria nos Fundos: Itaú Soberano, BNP Paribas Fix, BB RPPS Liquidez, BB Comercial 17, Caixa Soberano, Caixa Brasil DI, Caixa Aliança RF e Santander FIC.

(III) Refere-se ao valor apurado em dezembro/2010.

(IV) Ativos em enquadramento recebidos do IPERJ

Janeiro 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>2.643.714.072</u>	<u>4,16%</u>	100,0%	Até 100,0%
Renda Fixa (I)	FI/FIC RF ou Referenciado	<u>23.299.158</u>	<u>0,04%</u>	80,0%	Até 80,0%
Renda Fixa (II)	FI/FIC RF ou Referenciado	<u>74.372.600</u>	<u>0,12%</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>255.610.372</u>	<u>0,40%</u>	2,1%	Até 15,0%
Renda Variável (III)	Ações (em enquadramento)	<u>9.979</u>	<u>0,00%</u>	N.A.	Até 30,0%
Total Renda Fixa e Variável		<u>2.997.006.181</u>	<u>4,71%</u>		
Total do Ativo (IV) (Res. 3.922/10)		<u>63.564.432.963</u>			
Imóveis (V)	Terrenos e Edificações	<u>362.519.457</u>			

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

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 estimado em 31/12/2010.

(V) Refere-se ao valor apurado em dezembro/2010.

Em janeiro, 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, 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.

Janeiro 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	270.355.829,18	1,58712	429,09	7,09%	30,41	0,86	0,86	9,95	0,20
ITAÚ-SOBERANO-REF. DI LP	REF DI	ITAÚ	195.317.970,34	20,93326	4.088,64	0,53%	21,49	0,85	0,85	9,81	0,15
BB COMERCIAL 17 FICFI	REF DI	BBDTVM	238.034.136,06	2,68263	638,56	0,68%	4,34	0,80	0,80	9,64	0,30
FI CAIXA ALIANÇA RF	R. Fixa	CAIXA	370.016.214,84	1,81570	671,84	0,09%	0,63	0,78	0,78	10,08	0,20
FI BRASIL SOBERANO RF (I)	R Fixa	CAIXA	391.832.822,26	1,07112	419,70	4,98%	20,91	0,75	0,75	-	0,20
BB RPPS LIQUIDEZ FIC FI (II)	R Fixa	BBDTVM	911.185.343,23	1,12765	1.027,50	1,60%	16,48	0,72	0,72	-	0,30
SANTANDER FIC RF IRF-M1 (III)	R Fixa	Sant. Asset	18.797.825,95	10,84949	203,95	0,50%	1,02	0,71	0,71	-	0,40
BNP Paribas Fix IRFM-1 (IV)	R Fixa	BNP Asset	117.877,14	104,41550	12,31	19,40%	2,39	0,76	0,76	-	0,20
TOTAL							97,67				

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

(I) Fundo adaptado em maio/2010.

(III) Fundo adaptado em maio/2010.

(II) Fundo adaptado em jun/2010.

(IV) Fundo criado em agosto/2010.

Operações Compromissadas

Janeiro de 2011

Instituição	CNPJ	Data da Contratação	Vencimento da Operação	% do Indexador	Lastro	Quantidade	P. Unitário (I)	Valor (II) Financeiro (R\$)
CAIXA	00360305000104	12/11/2010	14/3/2011	100,00% do CDI	NTN-B	125.497	1.927,340	255.610.371,84
TOTAL								255.610.371,84

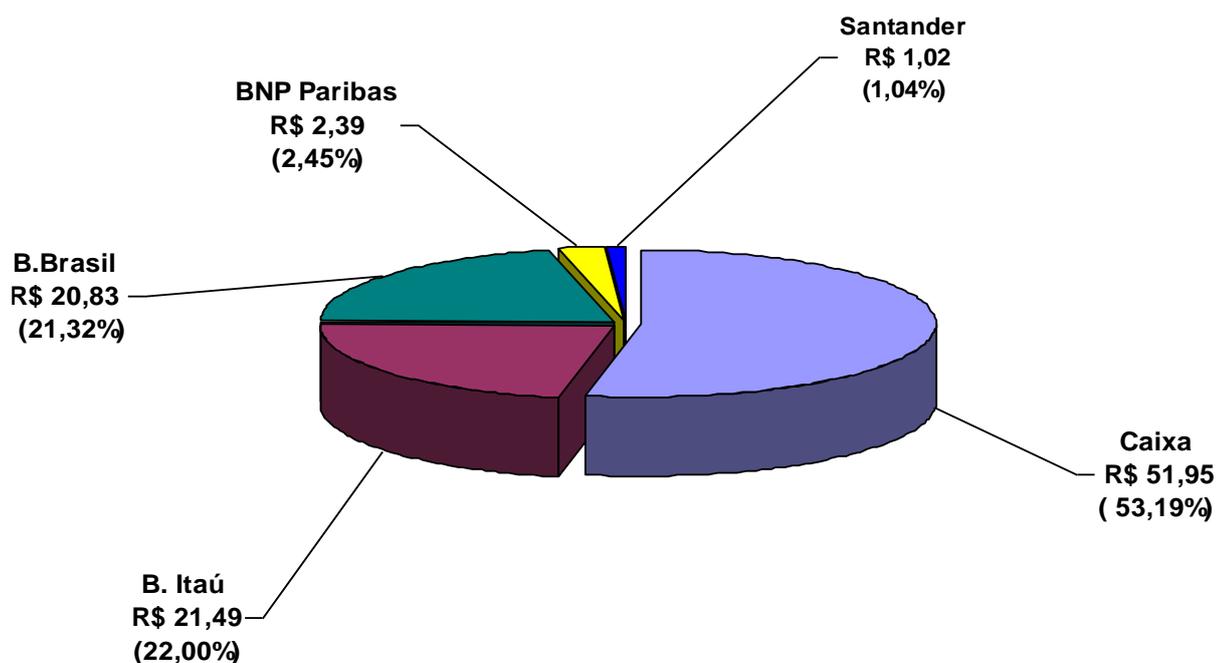
Fonte: Caixa

(I) - Cotação na operação inicial

(II) - Posição em 31-01-2011

No encerramento do mês de janeiro, as aplicações financeiras em fundos de investimento totalizaram R\$ 97.671.758,31, distribuídos da forma abaixo:

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



Carteira Própria
Certificados Financeiros do Tesouro - Posição em Janeiro 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_A534	14/12/99	14/12/99	15/2/2011	24.155	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.541,18	Pós-Fixado	61.382.202,90
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN_A535	14/12/99	14/12/99	15/3/2011	24.155	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.541,18	Pós-Fixado	61.382.202,90
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN_A536	14/12/99	14/12/99	15/4/2011	24.155	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.541,18	Pós-Fixado	61.382.202,90
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN_A537	14/12/99	14/12/99	15/5/2011	24.155	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.541,18	Pós-Fixado	61.382.202,90
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	2.541,18	Pós-Fixado	61.382.202,90
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN_A539	14/12/99	14/12/99	15/7/2011	24.155	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.541,18	Pós-Fixado	61.382.202,90
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	2.541,18	Pós-Fixado	61.382.202,90
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	2.541,18	Pós-Fixado	61.382.202,90
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	2.541,18	Pós-Fixado	61.382.202,90
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	2.541,18	Pós-Fixado	61.382.202,90
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	2.541,18	Pós-Fixado	61.382.202,90
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	2.541,18	Pós-Fixado	58.907.093,58
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	2.541,18	Pós-Fixado	58.907.093,58
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	2.541,18	Pós-Fixado	58.907.093,58
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	2.541,18	Pós-Fixado	58.907.093,58
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	2.541,18	Pós-Fixado	58.907.093,58
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	2.541,18	Pós-Fixado	58.907.093,58
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	2.541,18	Pós-Fixado	58.907.093,58
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	2.541,18	Pós-Fixado	58.907.093,58
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	2.541,18	Pós-Fixado	58.907.093,58
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	2.541,18	Pós-Fixado	58.907.093,58
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN_A555	14/12/99	14/12/99	15/11/2012	23.181	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.541,18	Pós-Fixado	58.907.093,58
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN_A556	14/12/99	14/12/99	15/12/2012	23.181	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.541,18	Pós-Fixado	58.907.093,58
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN_A557	14/12/99	14/12/99	15/1/2013	22.230	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.541,18	Pós-Fixado	56.490.431,40
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN_A558	14/12/99	14/12/99	15/2/2013	22.230	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.541,18	Pós-Fixado	56.490.431,40
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN_A559	14/12/99	14/12/99	15/3/2013	22.230	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.541,18	Pós-Fixado	56.490.431,40
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN_A560	14/12/99	14/12/99	15/4/2013	22.230	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.541,18	Pós-Fixado	56.490.431,40
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN_A561	14/12/99	14/12/99	15/5/2013	22.230	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.541,18	Pós-Fixado	56.490.431,40
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN_A562	14/12/99	14/12/99	15/6/2013	22.230	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.541,18	Pós-Fixado	56.490.431,40
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN_A563	14/12/99	14/12/99	15/7/2013	22.230	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.541,18	Pós-Fixado	56.490.431,40
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN_A564	14/12/99	14/12/99	15/8/2013	22.230	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.541,18	Pós-Fixado	56.490.431,40
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN_A565	14/12/99	14/12/99	15/9/2013	22.230	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.541,18	Pós-Fixado	56.490.431,40
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN_A566	14/12/99	14/12/99	15/10/2013	22.230	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.541,18	Pós-Fixado	56.490.431,40
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN_A567	14/12/99	14/12/99	15/11/2013	22.230	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.541,18	Pós-Fixado	56.490.431,40
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN_A568	14/12/99	14/12/99	15/12/2013	22.230	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.541,18	Pós-Fixado	56.490.431,40
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN_A569	14/12/99	14/12/99	15/1/2014	19.128	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.541,18	Pós-Fixado	48.607.691,04
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN_A570	14/12/99	14/12/99	15/2/2014	19.128	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.541,18	Pós-Fixado	48.607.691,04
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN_A571	14/12/99	14/12/99	15/3/2014	19.128	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.541,18	Pós-Fixado	48.607.691,04
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN_A572	14/12/99	14/12/99	15/4/2014	19.128	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.541,18	Pós-Fixado	48.607.691,04
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN_A573	14/12/99	14/12/99	15/5/2014	19.128	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.541,18	Pós-Fixado	48.607.691,04
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN_A574	14/12/99	14/12/99	15/6/2014	19.128	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.541,18	Pós-Fixado	48.607.691,04
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN_A575	14/12/99	14/12/99	15/7/2014	19.128	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.541,18	Pós-Fixado	48.607.691,04
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN_A576	14/12/99	14/12/99	15/8/2014	19.128	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.541,18	Pós-Fixado	48.607.691,04
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN_A577	14/12/99	14/12/99	15/9/2014	19.128	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.541,18	Pós-Fixado	48.607.691,04
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN_A578	14/12/99	14/12/99	15/10/2014	19.128	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.541,18	Pós-Fixado	48.607.691,04
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN_A579	14/12/99	14/12/99	15/11/2014	19.128	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.541,18	Pós-Fixado	48.607.691,04
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN_A580	14/12/99	14/12/99	15/12/2014	19.304	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.541,18	Pós-Fixado	49.054.938,72
1.040.349												2.643.714.071,82

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 31/01/2011 - RIOPREVIDÊNCIA

AÇÕES	TIPO	QTD	COTAÇÃO 31/1/2011	VALOR	
Embratel Participações S/A	EBTP4	100.000/ lote mil	900.000	9,32	R\$ 8.388,00
Brasil Telecom S/A	BRT03	100/unit.	92	17,29	R\$ 1.590,68
TOTAL					R\$ 9.978,68

Fonte: Banco Itaú