



---

# **DIRETORIA DE INVESTIMENTOS**

## **Relatório Mensal de Investimentos**

### **DEZEMBRO**

---

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 – Assessor de Risco - DIN - mat. 180.313-9

## RELATÓRIO MENSAL DE INVESTIMENTOS

Dezembro de 2011

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA DO RIOPREVIDÊNCIA		(R\$)
<b>A - Disponível</b>		<b>1.992.629.552</b>
<b>B - Segmento de Renda Fixa</b>		<b>870.844.443</b>
1 - Carteiras Próprias		662.113.045
2 - Operação Compromissada - Lastro: TPF		208.731.399
<b>C - Segmento de Imóveis</b>		<b>193.202.445</b>
1 - Carteiras Próprias		193.202.445
<b>D - Fundos de Investimento</b>		<b>928.582.663</b>
1 - Fundos de Curto Prazo		0
2 - Fundos Referenciados DI		928.582.663
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 dezembro se apresentou conforme as tabelas abaixo, dentro dos limites estabelecidos na Resolução nº 3.922/10 do CMN, e do Plano Anual de Investimentos.

Dezembro de 2011

Posição consolidada da carteira do RIOPREVIDÊNCIA por tipo de risco	(R\$)	(% do total)
<b>1- Títulos Públicos Federais</b>	<b>1.562.610.687</b>	<b>78,4%</b>
1.1 - Prefixados (LTN, NTN-F)	6.457.970	0,3%
1.2 - Pós-fixados (LFT - Selic, LTN com DI-1 Selic, Op.Comp.)	891.020.847	44,7%
1.3 - IPCA (NTN-B)	3.018.825	0,2%
1.4 - IGP-DI (CFT - Carteira Própria)	662.113.045	33,2%
<b>2- Títulos Privados de Renda Fixa</b>	<b>236.307.991</b>	<b>11,9%</b>
2.1 - Emissores de baixo risco de crédito (I)	201.610.596	10,1%
2.2 - Cotas de Fundos (II)	34.697.395	1,7%
<b>3- Tesouraria (III)</b>	<b>508.429</b>	<b>0,0%</b>
<b>4- Imóveis (IV)</b>	<b>193.202.445</b>	<b>9,7%</b>
<b>Total da Carteira</b>	<b>1.992.629.552</b>	<b>100,0%</b>

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

(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 Perfil investido no Fundo BB TOP Tradicional e no BB Top Arrojado, do Fundo HSBC DI LP, investido no HSBC DI CASH I e CASH II e do Bradesco Premium investido no CEEE III-GT, FIDC Energisa e outros.

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

(IV) Refere-se ao valor apurado em 30/11/2011.

Dezembro de 2011

**Posição da Carteira em 30/12/2011, 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>662.113.045</u>	<u>1,09%</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>928.582.663</u>	<u>1,53%</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>208.731.399</u>	<u>0,34%</u>	2,1%	Até 15,0%
<b>Total Renda Fixa</b>		<b><u>1.799.427.106</u></b>	<b><u>2,96%</u></b>		
<b>Total do Ativo (III) (Res. 3.922/10)</b>		<b><u>60.708.095.135</u></b>			

**Imóveis (IV) Terrenos e Edificações 193.202.445**

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

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 dos Fundos : Caixa FI Brasil , BB RPPS Perfil , Bradesco Premium e HSBC FI C que permite a alocação em títulos privados de baixo risco de crédito.

(III) Valor total do Ativo em 30/11/2011.

(IV) Refere-se ao valor apurado em 30/11/2011.

(V) Refere-se ao valor do ativo total apurado em 30/11/2011

**Em dezembro, 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, 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.**

Dezembro de 2011

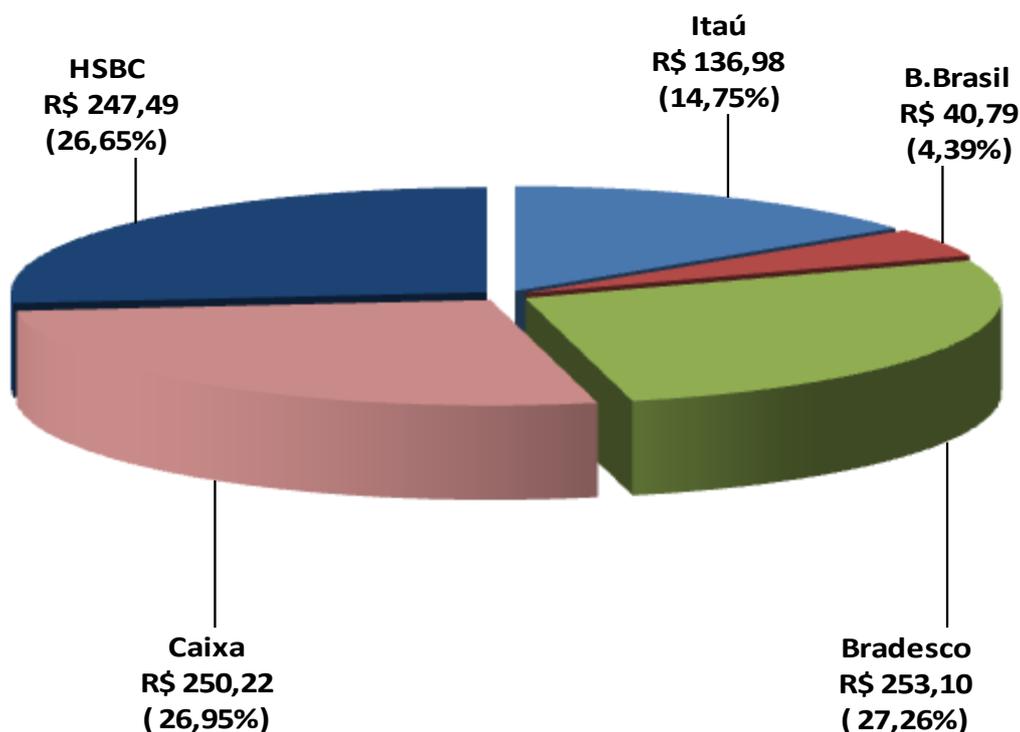
Fundos de Investimento			Participação do RIOPREVIDÊNCIA nos Fundos de Investimento				Rent. Acum. (%)			Tx. Adm.	
Nome do Fundo	Tipo de Fundo	Gestor	Quantidade Total de Cotas	Valor Unitário das Cotas	PL dos Fundos R\$ MM	Part. % no PL dos Fundos	Valor dos Fundos R\$ MM	Mês	Ano	12 Meses	(% a.a.)
FI Brasil REF DI LP	REF DI	CAIXA	320.829.901,43	1,75879	564,27	24,95%	140,76	0,93	11,77	11,77	0,20
ITAÚ -Soberano -REF. DI LP	REF DI	ITAÚ	136.932.501,50	23,13316	3.167,68	3,81%	120,55	0,90	11,45	11,45	0,15
ITAÚ -Institucional -REF. DI	REF DI	ITAÚ	236.042,42	1.496,14	353,15	4,65%	16,43	0,92	11,82	11,82	0,18
BB RPPS Perfil FIC de FI (I)	R Fixa	BBDTVM	181.024.561,65	1,07899	195,32	20,88%	40,79	0,91	7,90	-	0,20
FI RF DI Federal Extra	REF DI	BRAM-Asset	565.434.791,08	5,76471	3.259,57	7,46%	243,06	0,90	11,45	11,45	0,15
FI RF DI Premium	REF DI	BRAM-Asset	416.393.283,78	5,72738	2.384,84	0,42%	10,04	0,98	11,92	11,92	0,20
FI Aliança-Renda Fixa	R Fixa	CAIXA	257.581.287,50	2,01711	519,57	21,07%	109,46	0,89	11,96	11,96	0,20
HSBC FI REF. DI LP	REF DI	HSBC	694.615.785,53	14,33237	9.955,49	2,49%	247,49	0,94	11,94	11,94	0,15
<b>TOTAL</b>							<b>928,58</b>				

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

(I) Fundo criado em abril/2011.

No encerramento do mês de dezembro, as aplicações financeiras em fundos de investimento totalizaram R\$ 928.582.662,89 distribuídos da forma abaixo:

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



#### Operações Compromissadas

Dezembro 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	8/12/2011	9/4/2012	100,10% do CDI	LTN	255.581	816,694	208.731.398,81

**TOTAL** 208.731.398,81

Fonte: Bradesco

(I) - Posição em 30-12-2011

**Carteira Própria Certificados Financeiros do Tesouro - Posição em Dezembro 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_A545	14/12/99	14/12/99	15/1/2012	23.181	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.672,44	Pós-Fixado	61.949.831,64
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	2.672,44	Pós-Fixado	61.949.831,64
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	2.672,44	Pós-Fixado	61.949.831,64
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	2.672,44	Pós-Fixado	61.949.831,64
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	2.672,44	Pós-Fixado	61.949.831,64
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	2.672,44	Pós-Fixado	61.949.831,64
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	2.672,44	Pós-Fixado	61.949.831,64
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	2.672,44	Pós-Fixado	61.949.831,64
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	2.672,44	Pós-Fixado	61.949.831,64
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	2.672,44	Pós-Fixado	61.949.831,64
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	2.672,44	Pós-Fixado	42.614.728,24
<b>247.756</b>											<b>662.113.044,64</b>	

Fonte: Rioprevidência / Itaú Custódia