



---

# **DIRETORIA DE INVESTIMENTOS**

## **Relatório Mensal de Investimentos**

### **AGOSTO**

---

**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

Agosto de 2011

| CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA DO RIOPREVIDÊNCIA |  | (R\$)                |
|--|--|----------------------|
| <b>A - Disponível</b>                      |  | <b>2.631.524.482</b> |
| <b>B - Segmento de Renda Fixa</b>          |  | <b>1.257.342.630</b> |
| 1 - Carteiras Próprias                     |  | 900.443.371          |
| 2 - Operação Compromissada - Lastro: TPF   |  | 356.899.259          |
| <b>C - Segmento de Imóveis</b>             |  | <b>234.260.670</b>   |
| 1 - Carteiras Próprias                     |  | 234.260.670          |
| <b>D - Fundos de Investimento</b>          |  | <b>1.139.921.182</b> |
| 1 - Fundos de Curto Prazo                  |  | 0                    |
| 2 - Fundos Referenciados DI                |  | 885.431.252          |
| 3 - Fundos de Renda Fixa RF IMA            |  | 254.489.930          |
| 4 - Fundos Multimercado                    |  | 0                    |
| 5 - Fundos de Ações                        |  | 0                    |

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

Agosto de 2011

| Posição consolidada da carteira do RIOPREVIDÊNCIA por tipo de risco | (R\$)                | (% do total)   |
|---|----------------------|----------------|
| <b>1- Títulos Públicos Federais</b>                                 | <b>2.329.591.214</b> | <b>85,45%</b>  |
| 1.1 - Prefixados (LTN, NTN-F)                                       | 214.808.606          | 0,93%          |
| 1.2 - Pós-fixados (LFT - Selic, LTN com DI-1 Selic, Op. Comp.)      | 1.214.118.335        | 32,87%         |
| 1.3 - IPCA (NTN-B)  | 220.902              | 0,01%          |
| 1.4 - IGP-DI (CFT - Carteira Própria)                               | 900.443.371          | 51,65%         |
| <b>2- Títulos Privados de Renda Fixa</b>                            | <b>66.583.190</b>    | <b>2,09%</b>   |
| 2.1 - Emissores de baixo risco de crédito (I)                       | 66.253.610           | 2,08%          |
| 2.2 - Cotas de Fundos (II)  | 329.580              | 0,01%          |
| <b>3- Tesouraria (III)</b>  | <b>1.089.408</b>     | <b>0,00%</b>   |
| <b>4- Imóveis (IV)</b>  | <b>234.260.670</b>   | <b>12,46%</b>  |
| <b>Total da Carteira</b>  | <b>2.631.524.482</b> | <b>100,00%</b> |

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

(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, BB RPPS Liquidez, BB RPPS Perfil, Caixa BR IRFM-1, Caixa Brasil DI e Bradesco Federal Extra.

(IV) Refere-se ao valor apurado em 31/07/2011

Agosto 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>900.443.371</u>          | <u>1,45%</u>        | 100,0%                    | Até 100,0%                 |
| Renda Fixa (I)          | FI/FIC RF ou Referenciado                   | <u>254.489.930</u>          | <u>0,41%</u>        | 80,0%                     | Até 80,0%                  |
| Renda Fixa (II)         | FI/FIC RF ou Referenciado                   | <u>885.431.252</u>          | <u>1,42%</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>356.899.259</u>          | <u>0,57%</u>        | 2,1%                      | Até 15,0%                  |
| <b>Total Renda Fixa</b> |   | <b><u>2.397.263.812</u></b> | <b><u>3,85%</u></b> |                           |                            |

**Total do Ativo (III) (Res. 3.922/10) 62.224.572.390**

**Imóveis (IV) Terrenos e Edificações 234.260.670**

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

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 31/07/2011.

(IV) Refere-se ao valor apurado em 31/07/2011.

Em agosto, 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.

Agosto de 2011

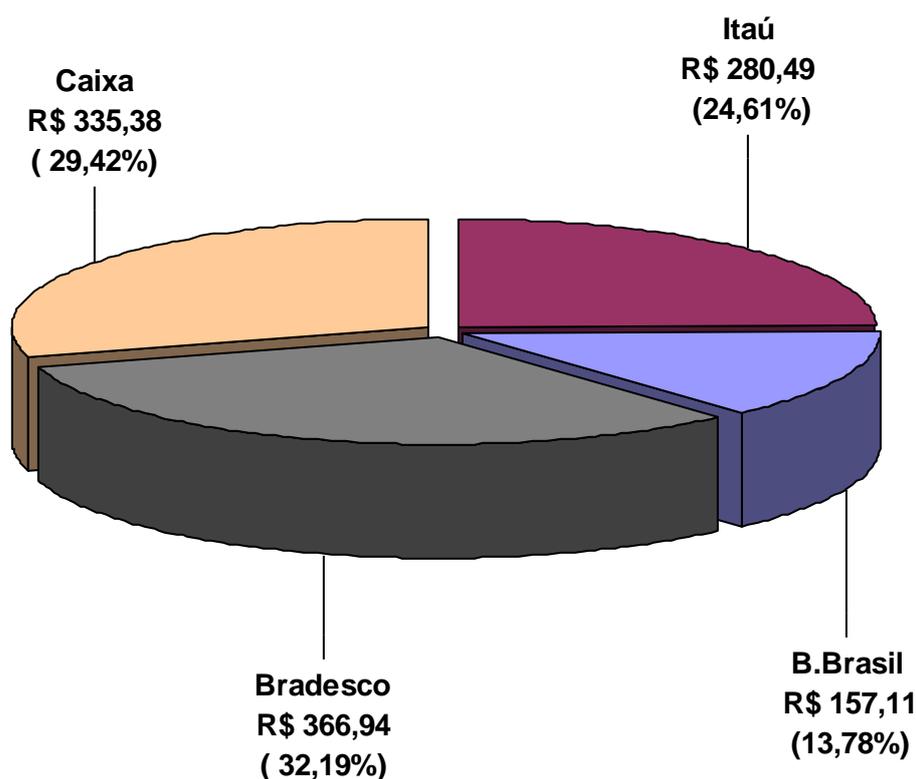
| Fundos de Investimento       | Participação do RIOPREVIDÊNCIA nos Fundos de Investimento |          |                           |                          |                      |                          | Rent. Acum. (%)         |      |      | Tx. Adm. |          |
|------------------------------|---|----------|---------------------------|--------------------------|----------------------|--------------------------|-------------------------|------|------|----------|----------|
| 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    | 514.741.977,11            | 1,69620                  | 873,10               | 22,82%                   | 199,25                  | 1,08 | 7,79 | 11,50    | 0,20     |
| ITAÚ -Soberano -REF. DI LP   | REF DI  | ITAÚ     | 134.561.556,26            | 22,33062                 | 3.004,84             | 9,33%                    | 280,49                  | 1,06 | 7,58 | 11,21    | 0,15     |
| BB RPPS Perfil FIC de FI (I) | R Fixa  | BBDTVM   | 139.215.117,14            | 1,04074                  | 144,89               | 21,80%                   | 31,58                   | 1,08 | 4,07 | 4,07     | 0,20     |
| FI RF DI Federal Extra       | REF DI  | BRADESCO | 568.747.523,65            | 5,56447                  | 3.164,78             | 11,59%                   | 366,94                  | 1,06 | 7,58 | 11,22    | 0,15     |
| FI Brasil IRF-M1 TP RF       | R Fixa  | CAIXA    | 1.172.855.151,67          | 1,14983                  | 1.348,59             | 9,56%                    | 128,96                  | 1,57 | 8,15 | 11,71    | 0,20     |
| FI Aliança-Renda Fixa        | R Fixa  | CAIXA    | 300.198.341,62            | 1,94537                  | 584,00               | 1,23%                    | 7,17                    | 1,41 | 7,98 | 11,67    | 0,20     |
| BB RPPS Liquidez FIC de FI   | R Fixa  | BBDTVM   | 1.484.655.383,14          | 1,20997                  | 1.796,38             | 6,99%                    | 125,53                  | 1,56 | 8,07 | 11,58    | 0,30     |
| <b>TOTAL</b>                 |   |          |                           |                          |                      |                          | <b>1.139,92</b>         |      |      |          |          |

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

(I) Fundo criado em abril/2011.

No encerramento do mês de agosto, as aplicações financeiras em fundos de investimento totalizaram R\$ 1.139.921.182,25 distribuídos da forma abaixo:

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



**Operações Compromissadas**

Agosto 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 | 10/5/2011           | 8/9/2011               | 100,10% do CDI | LTN    | 183.595    | 846,983         | 155.501.841,00             |
| <b>BRADESCO</b> | 60746948/0001-12 | 10/8/2011           | 8/12/2011              | 100,10% do CDI | LTN    | 235.168    | 856,398         | 201.397.418,00             |
| <b>TOTAL</b>    |                  |                     |                        |                |        |            |                 | <b>356.899.259,00</b>      |

Fonte: Caixa

(I) - Posição em 31-08-2011



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

**Carteira Própria**

**Certificados Financeiros do Tesouro - Posição em Agosto de 2011**

| Custodiante     | Ativo | Código    | Data de Emissão | Data de Compra | Data de Vencimento | Quantidade     | Indexador | Cupom/<br>Taxa (%aa) | PU Compra<br>(R\$) | PU Atual<br>(R\$) | Característica<br>do Título | Valor<br>Financeiro<br>(R\$) |
|-----------------|-------|-----------|-----------------|----------------|--------------------|----------------|-----------|----------------------|--------------------|-------------------|-----------------------------|------------------------------|
| 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           | 2.614,71          | Pós-Fixado                  | 63.158.320,05                |
| 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           | 2.614,71          | Pós-Fixado                  | 63.158.320,05                |
| 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           | 2.614,71          | Pós-Fixado                  | 63.158.320,05                |
| 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           | 2.614,71          | Pós-Fixado                  | 63.158.320,05                |
| 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           | 2.614,71          | Pós-Fixado                  | 60.611.592,51                |
| 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           | 2.614,71          | Pós-Fixado                  | 60.611.592,51                |
| 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           | 2.614,71          | Pós-Fixado                  | 60.611.592,51                |
| 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           | 2.614,71          | Pós-Fixado                  | 60.611.592,51                |
| 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           | 2.614,71          | Pós-Fixado                  | 60.611.592,51                |
| 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           | 2.614,71          | Pós-Fixado                  | 60.611.592,51                |
| 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           | 2.614,71          | Pós-Fixado                  | 60.611.592,51                |
| 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           | 2.614,71          | Pós-Fixado                  | 60.611.592,51                |
| 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           | 2.614,71          | Pós-Fixado                  | 60.611.592,51                |
| 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           | 2.614,71          | Pós-Fixado                  | 60.611.592,51                |
| 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           | 2.614,71          | Pós-Fixado                  | 41.694.165,66                |
|                 |       |           |                 |                |                    | <b>344.376</b> |           |                      |                    |                   |                             | <b>900.443.370,96</b>        |