



DIRETORIA DE INVESTIMENTOS

Relatório Mensal de Investimentos

ABRIL

**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

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

Abril de 2011

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA DO RIOPREVIDÊNCIA		(R\$)
A - Disponível		2.219.905.805
B - Segmento de Renda Fixa		1.962.579.736
1 - Carteiras Próprias		1.911.737.544
2- Operação Compromissada - Lastro: TPF		50.842.193
C - Segmento de Renda Variável		9.292
1 - Ativos em Enquadramento - Ações		9.292
D - Segmento de Imóveis		197.692.925
1 - Carteiras Próprias		197.692.925
E - Fundos de Investimento		59.623.852
1 - Fundos de Curto Prazo		0
2 - Fundos Referenciados DI		56.316.501
3 - Fundos de Renda Fixa RF IMA		3.307.351
4 - Fundos Multimercado		0
5 - Fundos de Ações		0

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

Abril de 2011

Posição consolidada da carteira do RIOPREVIDÊNCIA por tipo de risco	(R\$)	(% do total)
1- Títulos Públicos Federais	<u>2.016.780.228</u>	<u>90,85%</u>
1.1 - Prefixados (LTN, NTN-F)	2.643.442	0,12%
1.2 - Pós-fixados (LFT - Selic, LTN com DI-1 Selic, Op.Comp.)	102.399.242	4,61%
1.3 - IPCA (NTN-B)	0	0,00%
1.4 - IGP-DI (CFT - Carteira Própria)	1.911.737.544	86,12%
2- Títulos Privados	<u>5.422.127</u>	<u>0,24%</u>
2.1 - Emissores de baixo risco de crédito (I)	5.422.127	0,24%
3- Tesouraria (II)	<u>1.234</u>	<u>0,00%</u>
4- Imóveis (III)	<u>197.692.925</u>	<u>8,91%</u>
5- Ativos em enquadramento - Ações (IV)	<u>9.292</u>	<u>0,00%</u>
Total da Carteira	<u>2.219.905.805</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) Recursos mantidos em Tesouraria nos Fundos: Itaú Soberano, BNP Paribas Fix, BB RPPS Liquidez, BB Comercial 17, Caixa Soberano, Caixa Brasil DI e Bradesco Federal Extra.

(III) Refere-se ao valor apurado em 30/04/2011

(IV) Ativos em enquadramento recebidos do IPERJ

Abril 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>1.911.737.544</u>	<u>2,99%</u>	100,0%	Até 100,0%
Renda Fixa (I)	FI/FIC RF ou Referenciado	<u>1.666.633</u>	<u>0,00%</u>	80,0%	Até 80,0%
Renda Fixa (II)	FI/FIC RF ou Referenciado	<u>57.957.220</u>	<u>0,09%</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>50.842.193</u>	<u>0,08%</u>	2,1%	Até 15,0%
Renda Variável (III)	Ações (em enquadramento)	<u>9.292</u>	<u>0,00%</u>	N.A.	Até 30,0%
Total Renda Fixa e Variável		<u>2.022.212.881</u>	<u>3,16%</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
(I V) Valor total do Ativo em 30/04/2011.
(V) Refere-se ao valor apurado em 30/04/2011.

Em abril, 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.

Abril 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	277.966.295,22	1,62883	452,76	4,40%	19,94	0,84	3,51	10,62	0,20
Itaú -SOBERANO-REF. DI LP	REF DI	ITAÚ	133.329.218,56	21,47443	2.863,17	0,86%	24,65	0,83	3,45	10,45	0,15
BB COMERCIAL 17 FICFI	REF DI	BBDTVM	206.190.143,46	2,75154	567,34	0,25%	1,43	0,82	3,39	10,32	0,30
FI RF DI FEDERAL EXTRA	REF DI	BRADESCO	537.718.300,10	5,35106	2.877,36	0,36%	10,29	0,83	3,46	10,45	0,15
FI BRASIL SOBERANO RF (I)	R Fixa	CAIXA	420.285.970,75	1,09991	462,28	0,13%	0,62	0,77	3,46	-	0,20
BB RPPS LIQUIDEZ FIC FI (II)	R Fixa	BBDTVM	1.104.427.835,45	1,15784	1.278,75	0,13%	1,64	0,76	3,41	-	0,30
BNP Paribas Fix IRFM-1 (III)	R Fixa	BNP Asset	107.897,14	107,15494	11,56	9,02%	1,04	0,73	3,41	-	0,20
TOTAL							59,62				

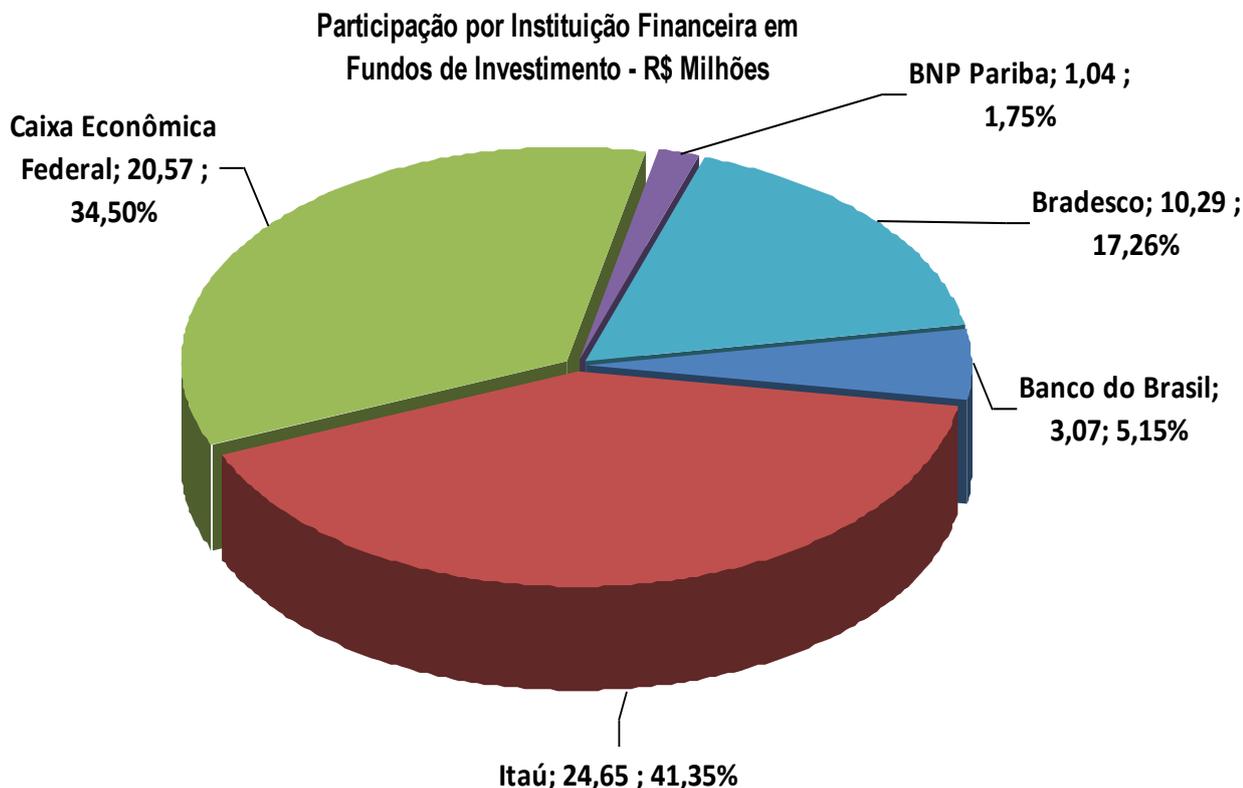
Fonte: RIOPREVIDÊNCIA, B.Brasil, Bradesco, Caixa, B.Itaú, BNP Paribas.

(I) Fundo adaptado em maio/2010.

(II) Fundo adaptado em jun/2010.

(III) Fundo criado em agosto/2010.

No encerramento do mês de abril, as aplicações financeiras em fundos de investimento totalizaram R\$ 59.623.852,36, distribuídos da forma abaixo:



Operações Compromissadas

Abril 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	812,150	50.842.192,65
TOTAL								50.842.192,65

Fonte: Caixa

(I) - Posição em 29-04-2011

Carteira Própria Certificados Financeiros do Tesouro - Posição em Abril 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_A537	14/12/99	14/12/99	15/5/2011	24.155	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.606,39	Pós-Fixado	62.957.350,45
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	2.606,39	Pós-Fixado	62.957.350,45
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	2.606,39	Pós-Fixado	825.287.329,60
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	2.606,39	Pós-Fixado	62.957.350,45
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	2.606,39	Pós-Fixado	62.957.350,45
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	2.606,39	Pós-Fixado	62.957.350,45
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	2.606,39	Pós-Fixado	62.957.350,45
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	2.606,39	Pós-Fixado	62.957.350,45
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	2.606,39	Pós-Fixado	60.418.726,59
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	2.606,39	Pós-Fixado	60.418.726,59
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	2.606,39	Pós-Fixado	60.418.726,59
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	2.606,39	Pós-Fixado	60.418.726,59
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	2.606,39	Pós-Fixado	60.418.726,59
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	2.606,39	Pós-Fixado	60.418.726,59
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	2.606,39	Pós-Fixado	60.418.726,59
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	2.606,39	Pós-Fixado	60.418.726,59
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	2.606,39	Pós-Fixado	60.418.726,59
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	2.606,39	Pós-Fixado	60.418.726,59
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	2.606,39	Pós-Fixado	41.561.494,94
733.481												1.911.737.543,59

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 29/04/2011 - RIOPREVIDÊNCIA

AÇÕES	TIPO	QTD	COTAÇÃO 29/4/2011	VALOR	
Embratel Participações S/A	EBTP4	100.000/ lote mil	900.000	8,60	R\$ 7.740,00
Brasil Telecom S/A	BRT03	100/unit.	92	16,87	R\$ 1.552,04
TOTAL				R\$ 9.292,04	

Fonte: Banco Itaú