



DIRETORIA DE INVESTIMENTOS

Relatório Mensal de Investimentos

NOVEMBRO

Rio de Janeiro
2010

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

RELATÓRIO MENSAL DE INVESTIMENTOS

Novembro de 2010

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA DO RIOPREVIDÊNCIA	
A - Disponível	3.980.021.071
B - Segmento de Renda Fixa	3.252.369.502
1 - Carteiras Próprias	2.750.158.719
2 - Operação Compromissada - Lastro: TPF	502.210.783
C - Segmento de Renda Variável	41.546
1 - Ativos em Enquadramento - Ações	41.546
D - Segmento de Imóveis	362.692.863
1 - Carteiras Próprias	362.692.863
E - Fundos de Investimento	364.917.159
1 - Fundos de Curto Prazo	0
2 - Fundos Referenciados DI	294.016.407
3 - Fundos de Renda Fixa RF IMA	70.900.752
4 - Fundos Multimercado	0
5 - Fundos de Ações	0

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

Novembro de 2010

Posição consolidada da carteira do RIOPREVIDÊNCIA por tipo de risco	(R\$)	(% do total)
1- Títulos Públicos Federais	3.604.476.460	90,56%
1.1 - Prefixados (LTN, NTN-F)	95.035.059	2,39%
1.2 - Pós-fixados (LFT - Selic, LTN com DI-1 Selic, Op.Comp.)	756.984.282	19,02%
1.3 - IPCA (NTN-B)	2.298.399	0,06%
1.4 - IGP-DI (CFT - Carteira Própria)	2.750.158.719	69,10%
2- Títulos Privados	12.649.020	0,32%
2.1 - Emissores de baixo risco de crédito (I)	12.649.020	0,32%
3- Tesouraria (II)	161.181	0,00%
4- Imóveis	362.692.863	9,11%
5- Ativos em enquadramento - Ações (III)	41.546	0,00%
Total da Carteira	3.980.021.071	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 e Santander FIC.

(III) Ativos em enquadramento recebidos do IPERJ

Novembro de 2010

Segmento	Tipo de Ativo	Valores (R\$)	% (IV)	Limites PAI (% total)	Limite da Res. nº 3.922/10
Renda Fixa	TPF	<u>2.750.158.719</u>	<u>69,10%</u>	60% - 100%	Até 100%
Renda Fixa (I)	FI/FIC RF ou Referenciado	<u>294.016.407</u>	<u>7,39%</u>	0% - 30%	Até 30%
Renda Fixa (II)	FI/FIC RF ou Referenciado	<u>70.900.752</u>	<u>1,78%</u>	0% - 80%	Até 80%
Renda Fixa	Op. Compromissada com TPF	<u>502.210.783</u>	<u>12,62%</u>	0% - 15%	Até 15%
Imóveis	Imóveis ou FII	<u>362.692.863</u>	<u>9,11%</u>	0% - 10%	Sem Limite
Renda Variável (III)	Ações (em enquadramento)	<u>41.546</u>	<u>0,00%</u>	-	-
Total		3.980.021.071	100,00%		

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

Glossário:

TPF - Título Público Federal

FI/FIC - Fundos de Investimento

FII - Fundo de Investimento Imobiliário

PAI - Plano Anual de Investimentos (Limites inferior e superior definidos no PAI)

(I) Qualquer indicador de desempenho de Renda Fixa.

(II) Subíndices do IMA ou do IDKA, exceto subíndice atrelado a taxa de juros de 1 dia. 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) Percentuais calculados com base nas receitas correntes.

Em novembro, 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. Destacam-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.

Novembro de 2010

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			Tx. Adm. (% a.a.)	
							Mês	Ano	12 Meses		
FI BRASIL REF DI LP	REF DI	CAIXA	179.838.936,14	1,55889	280,35	18,85%	52,86	0,81	8,71	9,44	0,20
FI CAIXA ALIANÇA RF	R. Fixa	CAIXA	453.086.046,40	1,78444	808,51	12,86%	104,00	0,73	9,04	9,71	0,20
Itaú -SOBERANO-REF. DI LP	REF DI	ITAÚ	161.519.896,16	20,56936	3.322,36	2,22%	73,92	0,80	8,60	9,38	0,15
BB COMERCIAL 17 FICFI	REF DI	BBDTVM	278.768.045,42	2,63724	735,18	5,34%	39,26	0,75	8,48	9,24	0,20
FI BRASIL SOBERANO RF (I)	REF DI	CAIXA	373.848.563,40	1,05315	393,72	17,41%	68,55	0,63	5,32	-	0,20
BB RPPS LIQUIDEZ FIC FI (II)	R Fixa	BBDTVM	894.011.566,22	1,10931	991,74	2,32%	22,97	0,64	5,55	-	0,30
SANTANDER FIC RF IRF-M1 (III)	R Fixa	Sant. Asset	18.687.685,98	10,67460	199,48	0,50%	1,00	0,63	5,26	-	0,40
BNP Paribas Fix IRFM-1 (IV)	REF DI	BNP Asset	164.881,60	102,68066	16,93	13,87%	2,35	0,60	2,68	-	0,20
TOTAL							364,91				

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

(I) Fundo adaptado em maio/2010.

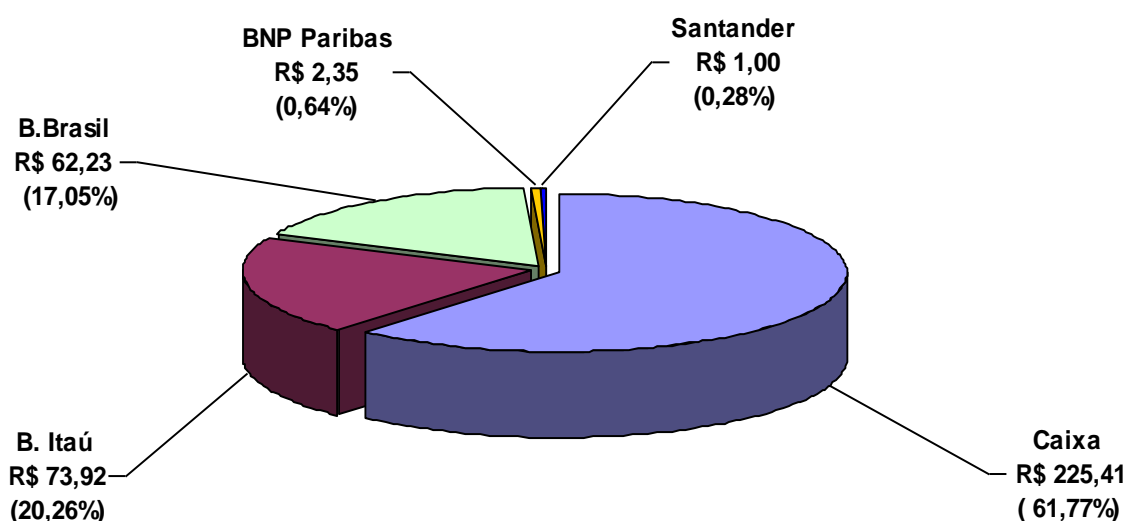
(III) Fundo adaptado em maio/2010.

(II) Fundo adaptado em jun/2010.

(IV) Fundo adaptado em agosto/2010.

No encerramento do mês de novembro, as aplicações financeiras em fundos de investimento totalizaram R\$ 364.917.159,00, distribuídos da forma abaixo:

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



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 serão vendidas até o final de 2010.

Ativos em Enquadramento - Posição Acionária em 30/11/2010 - RIOPREVIDÊNCIA

AÇÕES	TIPO	QTD	COTAÇÃO 30/11/2010	VALOR
Telecomunicações de São Paulo S/A	TLPP3 100/unit.	41	36,89	R\$ 1.512,49
Tele Norte Celular Participações S/A	TNCP3 100/unit.	18	40,70	R\$ 732,60
Embratel Participações S/A	EBTP4 100.000/ lote mil	929.254	9,90	R\$ 9.199,61
Tele Norte Leste Participações S/A	TNLP3 100/unit.	1	30,64	R\$ 30,64
	TNLP4 100/unit.	1.146	23,90	R\$ 27.389,40
Telemar Norte Leste S/A RJ	TMAR3 100/unit.	22	61,79	R\$ 1.359,38
Brasil Telecom S/A	BRT03 100/unit.	92	14,37	R\$ 1.322,04
TOTAL				R\$ 41.546,16



Carteira Própria

Certificados Financeiros do Tesouro - Posição em Novembro de 2010

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_A532	14/12/99	14/12/99	15/12/2010	38.998	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.492,21	Pós-Fixado	97.191.205,58
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN_A533	14/12/99	14/12/99	15/1/2011	24.155	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.492,21	Pós-Fixado	60.199.332,55
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	2.492,21	Pós-Fixado	60.199.332,55
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	2.492,21	Pós-Fixado	60.199.332,55
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	2.492,21	Pós-Fixado	60.199.332,55
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	2.492,21	Pós-Fixado	60.199.332,55
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	2.492,21	Pós-Fixado	60.199.332,55
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	2.492,21	Pós-Fixado	60.199.332,55
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	2.492,21	Pós-Fixado	60.199.332,55
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	2.492,21	Pós-Fixado	60.199.332,55
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	2.492,21	Pós-Fixado	60.199.332,55
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	2.492,21	Pós-Fixado	60.199.332,55
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	2.492,21	Pós-Fixado	60.199.332,55
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	2.492,21	Pós-Fixado	57.771.920,01
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	2.492,21	Pós-Fixado	57.771.920,01
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	2.492,21	Pós-Fixado	57.771.920,01
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	2.492,21	Pós-Fixado	57.771.920,01
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	2.492,21	Pós-Fixado	57.771.920,01
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	2.492,21	Pós-Fixado	57.771.920,01
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	2.492,21	Pós-Fixado	57.771.920,01
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	2.492,21	Pós-Fixado	57.771.920,01
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	2.492,21	Pós-Fixado	57.771.920,01
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	2.492,21	Pós-Fixado	57.771.920,01
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	2.492,21	Pós-Fixado	57.771.920,01
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	2.492,21	Pós-Fixado	57.771.920,01
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	2.492,21	Pós-Fixado	55.401.828,30
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	2.492,21	Pós-Fixado	55.401.828,30
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	2.492,21	Pós-Fixado	55.401.828,30
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	2.492,21	Pós-Fixado	55.401.828,30
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	2.492,21	Pós-Fixado	55.401.828,30
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	2.492,21	Pós-Fixado	55.401.828,30
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	2.492,21	Pós-Fixado	55.401.828,30
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	2.492,21	Pós-Fixado	55.401.828,30
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	2.492,21	Pós-Fixado	55.401.828,30
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	2.492,21	Pós-Fixado	55.401.828,30
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	2.492,21	Pós-Fixado	55.401.828,30
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	2.492,21	Pós-Fixado	55.401.828,30
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	2.492,21	Pós-Fixado	47.670.992,88
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	2.492,21	Pós-Fixado	47.670.992,88
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	2.492,21	Pós-Fixado	47.670.992,88
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	2.492,21	Pós-Fixado	47.670.992,88
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	2.492,21	Pós-Fixado	47.670.992,88
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	2.492,21	Pós-Fixado	47.670.992,88
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	2.492,21	Pós-Fixado	47.670.992,88
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	2.492,21	Pós-Fixado	47.670.992,88
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	2.492,21	Pós-Fixado	47.670.992,88
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	2.492,21	Pós-Fixado	47.670.992,88
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	2.492,21	Pós-Fixado	47.670.992,88
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	2.492,21	Pós-Fixado	48.109.621,84

1.103.502

2.750.158.719,42