



DIRETORIA DE INVESTIMENTOS

Relatório Mensal de Investimentos

DEZEMBRO

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

Dezembro de 2010

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA DO RIOPREVIDÊNCIA	
A - Disponível	3.614.358.104
B - Segmento de Renda Fixa	3.201.754.756
1 - Carteiras Próprias	2.694.887.681
2- Operação Compromissada - Lastro: TPF	506.867.075
C - Segmento de Renda Variável	10.231
1 - Ativos em Enquadramento - Ações	10.231
D - Segmento de Imóveis	360.931.057
1 - Carteiras Próprias	360.931.057
E - Fundos de Investimento	51.662.060
1 - Fundos de Curto Prazo	0
2 - Fundos Referenciados DI	11.362.379
3 - Fundos de Renda Fixa RF IMA	40.299.681
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 2010

Posição consolidada da carteira do RIOPREVIDÊNCIA por tipo de risco	(R\$)	(% do total)
1- Títulos Públicos Federais	<u>3.251.250.301</u>	<u>89,95%</u>
1.1 - Prefixados (LTN, NTN-F)	32.809.488	0,91%
1.2 - Pós-fixados (LFT - Selic, LTN com DI-1 Selic, Op.Comp.)	523.553.132	14,49%
1.3 - IPCA (NTN-B)	0	0,00%
1.4 - IGP-DI (CFT - Carteira Própria)	2.694.887.681	74,56%
2- Títulos Privados	<u>2.062.479</u>	<u>0,06%</u>
2.1 - Emissores de baixo risco de crédito (I)	2.062.479	0,06%
3- Tesouraria (II)	<u>104.036</u>	<u>0,00%</u>
4- Imóveis (III)	<u>360.931.057</u>	<u>9,99%</u>
5- Ativos em enquadramento - Ações (IV)	<u>10.231</u>	<u>0,00%</u>
Total da Carteira	<u>3.614.358.104</u>	<u>100,00%</u>

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) Refere-se ao valor apurado em novembro/2010.

(IV) Ativos em enquadramento recebidos do IPERJ

Dezembro de 2010

Segmento	Tipo de Ativo	Valores (R\$)	% (V)	Limites PAI (% total)	Limite da Res. nº 3.922/10
Renda Fixa	TPF	<u>2.694.887.681</u>	<u>74,56%</u>	60% - 100%	Até 100%
Renda Fixa (I)	FI/FIC RF ou Referenciado	<u>28.536.324</u>	<u>0,79%</u>	0% - 30%	Até 30%
Renda Fixa (II)	FI/FIC RF ou Referenciado	<u>23.125.736</u>	<u>0,64%</u>	0% - 80%	Até 80%
Renda Fixa	Op. Compromissada com TPF	<u>506.867.075</u>	<u>14,02%</u>	0% - 15%	Até 15%
Imóveis (III)	Imóveis ou FII	<u>360.931.057</u>	<u>9,99%</u>	0% - 10%	Sem Limite
Renda Variável (IV)	Ações (em enquadramento)	<u>10.231</u>	<u>0,00%</u>	-	-
Total		3.614.358.104	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.

Inclui valor em cotas do Fundo Caixa FI Brasil que permite a alocação em títulos privados de baixo risco de crédito.

(II) Subíndices do IMA ou do IDKA, exceto subíndice atrelado a taxa de juros de 1 dia.

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

(IV) Ativos em enquadramento recebidos do IPERJ

(V) Percentuais calculados com base nas receitas correntes.

Em dezembro, 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.

Dezembro 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 R\$ MM	Mês	Ano	12 Meses	(% a.a.)
FI BRASIL REF DI LP	REF DI	CAIXA	144.039.397,87	1,57355	226,65	3,55%	8,04	0,94	9,73	9,73	0,20
Itaú -SOBERANO-REF. DI LP	REF DI	ITAÚ	209.081.566,13	20,75744	4.340,00	0,08%	3,29	0,91	9,60	9,60	0,15
BB COMERCIAL 17 FICFI	REF DI	BBDTVM	227.801.397,63	2,66140	606,27	0,01%	0,04	0,92	9,47	9,47	0,20
FI BRASIL SOBERANO RF (I)	REF DI	CAIXA	354.731.845,74	1,06314	377,13	5,50%	20,75	0,95	6,28	-	0,20
BB RPPS LIQUIDEZ FIC FI (II)	R Fixa	BBDTVM	980.529.835,73	1,11963	1.097,83	1,47%	16,16	0,93	5,77	-	0,30
SANTANDER FIC RF IRF-M1 (III)	R Fixa	Sant. Asset	18.825.349,27	10,77312	202,81	0,50%	1,01	0,92	6,28	-	0,40
BNP Paribas Fix IRFM-1 (IV)	REF DI	BNP Asset	117.881,60	103,62524	12,22	19,41%	2,37	0,92	3,63	-	0,20
TOTAL							51,66				

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.

Operações Compromissadas

Dezembro de 2010

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	253.433.897,70
B. Brasil	00000000000191	12/11/2010	11/3/2011	100,00% do CDI	LFT	56.498	4424,9211(III)	253.433.176,90
TOTAL								506.867.074,60

Fonte: Caixa - B. Brasil

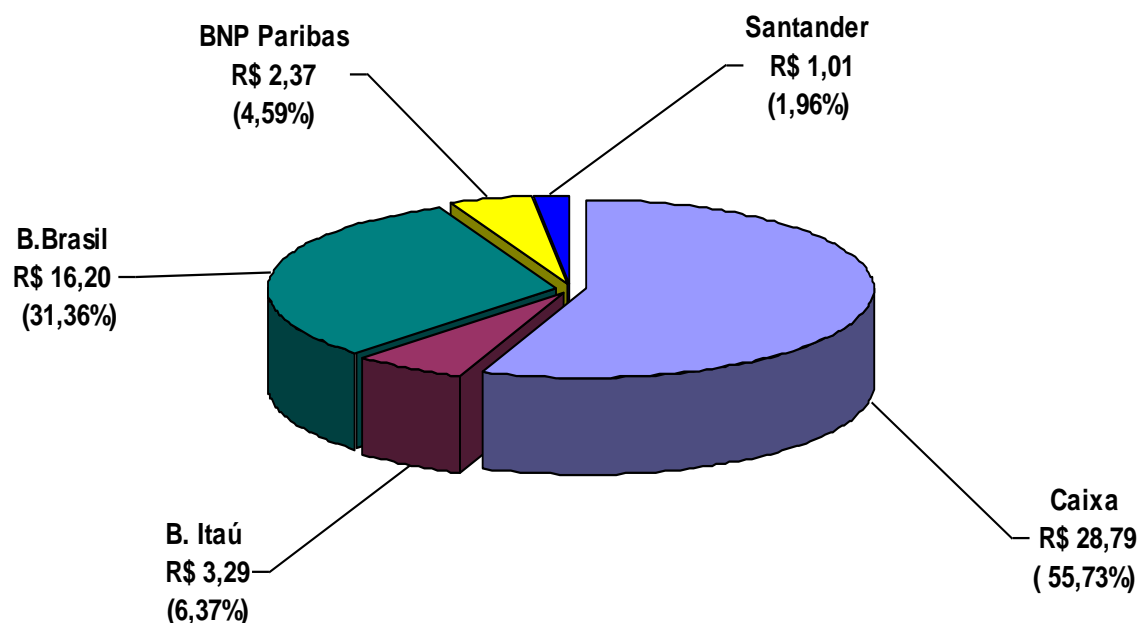
(I) - Cotação na operação inicial

(II) - Posição em 31-12-2010

(III) - Valor médio ponderado

No encerramento do mês de dezembro, as aplicações financeiras em fundos de investimento totalizaram R\$ 51.662.059,93, distribuídos da forma abaixo:

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





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

Carteira Própria

Certificados Financeiros do Tesouro - Posição em Dezembro 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_A533	14/12/99	14/12/99	15/11/2011	24.155	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.531,59	Pós-Fixado	61.150.556,45
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	2.531,59	Pós-Fixado	61.150.556,45
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	2.531,59	Pós-Fixado	61.150.556,45
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	2.531,59	Pós-Fixado	61.150.556,45
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	2.531,59	Pós-Fixado	61.150.556,45
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	2.531,59	Pós-Fixado	61.150.556,45
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	2.531,59	Pós-Fixado	61.150.556,45
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	2.531,59	Pós-Fixado	61.150.556,45
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	2.531,59	Pós-Fixado	61.150.556,45
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	2.531,59	Pós-Fixado	61.150.556,45
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	2.531,59	Pós-Fixado	61.150.556,45
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	2.531,59	Pós-Fixado	61.150.556,45
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	2.531,59	Pós-Fixado	58.684.787,79
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	2.531,59	Pós-Fixado	58.684.787,79
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	2.531,59	Pós-Fixado	58.684.787,79
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	2.531,59	Pós-Fixado	58.684.787,79
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	2.531,59	Pós-Fixado	58.684.787,79
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	2.531,59	Pós-Fixado	58.684.787,79
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	2.531,59	Pós-Fixado	58.684.787,79
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	2.531,59	Pós-Fixado	58.684.787,79
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	2.531,59	Pós-Fixado	58.684.787,79
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	2.531,59	Pós-Fixado	58.684.787,79
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	2.531,59	Pós-Fixado	58.684.787,79
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	2.531,59	Pós-Fixado	58.684.787,79
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	2.531,59	Pós-Fixado	56.277.245,70
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	2.531,59	Pós-Fixado	56.277.245,70
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	2.531,59	Pós-Fixado	56.277.245,70
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	2.531,59	Pós-Fixado	56.277.245,70
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	2.531,59	Pós-Fixado	56.277.245,70
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	2.531,59	Pós-Fixado	56.277.245,70
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	2.531,59	Pós-Fixado	56.277.245,70
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	2.531,59	Pós-Fixado	56.277.245,70
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	2.531,59	Pós-Fixado	56.277.245,70
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	2.531,59	Pós-Fixado	56.277.245,70
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	2.531,59	Pós-Fixado	56.277.245,70
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	2.531,59	Pós-Fixado	56.277.245,70
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	2.531,59	Pós-Fixado	48.424.253,52
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	2.531,59	Pós-Fixado	48.424.253,52
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	2.531,59	Pós-Fixado	48.424.253,52
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	2.531,59	Pós-Fixado	48.424.253,52
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	2.531,59	Pós-Fixado	48.424.253,52
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	2.531,59	Pós-Fixado	48.424.253,52
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	2.531,59	Pós-Fixado	48.424.253,52
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	2.531,59	Pós-Fixado	48.424.253,52
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	2.531,59	Pós-Fixado	48.424.253,52
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	2.531,59	Pós-Fixado	48.424.253,52
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	2.531,59	Pós-Fixado	48.424.253,52
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	2.531,59	Pós-Fixado	48.869.813,36

1.064.504

2.694.887.681,36

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/ 12 /2010 - RIOPREVIDÊNCIA

AÇÕES	TIPO	QTD	COTAÇÃO 30/11/2010	VALOR	
Embratel Participações S/A	EBTP4	100.000/ lote mil	900.000	9,80	R\$ 8.820,00
Brasil Telecom S/A	BRT03	100/unit.	92	15,34	R\$ 1.411,28
TOTAL					R\$ 10.231,28

Fonte: Banco Itaú