



---

# **DIRETORIA DE INVESTIMENTOS**

## **Relatório Mensal de Investimentos**

### **MARÇO**

---

**Rio de Janeiro  
2010**

## **Diretoria de Investimentos**

Antonio Paulo Vogel de Medeiros – Diretor

### **Gerência de Operações e Planejamento**

Luiz Cláudio Fernandes Lourenço Gomes – Gerente  
Flávia Affonso Teixeira – Coordenadora de Operações  
Maria de Lourdes Daumas Allevato - Coordenadora de Planejamento  
Angela Maria Monteiro Pandolfo  
Carlos Augusto Bastos Fernandes  
Ubirajara da Silva Coelho

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)

## RELATÓRIO MENSAL DE INVESTIMENTOS

MARÇO DE 2010

| CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA DO RIOPREVIDÊNCIA |                      |
|--|----------------------|
| <b>A - Disponível</b>                      | <b>4.235.330.817</b> |
| <b>B - Segmento de Renda Fixa</b>          | <b>3.580.931.179</b> |
| 1 - Carteiras Próprias                     | 3.300.106.525        |
| 2- Operação Compromissada - Lastro: TPF    | 280.824.654          |
| <b>C - Segmento de Renda Variável</b>      | <b>589.494</b>       |
| 1 - Ativos em Enquadramento - Ações        | 589.494              |
| <b>D - Segmento de Imóveis</b>             | <b>328.998.786</b>   |
| 1 - Carteiras Próprias                     | 328.998.786          |
| <b>E - Fundos de Investimento</b>          | <b>324.811.358</b>   |
| 1 - Fundos de Curto Prazo                  | 0                    |
| 2 - Fundos Referenciados DI                | 324.811.358          |
| 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 março se apresentou conforme as tabelas abaixo, dentro dos limites estabelecidos na Resolução nº 3.790/09 do CMN, da Portaria MPS nº 345 e do Plano Anual de Investimentos.

MARÇO DE 2010

| Posição consolidada da carteira do RIOPREVIDÊNCIA por tipo de risco | (R\$)                       | (% do total)          |
|---|-----------------------------|-----------------------|
| <b>1- Títulos Públicos Federais</b>                                 | <b><u>3.883.556.987</u></b> | <b><u>91,69%</u></b>  |
| 1.1 - Prefixados (LTN, NTN-F)                                       | 1.769.216                   | 0,04%                 |
| 1.2 - Pós-fixados (LFT - Selic, LTN com DI-1 Selic, Op.Comp.)       | 581.681.246                 | 13,73%                |
| 1.3 - IPCA (NTN-B)  | 0                           | 0,00%                 |
| 1.4 - IGP-DI (CFT - Carteira Própria)                               | 3.300.106.525               | 77,92%                |
| <b>2- Títulos Privados</b>  | <b><u>21.970.942</u></b>    | <b><u>0,52%</u></b>   |
| 2.1 - Emissores de baixo risco de crédito (*)                       | 21.970.942                  | 0,52%                 |
| <b>4- Tesouraria (**)</b>   | <b><u>214.608</u></b>       | <b><u>0,01%</u></b>   |
| <b>5- Imóveis</b>   | <b><u>328.998.786</u></b>   | <b><u>7,77%</u></b>   |
| <b>6- Ativos em enquadramento - Ações (***)</b>                     | <b><u>589.494</u></b>       | <b><u>0,01%</u></b>   |
| <b>Total da Carteira</b>  | <b><u>4.235.330.817</u></b> | <b><u>100,00%</u></b> |

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

(\*) Valor em Cotas dos Fundos Caixa FI Brasil RF DI LP que estão alocados em títulos privados de baixo risco de crédito

(\*\*) Recursos mantidos em Tesouraria nos Fundos: Itaú Soberano, Bradesco F. Extra RF DI e Comercial 17 - B. Brasil.

(\*\*\*) Ativos em enquadramento recebidos do IPERJ

MARÇO DE 2010

| Segmento            | Tipo de Ativo             | Valores (R\$)        | (%)            | Limites PAI<br>(% total) | Limite da Res.<br>nº 3.790/09 |
|---------------------|---------------------------|----------------------|----------------|--------------------------|-------------------------------|
| Renda Fixa          | TPF,FI/FIC 100% TPF       | <u>3.556.557.766</u> | <u>83,97%</u>  | 60% - 100%               | Até 100%                      |
| Renda Fixa (*)      | FI/FIC Referenciado       | <u>68.360.117</u>    | <u>1,61%</u>   | 0% - 30%                 | Até 80%                       |
| Renda Fixa          | Op. Compromissada com TPF | <u>280.824.654</u>   | <u>6,63%</u>   |                          | Até 15%                       |
| Imóveis             | Imóveis ou FII            | <u>328.998.786</u>   | <u>7,77%</u>   | 0% - 10%                 | Sem Limite                    |
| Renda Variável (**) | Ações ( em enquadramento) | <u>589.494</u>       | <u>0,01%</u>   | -                        | -                             |
| <b>Total</b>        |                           | <b>4.235.330.817</b> | <b>100,00%</b> |                          |                               |

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

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)

(\*) Valor em Cotas do Fundo Caixa FI Brasil RF DI LP que permite a alocação em títulos privados de baixo risco de crédito

(\*\*) Ativos em enquadramento recebidos do IPERJ

Em março, as aplicações financeiras do RIOPREVIDÊNCIA se concentraram em cotas de Fundos de Investimento Referenciado DI, cujos lastros são predominantemente títulos públicos federais, e em 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.

MARÇO DE 2010

| Fundos de Investimento |                |           | Participação do RIOPREVIDÊNCIA nos Fundos de Investimento |                          |                      |                          | Rent. Acum. (%)         |      |      | Tx. Adm. |          |
|------------------------|----------------|-----------|---|--------------------------|----------------------|--------------------------|-------------------------|------|------|----------|----------|
| Nome do Fundo          | Tipo de 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.) |
|                        | Fundo          | Fundo     |   |                          |                      |                          |                         |      |      |          |          |
| FI BRASIL REF DI LP    | RF DI          | CAIXA     | 394.081.336,90  | 1,46271                  | 576,43               | 11,86%                   | 68,36                   | 0,75 | 2,00 | 9,02     | 0,20     |
| BB COMERCIAL 17 FIC FI | RF DI          | BBDTVM    | 237.316.699,85  | 2,47901                  | 588,31               | 4,31%                    | 25,37                   | 0,75 | 1,97 | 8,72     | 0,20     |
| SOBERANO-REF. DI LP    | RF DI          | ITAÚ      | 276.190.360,67  | 19,31676                 | 5.335,10             | 3,20%                    | 170,68                  | 0,75 | 1,99 | 8,83     | 0,15     |
| FI RF DI FEDERAL EXTRA | RF DI          | BRANDESCO | 724.681.848,23  | 4,81337                  | 3.488,17             | 1,73%                    | 60,41                   | 0,75 | 1,99 | 8,83     | 0,15     |
| <b>TOTAIS</b>          |                |           |   |                          |                      |                          | <b>324,81</b>           |      |      |          |          |

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

## Operações Compromissadas

MARÇO DE 2010

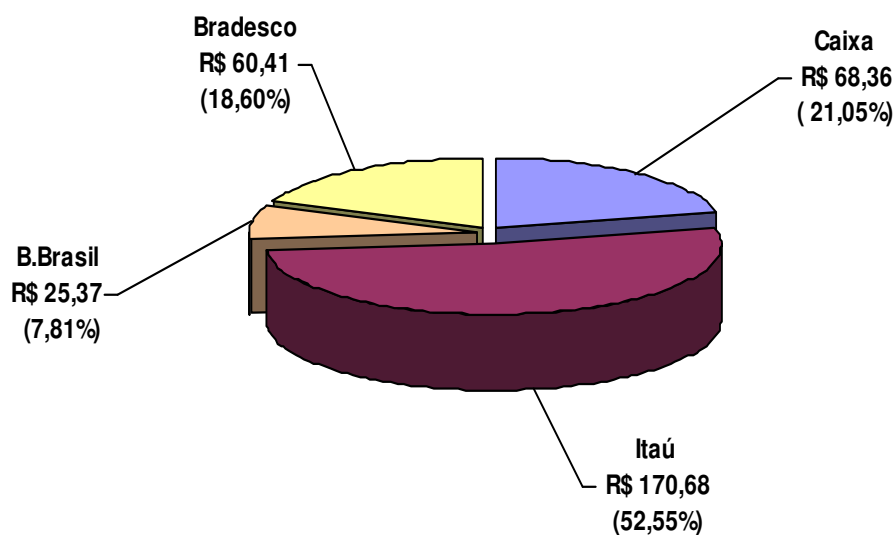
| Instituição  | CNPJ           | Data da Contratação | Vencimento da Operação | % do Indexador | Lastro | Quantidade | P. Unitário (*) | Valor (**) Financeiro (R\$) |
|--------------|----------------|---------------------|------------------------|----------------|--------|------------|-----------------|-----------------------------|
| CAIXA        | 00360305000104 | 18/1/2010           | 18/5/2010              | 100,00% do CDI | NTN-B  | 149.560    | 1.847,127       | 280.824.654,37              |
| <b>TOTAL</b> |                |                     |                        |                |        |            |                 | <b>280.824.654,37</b>       |

Fonte: Caixa

(\*) - Cotação na operação inicial

(\*\*) - Posição em 31-03-2010

### 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 3.790/09, essas ações serão vendidas até o final de 2010.

### Ativos em Enquadramento - Posição Acionária em 31/ 03/2010 - RIOPREVIDÊNCIA

| AÇÕES   | TIPO   | QTD               | COTAÇÃO<br>31/3/2010 | VALOR                 |
|---|--------|-------------------|----------------------|-----------------------|
| Brasil Telecom Participações S/A                                | B RTP3 | 100/unit.         | 929                  | R\$ 33.174,59         |
|   | B RTP4 |                   | 929                  | R\$ 19.332,49         |
| Telecomunicações de São Paulo S/A                               | TLPP3  | 100/unit.         | 941                  | R\$ 30.648,37         |
|   | TLPP4  |                   | 941                  | R\$ 36.237,91         |
| Vivo Participações S/A  | VIVO3  | 100/unit.         | 521                  | R\$ 25.268,50         |
|   | VIVO4  |                   | 521                  | R\$ 25.164,30         |
| Telemig Celular Participações S/A                               | TMCP3  | 100/unit.         | 92                   | R\$ 5.152,00          |
|   | TMCP4  |                   | 92                   | R\$ 5.354,40          |
| Tim Participações   | TCSL3  | 100/unit.         | 1.789                | R\$ 12.523,00         |
|   | TCSL4  |                   | 1.789                | R\$ 8.891,33          |
| Tele Norte Celular Participações S/A                            | TNCP3  | 100/unit.         | 18                   | R\$ 990,00            |
|   | TNCP4  |                   | 18                   | R\$ 522,00            |
| Telecomunicações Brasileiras S/A                                | TELB3  | 100.000/ lote mil | 929.258              | R\$ 1.254,50          |
|   | TELB4  |                   | 929.254              | R\$ 1.328,83          |
| Itaú Unibanco Banco Múltiplo S.A.(Itaú Holding Financeira S/A ) | ITAU3  | 100/unit.         | 9.260                | R\$ 279.374,20        |
| Embratel Participações S/A                                      | EBTP3  | 100.000/ lote mil | 929.258              | R\$ 12.730,83         |
|   | EBTP4  |                   | 929.254              | R\$ 12.823,71         |
| Tele Norte Leste Participações S/A                              | TLNP3  | 100/unit.         | 929                  | R\$ 35.487,80         |
|   | TLNP4  |                   | 1.146                | R\$ 36.099,00         |
| Contax Participações S/A (*)                                    | CTAX4  | 100/unit.         | 200                  | R\$ 4.920,00          |
| Telemar Norte Leste S/A RJ                                      | TMAR3  | 100/unit.         | 22                   | R\$ 1.214,40          |
|   | TMAR6  |                   | 22                   | R\$ 1.002,10          |
| <b>TOTAL</b>  |        |                   |                      | <b>R\$ 589.494,26</b> |

Fonte: Banco do Brasil-Banco Real-Banco Itaú

(\*) Em 15/01/2010 ocorreu o desdobramento das ações PN e o grupamento das ações ON