



---

# **DIRETORIA DE INVESTIMENTOS**

## **Relatório Mensal de Investimentos**

### **MAIO**

---

**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

MAIO DE 2010

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA DO RIOPREVIDÊNCIA	
<b>A - Disponível</b>	<b>4.458.257.505</b>
<b>B - Segmento de Renda Fixa</b>	<b>3.532.187.044</b>
1 - Carteiras Próprias	3.160.528.995
2 - Operação Compromissada - Lastro: TPF	371.658.049
<b>C - Segmento de Renda Variável</b>	<b>564.748</b>
1 - Ativos em Enquadramento - Ações	564.748
<b>D - Segmento de Imóveis</b>	<b>330.379.934</b>
1 - Carteiras Próprias	330.379.934
<b>E - Fundos de Investimento</b>	<b>595.125.780</b>
1 - Fundos de Curto Prazo	0
2 - Fundos Referenciados DI	595.125.780
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 maio 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.

MAIO DE 2010

Posição consolidada da carteira do RIOPREVIDÊNCIA por tipo de risco	(R\$)	(% do total)
<b>1- Títulos Públicos Federais</b>	<b>4.103.438.738</b>	<b>92,04%</b>
1.1 - Prefixados (LTN, NTN-F)	383.364	0,01%
1.2 - Pós-fixados (LFT - Selic, LTN com DI-1 Selic, Op.Comp.)	942.526.379	21,14%
1.3 - IPCA (NTN-B)	0	0,00%
1.4 - IGP-DI (CFT - Carteira Própria)	3.160.528.995	70,89%
<b>2- Títulos Privados</b>	<b>23.865.561</b>	<b>0,54%</b>
2.1 - Emissores de baixo risco de crédito (*)	23.865.561	0,54%
<b>4- Tesouraria (**)</b>	<b>8.524</b>	<b>0,00%</b>
<b>5- Imóveis</b>	<b>330.379.934</b>	<b>7,41%</b>
<b>6- Ativos em enquadramento - Ações (***)</b>	<b>564.748</b>	<b>0,01%</b>
<b>Total da Carteira</b>	<b>4.458.257.505</b>	<b>100,00%</b>

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

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

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

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

MAIO DE 2010

Segmento	Tipo de Ativo	Valores (R\$)	(%)	Limites PAI (% total)	Limite da Res. nº 3.790/09
Renda Fixa	TPF,FI/FIC 100% TPF	<u>3.682.618.349</u>	<u>82,60%</u>	60% - 100%	Até 100%
Renda Fixa (*)	FI/FIC Referenciado	<u>73.036.425</u>	<u>1,64%</u>	0% - 30%	Até 80%
Renda Fixa	Op. Compromissada com TPF	<u>371.658.049</u>	<u>8,34%</u>		Até 15%
Imóveis	Imóveis ou FII	<u>330.379.934</u>	<u>7,41%</u>	0% - 10%	Sem Limite
Renda Variável (**)	Ações ( em enquadramento)	<u>564.748</u>	<u>0,01%</u>	-	-
<b>Total</b>		<b>4.458.257.505</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 dos Fundos 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 maio, 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.

MAIO 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	365.670.973,56	1,48346	542,46	13,46%	73,04	0,75	3,45	8,79	0,20
BB COMERCIAL 17 FIC FI	R Fixa	BBDTVM	267.923.092,70	2,51304	673,30	0,84%	5,68	0,76	3,37	8,50	0,30
SOBERANO-REF. DI LP	REF DI	ITAÚ	269.569.063,29	19,58589	5.279,75	6,93%	365,72	0,74	3,41	8,62	0,15
FI RF DI FEDERAL EXTRA	REF DI	BRADESCO	696.782.813,53	4,88043	3.400,60	4,43%	150,68	0,74	3,41	8,62	0,15
<b>TOTAIS</b>							<b>595,12</b>				

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

## Operações Compromissadas

MAIO DE 2010

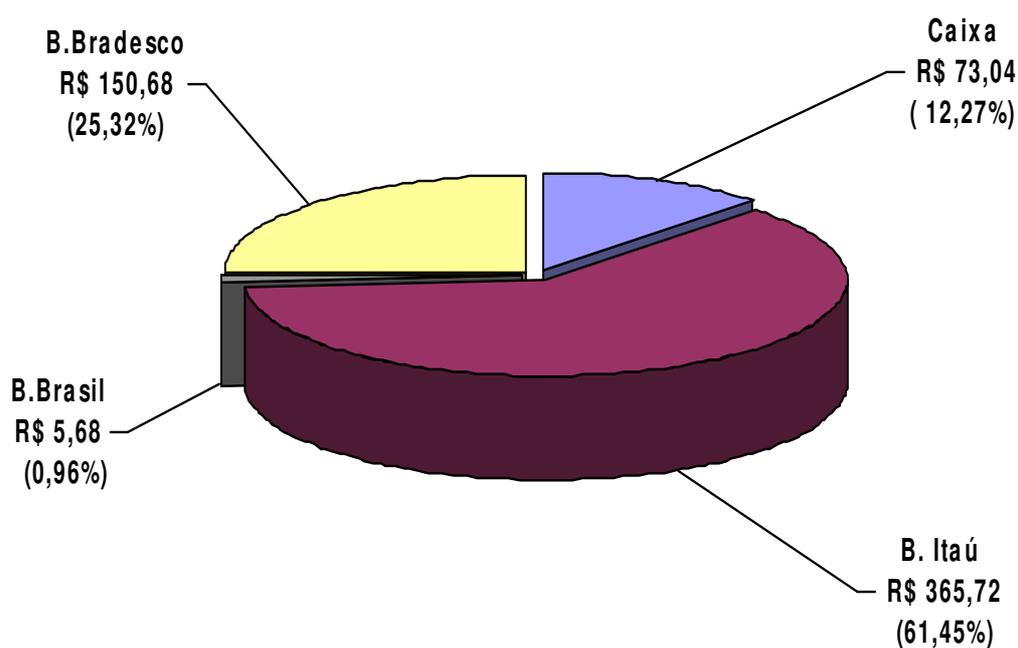
Instituição	CNPJ	Data da Contratação	Vencimento da Operação	% do Indexador	Lastro	Quantidade	P. Unitário (*)	Valor (**) Financeiro (R\$)
CAIXA	00360305000104	12/5/2010	9/9/2010	100,00% do CDI	NTN-B	78.655	1.907,045	150.693.770,76
B. Brasil	00000000000191	12/5/2010	9/9/2010	100,00% do CDI	LFT	35.613	4.211,846	150.691.578,41
B. Brasil	00000000000191	14/5/2010	13/9/2010	100,00% do CDI	LFT	16.624	4.210,680	70.272.699,66
<b>TOTAL</b>								<b>371.658.048,83</b>

Fonte: Caixa - B. Brasil

(\*) - Cotação na operação inicial

(\*\*) - Posição em 31-05-2010

## 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/ 05/2010 - RIOPREVIDÊNCIA

AÇÕES	TIPO	QTD	COTAÇÃO 31/5/2010	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\$ 28.465,25
	TLPP4		941	R\$ 32.831,49
Vivo Participações S/A	VIVO3	100/unit.	521	R\$ 38.033,00
	VIVO4		521	R\$ 26.034,37
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\$ 12.540,89
	TCSL4		1.789	R\$ 8.819,77
Tele Norte Celular Participações S/A	TNCP3	100/unit.	18	R\$ 450,00
	TNCP4		18	R\$ 486,00
Telecomunicações Brasileiras S/A	TELB3	100.000/ lote mil	929.258	R\$ 1.756,30
	TELB4		929.254	R\$ 1.505,39
Itaú Unibanco Banco Múltiplo S.A.(Itaú Holding Financeira S/A )	ITAU3	100/unit.	9.260	R\$ 254.464,80
Embratel Participações S/A	EBTP3	100.000/ lote mil	929.258	R\$ 11.151,10
	EBTP4		929.254	R\$ 11.141,76
Tele Norte Leste Participações S/A	TLNP3	100/unit.	929	R\$ 33.248,91
	TLNP4		1.146	R\$ 34.116,42
Contax Participações S/A	CTAX4	100/unit.	200	R\$ 4.480,00
Telemar Norte Leste S/A RJ	TMAR3	100/unit.	22	R\$ 1.207,36
	TMAR6		22	R\$ 1.002,10
<b>TOTAL</b>				<b>R\$ 564.748,38</b>

Fonte: Banco do Brasil-Banco Real-Banco Itaú