



DIRETORIA DE INVESTIMENTOS

Relatório Mensal de Investimentos

JUNHO

**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

RELATÓRIO MENSAL DE INVESTIMENTOS

Junho de 2010

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA DO RIOPREVIDÊNCIA	
A - Disponível	4.183.903.740
B - Segmento de Renda Fixa	3.491.110.707
1 - Carteiras Próprias	3.116.523.634
2 - Operação Compromissada - Lastro: TPF	374.587.073
C - Segmento de Renda Variável	540.369
1 - Ativos em Enquadramento - Ações	540.369
D - Segmento de Imóveis	330.338.422
1 - Carteiras Próprias	330.338.422
E - Fundos de Investimento	361.914.241
1 - Fundos de Curto Prazo	0
2 - Fundos Referenciados DI	361.914.241
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 junho 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.

Junho de 2010

Posição consolidada da carteira do RIOPREVIDÊNCIA por tipo de risco	(R\$)	(% do total)
1- Títulos Públicos Federais	<u>3.831.678.210</u>	<u>91,58%</u>
1.1 - Prefixados (LTN, NTN-F)	13.290.169	0,32%
1.2 - Pós-fixados (LFT - Selic, LTN com DI-1 Selic, Op.Comp.)	701.864.407	16,78%
1.3 - IPCA (NTN-B)	0	0,00%
1.4 - IGP-DI (CFT - Carteira Própria)	3.116.523.634	74,49%
2- Títulos Privados	<u>20.662.742</u>	<u>0,49%</u>
2.1 - Emissores de baixo risco de crédito (*)	20.662.742	0,49%
4- Tesouraria (**)	<u>683.996</u>	<u>0,02%</u>
5- Imóveis	<u>330.338.422</u>	<u>7,90%</u>
6- Ativos em enquadramento - Ações (***)	<u>540.369</u>	<u>0,01%</u>
Total da Carteira	<u>4.183.903.740</u>	<u>100,00%</u>

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, e BB Comercial 17

(***) Ativos em enquadramento recebidos do IPERJ

Junho 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>3.404.826.397</u>	<u>81,38%</u>	60% - 100%	Até 100%
Renda Fixa (*)	FI/FIC Referenciado	<u>73.611.478</u>	<u>1,76%</u>	0% - 30%	Até 80%
Renda Fixa	Op. Compromissada com TPF	<u>374.587.073</u>	<u>8,95%</u>		Até 15%
Imóveis	Imóveis ou FII	<u>330.338.422</u>	<u>7,90%</u>	0% - 10%	Sem Limite
Renda Variável (**)	Ações (em enquadramento)	<u>540.369</u>	<u>0,01%</u>	-	-
Total		4.183.903.740	100,00%		

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

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

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)

(**) Ativos em enquadramento recebidos do IPERJ

Em junho, 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. Além disso, foi iniciada a alocação de recursos em fundos atrelados ao IMA.

A estratégia de alocação de recursos segue os critérios estabelecidos na legislação vigente, no Plano Anual de Investimentos e pelo Comitê de Investimentos.

Junho 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.)
BRASIL SOBERANO FI (*)	REF DI	CAIXA	133.918.061,58	1,00749	134,92	7,45%	10,05	0,71	0,75	-	0,20
BB COMERCIAL 17 FIC FI	R Fixa	BBDTVM	322.887.329,70	2,53222	817,62	2,47%	20,16	0,76	4,17	8,51	0,30
BB RPPS LIQUIDEZ FIC FI(**)	R Fixa	BBDTVM	901.537.907,54	1,05859	954,36	0,53%	5,03	0,87	5,26	-	0,30
SOBERANO-REF. DI LP	REF DI	ITAÚ	258.922.394,15	19,73796	5.110,60	4,37%	223,56	0,78	4,21	8,64	0,15
FI RF DI FEDERAL EXTRA	REF DI	BRADESCO	663.068.399,86	4,91832	3.261,18	0,90%	29,50	0,78	4,21	8,64	0,15
TOTAL							361,91				

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

(*) Fundo constituído em maio/2010.

(**) Fundo constituído em dez/2009.

Operações Compromissadas

Junho de 2010

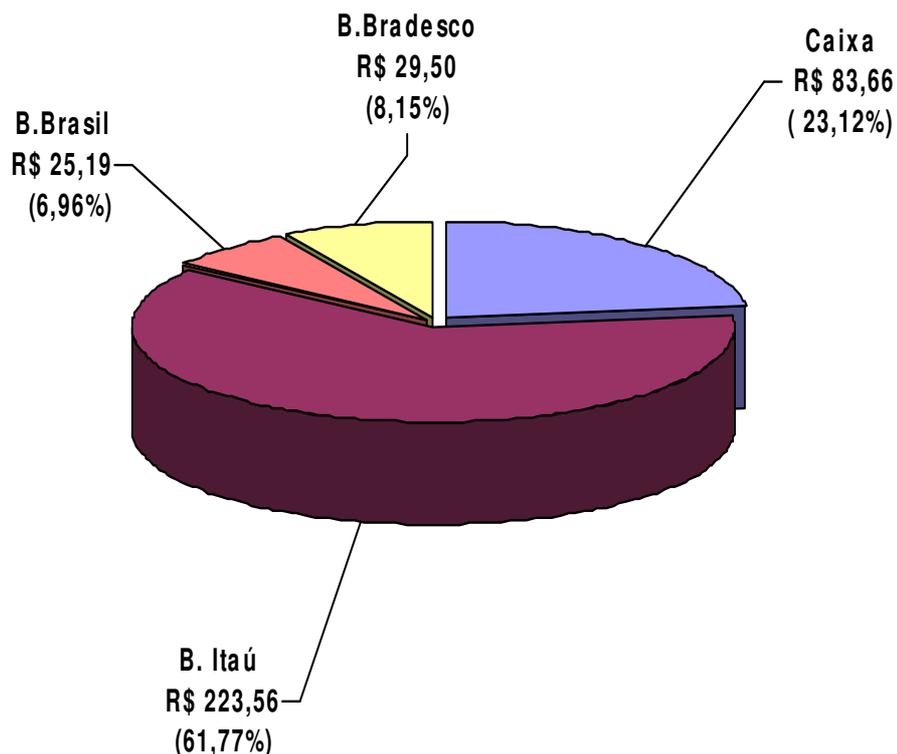
Instituição	CNPJ	Data da Contratação	Vencimento da Operação	% do Indexador	Lastro	Quantidade	P. Unitário (*)	Valor (**) Financeiro (R\$)
CAIXA	00360305000104	12/5/2010	9/9/2010	100,00% do CDI	NTN-B	78.655	1.907,045	151.881.383,63
B. Brasil	00000000000191	12/5/2010	9/9/2010	100,00% do CDI	LFT	35.613	4.211,846	151.879.173,98
B. Brasil	00000000000191	14/5/2010	13/9/2010	100,00% do CDI	LFT	16.624	4.210,680	70.826.515,02
TOTAL								374.587.072,63

Fonte: Caixa - B. Brasil

(*) - Cotação na operação inicial

(**) - Posição em 30-06-2010

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 30/ 06/2010 - RIOPREVIDÊNCIA

AÇÕES	TIPO	QTD	COTAÇÃO 30/6/2010	VALOR	
Brasil Telecom Participações S/A	B RTP3	100/unit.	1.292	16,00	R\$ 20.672,00
	B RTP4		845	12,14	R\$ 10.258,30
Telecomunicações de São Paulo S/A	TLPP3	100/unit.	941	32,78	R\$ 30.845,98
	TLPP4		941	36,10	R\$ 33.970,10
Vivo Participações S/A (Custódia - Banco Itaú)	VIVO3	100/unit.	521	86,00	R\$ 44.806,00
	VIVO4		521	46,40	R\$ 24.174,40
Vivo Participações S/A (Custódia - Banco Bradesco)	VIVO3	100/unit.	126	86,00	R\$ 10.836,00
	VIVO4		126	46,40	R\$ 5.846,40
Tim Participações	TCSL3	100/unit.	1.789	7,30	R\$ 13.059,70
	TCSL4		1.789	4,85	R\$ 8.676,65
Tele Norte Celular Participações S/A	TNCP3	100/unit.	18	25,00	R\$ 450,00
	TNCP4		18	31,52	R\$ 567,36
Telecomunicações Brasileiras S/A	TELB3	100.000/ lote mil	929.258	1,77	R\$ 1.644,79
	TELB4		929.254	1,45	R\$ 1.347,42
Itaú Unibanco Banco Múltiplo S.A.(Itaú Holding Financeira S/A)	ITAU3	100/unit.	9.260	25,78	R\$ 238.722,80
Embratel Participações S/A	EBTP3	100.000/ lote mil	929.258	12,05	R\$ 11.197,56
	EBTP4		929.254	11,50	R\$ 10.686,42
Tele Norte Leste Participações S/A	TLNP3	100/unit.	929	37,70	R\$ 35.023,30
	TLNP4		1.146	27,00	R\$ 30.942,00
Contax Participações S/A	CTAX4	100/unit.	200	21,60	R\$ 4.320,00
Telemar Norte Leste S/A RJ	TMAR3	100/unit.	22	60,01	R\$ 1.320,22
	TMAR6		22	45,55	R\$ 1.002,10
TOTAL					R\$ 540.369,49

Fonte: Banco Bradesco-Banco Itaú