



DIRETORIA DE INVESTIMENTOS

Relatório Mensal de Investimentos

JULHO

**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

Julho de 2010

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA DO RIOPREVIDÊNCIA	
A - Disponível	3.414.207.068
B - Segmento de Renda Fixa	3.033.251.995
1 - Carteiras Próprias	3.033.251.995
2 - Operação Compromissada - Lastro: TPF	0
C - Segmento de Renda Variável	701.164
1 - Ativos em Enquadramento - Ações	701.164
D - Segmento de Imóveis	330.321.318
1 - Carteiras Próprias	330.321.318
E - Fundos de Investimento	49.932.591
1 - Fundos de Curto Prazo	0
2 - Fundos Referenciados DI	49.932.591
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 julho 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.

Julho de 2010

Posição consolidada da carteira do RIOPREVIDÊNCIA por tipo de risco	(R\$)	(% do total)
1- Títulos Públicos Federais	3.081.392.687	90,25%
1.1 - Prefixados (LTN, NTN-F)	3.161.224	0,09%
1.2 - Pós-fixados (LFT - Selic, LTN com DI-1 Selic, Op.Comp.)	44.979.468	1,32%
1.3 - IPCA (NTN-B)	0	0,00%
1.4 - IGP-DI (CFT - Carteira Própria)	3.033.251.995	88,84%
2- Títulos Privados	1.771.285	0,05%
2.1 - Emissores de baixo risco de crédito (*)	1.771.285	0,05%
4- Tesouraria (**)	20.613	0,00%
5- Imóveis	330.321.318	9,67%
6- Ativos em enquadramento - Ações (***)	701.164	0,02%
Total da Carteira	3.414.207.068	100,00%

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, BB Comercial 17 e BB RPPS Liquidez

(***) Ativos em enquadramento recebidos do IPERJ

Julho 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>3.071.730.961</u>	<u>89,97%</u>	60% - 100%	Até 100%
Renda Fixa (*)	FI/FIC Referenciado	<u>11.453.625</u>	<u>0,34%</u>	0% - 30%	Até 80%
Renda Fixa	Op. Compromissada com TPF	<u>0</u>	<u>0,00%</u>		Até 15%
Imóveis	Imóveis ou FII	<u>330.321.318</u>	<u>9,67%</u>	0% - 10%	Sem Limite
Renda Variável (**)	Ações (em enquadramento)	<u>701.164</u>	<u>0,02%</u>	-	-
Total		3.414.207.068	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 julho, 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 cujo resgate total ocorreu antes do encerramento do mês. Destacam-se as aplicações atreladas ao IMA, porém com pouca representatividade em nossos investimentos.

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

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	310.889.999,40	1,50795	468,81	2,44%	11,45	0,86	5,15	8,89	0,20
BRASIL SOBERANO FI (*)	REF DI	CAIXA	149.618.732,16	1,01991	152,60	0,11%	0,17	1,23	1,99	-	0,20
BB COMERCIAL 17 FIC FI	R Fixa	BBDTVM	270.102.383,00	2,55375	689,77	0,64%	4,40	0,85	5,04	8,60	0,30
BB RPPS LIQUIDEZ FIC FI(**)	R Fixa	BBDTVM	930.572.907,43	1,07451	999,91	0,51%	5,10	1,50	6,84	-	0,30
SOBERANO-REF. DI LP	REF DI	ITAÚ	231.488.199,61	19,90479	4.607,72	0,62%	28,67	0,85	5,09	8,72	0,15
FI RF DI FEDERAL EXTRA	REF DI	BRADESCO	646.078.034,94	4,95989	3.204,48	0,00%	0,14	0,85	5,09	8,72	0,15
TOTAL							49,93				

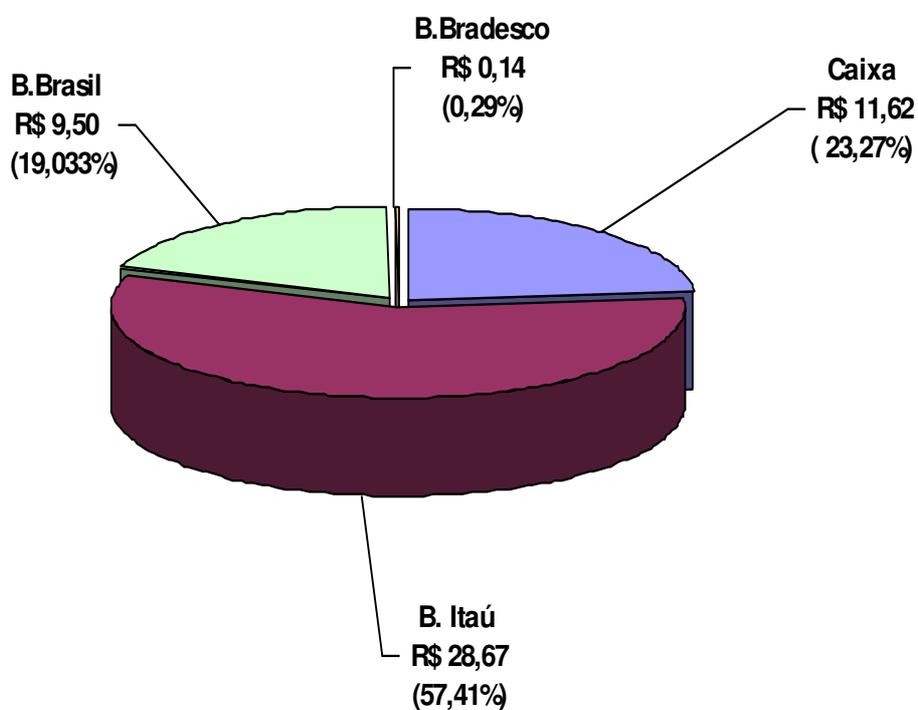
Fonte: RIOPREVIDÊNCIA, B.Brasil, Caixa, B.Itaú, Bradesco.

(*) Fundo constituído em maio/2010.

(**) Fundo constituído em dez/2009.

No encerramento do mês de julho, as aplicações financeiras em fundos de investimento totalizaram R\$ 49.932.591,01, 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 3.790/09, essas ações serão vendidas até o final de 2010.

Ativos em Enquadramento - Posição Acionária em 30/ 07/2010 - RIOPREVIDÊNCIA

AÇÕES	TIPO	QTD	COTAÇÃO 30/7/2010	VALOR	
Brasil Telecom Participações S/A	B RTP3	100/unit.	1.292	15,84	R\$ 20.465,28
	B RTP4		845	11,60	R\$ 9.802,00
Telecomunicações de São Paulo S/A	TLPP3	100/unit.	941	35,20	R\$ 33.123,20
	TLPP4		941	37,92	R\$ 35.682,72
Vivo Participações S/A	VIVO3	100/unit.	647	109,99	R\$ 71.163,53
	VIVO4		647	47,05	R\$ 30.441,35
Tim Participações	TCSL3	100/unit.	1.789	6,95	R\$ 12.433,55
	TCSL4		1.789	5,05	R\$ 9.034,45
Tele Norte Celular Participações S/A	TNCP3	100/unit.	18	68,00	R\$ 1.224,00
	TNCP4		18	31,00	R\$ 558,00
Telecomunicações Brasileiras S/A	TELB3	100.000/ lote mil	929.258	1,77	R\$ 1.644,79
	TELB4		929.254	1,55	R\$ 1.440,34
Itaú Unibanco Banco Múltiplo S.A.	ITUB3	100/unit.	12.732	30,28	R\$ 385.524,96
Embratel Participações S/A	EBTP3	100.000/ lote mil	929.258	11,39	R\$ 10.584,25
	EBTP4		929.254	11,38	R\$ 10.574,91
Tele Norte Leste Participações S/A	TLNP3	100/unit.	929	33,30	R\$ 30.935,70
	TLNP4		1.146	25,75	R\$ 29.509,50
Contax Participações S/A	CTAX4	100/unit.	200	23,17	R\$ 4.634,00
Telemar Norte Leste S/A RJ	TMAR3	100/unit.	22	62,99	R\$ 1.385,78
	TMAR6		22	45,55	R\$ 1.002,10
TOTAL					R\$ 701.164,41