



DIRETORIA DE INVESTIMENTOS

Relatório Mensal de Investimentos

AGOSTO

**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
Luciana Pinto Venâncio
Marcio Martins Rocha Ramos

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

Agosto de 2010

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA DO RIOPREVIDÊNCIA	
A - Disponível	3.960.113.959
B - Segmento de Renda Fixa	3.448.526.531
1 - Carteiras Próprias	2.945.715.916
2 - Operação Compromissada - Lastro: TPF	502.810.615
C - Segmento de Renda Variável	640.979
1 - Ativos em Enquadramento - Ações	640.979
D - Segmento de Imóveis	329.244.602
1 - Carteiras Próprias	329.244.602
E - Fundos de Investimento	181.701.847
1 - Fundos de Curto Prazo	0
2 - Fundos Referenciados DI	137.289.835
3 - Fundos de Renda Fixa RF IMA	44.412.012
4 - Fundos Multimercado	0
5 - Fundos de Ações	0

A composição das aplicações do RIOPREVIDÊNCIA no encerramento do mês de agosto 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.

Agosto de 2010

Posição consolidada da carteira do RIOPREVIDÊNCIA por tipo de risco	(R\$)	(% do total)
1- Títulos Públicos Federais	<u>3.625.042.105</u>	<u>91,54%</u>
1.1 - Prefixados (LTN, NTN-F)	40.869.653	1,03%
1.2 - Pós-fixados (LFT - Selic, LTN com DI-1 Selic, Op.Comp.)	638.456.536	16,12%
1.3 - IPCA (NTN-B)	0	0,00%
1.4 - IGP-DI (CFT - Carteira Própria)	2.945.715.916	74,38%
2- Títulos Privados	<u>5.139.098</u>	<u>0,13%</u>
2.1 - Emissores de baixo risco de crédito (*)	5.139.098	0,13%
3- Tesouraria (**)	<u>47.174</u>	<u>0,00%</u>
4- Imóveis	<u>329.244.602</u>	<u>8,31%</u>
5- Ativos em enquadramento - Ações (***)	<u>640.979</u>	<u>0,02%</u>
Total da Carteira	<u>3.960.113.959</u>	<u>100,00%</u>

Fonte: RIOPREVIDÊNCIA, B.Brasil, Caixa, Itaú, BNP Paribas.

(*) 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, BNP Paribas Fix e BB RPPS Liquidez

(***) Ativos em enquadramento recebidos do IPERJ

Agosto 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>3.074.969.784</u>	<u>77,65%</u>	60% - 100%	Até 100%
Renda Fixa (*)	FI/FIC Referenciado	<u>52.447.979</u>	<u>1,32%</u>	0% - 30%	Até 80%
Renda Fixa	Op. Compromissada com TPF	<u>502.810.615</u>	<u>12,70%</u>		Até 15%
Imóveis	Imóveis ou FII	<u>329.244.602</u>	<u>8,31%</u>	0% - 10%	Sem Limite
Renda Variável (**)	Ações (em enquadramento)	<u>640.979</u>	<u>0,02%</u>	-	-
Total		3.960.113.959	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 agosto, 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 . Destacam-se as aplicações atreladas ao IMA, que têm aumentado 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.

Agosto 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	237.753.493,02	1,02932	244,72	14,46%	35,39	0,92	2,90	-	0,20
BB RPPS LIQUIDEZ FIC FI(**)	R Fixa	BBDTVM	912.773.574,92	1,08436	989,77	0,71%	7,02	0,92	7,82	-	0,30
SOBERANO-REF. DI LP	REF DI	ITAÚ	243.526.871,98	20,07881	4.889,73	1,74%	84,84	0,87	6,01	8,93	0,15
BNP Paribas Fix IRFM-1 (***)	REF DI	BNP Asset	161.948,62	100,42175	16,26	12,32%	2,00	0,42	0,42	-	0,20
TOTAL							181,70				

Fonte: RIOPREVIDÊNCIA, B.Brasil, Caixa, B.Itaú, BNP Paribas.

(*) Fundo constituído em maio/2010.

(**) Fundo constituído em dez/2009.

(***) Fundo constituído em jun/2010.

Operações Compromissadas

Agosto de 2010

Instituição	CNPJ	Data da Contratação	Vencimento da Operação	% do Indexador	Lastro	Quantidade	P. Unitário (*)	Valor (**) Financeiro (R\$)
CAIXA	00360305000104	11/8/2010	9/12/2010	100,00% do CDI	NTN-B	129.712	1.927,340	251.406.047,12
B. Brasil	00000000000191	11/8/2010	9/12/2010	100,00% do CDI	LFT	57.968	4.312,674	251.404.567,85
TOTAL								502.810.614,97

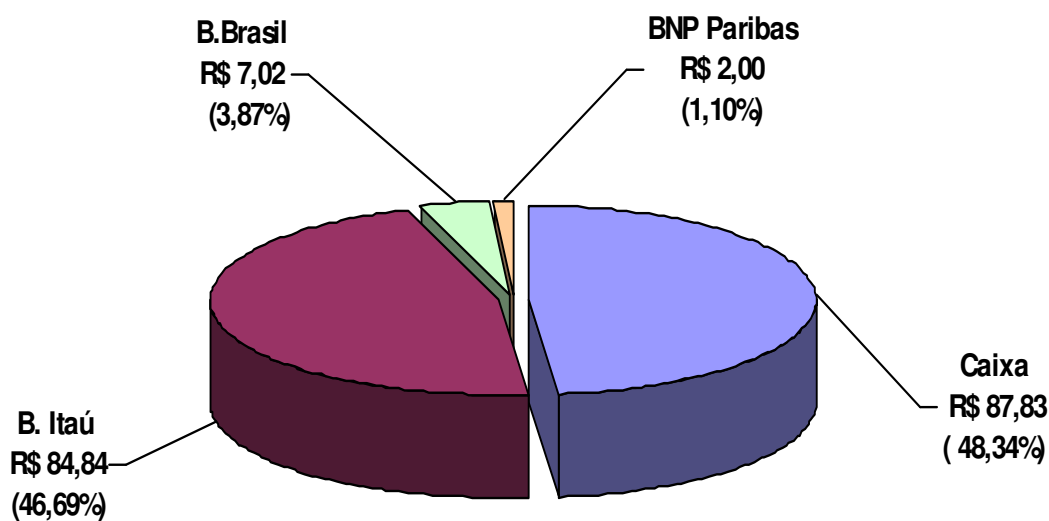
Fonte: Caixa - B. Brasil

(*) - Cotação na operação inicial

(**) - Posição em 31-08-2010

No encerramento do mês de agosto, as aplicações financeiras em fundos de investimento totalizaram R\$ 181.701.847,05, 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 31/ 08/2010 - RIOPREVIDÊNCIA

AÇÕES	TIPO	QTD	COTAÇÃO 31/8/2010	VALOR	
Brasil Telecom Participações S/A	B RTP3	100/unit.	1.292	15,13	R\$ 19.547,96
	B RTP4		845	11,11	R\$ 9.387,95
Telecomunicações de São Paulo S/A	TLPP3	100/unit.	41	36,84	R\$ 1.510,44
	TLPP4		941	40,31	R\$ 37.931,71
Vivo Participações S/A	VIVO3	100/unit.	647	109,70	R\$ 70.975,90
	VIVO4		647	42,20	R\$ 27.303,40
Tim Participações	TCSL3	100/unit.	1.789	6,99	R\$ 12.505,11
	TCSL4		1.789	4,96	R\$ 8.873,44
Tele Norte Celular Participações S/A	TNCP3	100/unit.	18	40,70	R\$ 732,60
Itaú Unibanco Banco Múltiplo S.A.	ITUB3	100/unit.	12.732	29,28	R\$ 372.792,96
Embratel Participações S/A	EBTP3	100.000/ lote mil	929.258	10,94	R\$ 10.166,08
	EBTP4		929.254	10,90	R\$ 10.128,87
Tele Norte Leste Participações S/A	TLNP3	100/unit.	929	30,45	R\$ 28.288,05
	TLNP4		1.146	23,90	R\$ 27.389,40
Telemar Norte Leste S/A RJ	TMAR3	100/unit.	22	58,00	R\$ 1.276,00
	TMAR6		22	42,00	R\$ 924,00
Telecomunicações Brasileiras S/A	TELB4	100.000/lote mil	929.254	1,34	R\$ 1.245,20
TOTAL					R\$ 640.979,07

Fonte: Banco Itaú