



RELATÓRIO MENSAL DE INVESTIMENTOS

SETEMBRO DE 2009

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA DO RIOPREVIDÊNCIA

SETEMBRO DE 2009

A - Disponível	5.211.409.206
B - Segmento de Renda Fixa	3.964.685.293
1 - Carteiras Próprias	3.964.685.293
2- Operação Compromissada - Lastro: LFT	0
3 - Valores a Pagar (-)	0
4 - Valores a Receber (+)	0
C - Segmento de Renda Variável	573.960
1 - Ativos em Enquadramento - Ações	573.960
2 - Valores a Pagar (-)	0
3 - Valores a Receber (+)	0
D - Segmento de Imóveis	333.331.256
1 - Carteiras Próprias	333.331.256
2 - Valores a Pagar (-)	0
3 - Valores a Receber (+)	0
E - Segmento de Empréstimos e Financiamentos	0
1 - Carteiras Próprias	0
2 - Valores a Pagar (-)	0
3 - Valores a Receber (+)	0
F - Fundos de Investimento	912.818.697
1 - Fundos de Curto Prazo	0
2 - Fundos Referenciados DI	912.818.697
3 - Fundos de Renda Fixa	0
4 - Fundos Multimercado	0
5 - Fundos de Ações	0
6 - Fundos Cambiais	0
7 - Fundos da Dívida Externa	0

Posição consolidada da carteira do RIOPREVIDENCIA por tipo de risco

SETEMBRO DE 2009

	Carteira do RIOPREV	
	(R\$)	(% do total)
1- Títulos Públicos Federais	<u>4.815.581.816</u>	92,40%
1.1 - Prefixados (LTN, NTN-F)	0	0,00%
1.2 - Pós-fixados (LFT - Selic, LTN com DI-1 Selic, Op.Comp.)	850.896.522	16,33%
1.3 - IPCA (NTN-B)	-	-
1.4 - IGP-DI (CFT - Carteira Própria)	3.964.685.293	76,08%
2- Títulos Privados	<u>61.921.226</u>	1,19%
2.1 - FI com CDB de bancos de 1ª linha (*)	61.921.226	1,19%
4- Tesouraria (**)	<u>949</u>	0,00%
5- Imóveis	<u>333.331.256</u>	6,40%
6- Ativos em enquadramento - Ações (***)	<u>573.960</u>	0,01%
Total da Carteira	<u>5.211.409.206</u>	100,00%

Fonte: RIOPREVIDENCIA, B.Brasil, CEF, B.Itaú, UBS Pactual, Bradesco.

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

(**) Recursos mantidos em Tesouraria nos Fundos: Itaú Gov. PP, Itaú Soberano DI FI LP e Bradesco Federal Extra RF DI

Posição Consolidada - Resolução 3.506/07

SETEMBRO DE 2009

Segmento	Tipo de Ativo	Valores (R\$)	(%)	Limites PAI (% total)	Limite da Res. nº 3.506/07
Renda Fixa	TPF, FI/FIC 100% TPF ou Op. Compromissada com TPF	<u>4.675.147.044</u>	<u>89,71%</u>	60% - 100%	Até 100%
Renda Fixa (*)	FI/FIC Referenciado	<u>202.356.947</u>	<u>3,88%</u>	0% - 30%	Até 80%
Imóveis	Imóveis ou FII	<u>333.331.256</u>	<u>6,40%</u>	0% - 10%	Sem Limite
Ações (**)	Ativos em Enquadramento	<u>573.960</u>	<u>0,01%</u>	-	-
Total		5.211.409.206	100,00%		

Fonte: RIOPREVIDENCIA, B.Brasil, CEF, B.Itaú,UBS Pactual,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

SETEMBRO DE 2009

Nome do Fundo	CNPJ do Fundo	Tipo de Fundo	Gestor	Participação do RIOPREV nos Fundos de Investimento					Composição dos Fundos				Rentabilidade Acumulada (%)			Tx. Adm.	Volatilidade
				Quantidade Total de Cotas	Valor Unitário das Cotas	Patrimônio dos Fundos	Partic. do RIOPREV. no Patr. dos Fundos	Valor do RIOPREV nos Fundos	% PRÉ	% PÓS	% IPCA	% Derivativos	No Mês	No Ano	12 Meses	(% a.a.)	12 Meses(%)
FI BRASIL REFERENCIADO DI LP	03737206000197	Referenciado DI	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	959.847.208,55	1,40488	1.348.473.025,88	15,01%	202.356.946,75	0,00%	100,00%	0,00%	0,00%	0,70	7,75	11,27	0,20	0,0077
BB REGIME PRÓPRIO III REFERENC. DI	07442078000105	Referenciado DI	BBDTVM ADMINISTRAÇÃO DE ATIVOS S/A	3.030.182.702,85	1,69925	5.149.038.457,79	0,00%	5.217,55	0,00%	100,00%	0,00%	0,00%	0,68	7,54	11,03	0,20	0,0070
ITAU-GOV PP REFERENCIADO DI FI	03364202000100	Referenciado DI	BANCO ITAÚ S.A.	33.312.013,28	43,72621	1.456.607.978,31	0,09%	1.310.061,21	0,00%	100,00%	0,00%	0,00%	0,68	7,57	11,12	0,15	0,0072
ITAU-SOBERANO-REFERENCIADO DI FI LP	06175696000173	Referenciado DI	BANCO ITAÚ S.A.	324.171.373,55	18,55857	6.016.155.953,74	4,08%	245.184.287,94	0,00%	100,00%	0,00%	0,00%	0,68	7,57	11,12	0,15	0,0072
UBS PACTUAL MASTER CASH FI REF (*)	09215250000113	Referenciado DI	UBS PACTUAL ASSET MANAGEMENT S.A. LTDA	607.488.648,90	1,19112	723.593.575,73	7,04%	50.926.247,78	0,00%	100,00%	0,00%	0,00%	0,67	7,52	11,06	0,20	0,0072
BRADESCO FI RF DI FEDERAL EXTRA	03256793000100	Referenciado DI	BRAM-BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A.	864.294.693,28	4,62445	3.996.890.852,97	5,29%	211.586.754,20	0,00%	100,00%	0,00%	0,00%	0,68	7,57	11,10	0,15	0,0071
TOTAIS								711.369.515,43	0,00%	100,00%	0,00%	0,00%					

Fonte: RIOPREVIDENCIA, B.Brasil, CEF, B.Itaú,UBS Pactual,Bradesco.

Operações Compromissadas

SETEMBRO DE 2009

Instituição	CNPJ	Data da Contratação	Vencimento da Operação	% do Indexador	Lastro	Vencimento do Lastro	Quantidade	P. Unitário (*)	Valor (**) Financeiro (R\$)
CAIXA S/A	00360305000104	28/08/2009	28/12/2009	100,00% do CDI	NTN-B	15/05/2011	107.826	1.868,280	201.449.181,84

(*) - Cotação em 30/09/2009

(**) - Posição em 30-09-2009

Ativos em Enquadramento - Posição Acionária em 30-09-09 (IPERJ E RIOPREVIDÊNCIA)

IPERJ

AÇÕES	TIPO	QTD	COTAÇÃO 30/09/2009	VALOR	
Brasil Telecom Participações S/A	BRTP3	100/unit.	929	32,68	R\$ 30.359,72
	BRTP4		929	18,90	R\$ 17.558,10
Telecomunicações de São Paulo S/A	TLPP3	100/unit.	941	38,76	R\$ 36.473,16
	TLPP4		941	43,59	R\$ 41.018,19
Vivo Participações S/A	VIVO3	100/unit.	521	42,45	R\$ 22.116,45
	VIVO4		521	44,70	R\$ 23.288,70
Telemig Celular Participações S/A	TMCP3	100/unit.	92	56,00	R\$ 5.152,00
	TMCP4		92	58,20	R\$ 5.354,40
Tim Participações	TCSL3	100/unit.	1.789	5,87	R\$ 10.501,43
	TCSL4		1.789	4,41	R\$ 7.889,49
Tele Norte Celular Participações S/A	TNCP3	100/unit.	18	45,01	R\$ 810,18
	TNCP4		18	30,00	R\$ 540,00
Telecomunicações Brasileiras S/A	TELB3	100.000/ lote mil	929.258	0,69	R\$ 641,19
	TELB4		929.254	0,40	R\$ 371,70
SUB-TOTAL					R\$ 202.074,71

RIOPREVIDÊNCIA

AÇÕES	TIPO	QTD	COTAÇÃO 30/09/2009	VALOR	
Itaú Unibanco Banco Múltiplo S.A.(Itaú Holding Financeira S/A)	ITAU3	100/unit.	9.260	28,64	R\$ 265.206,40
Embratel Participações S/A	EBTP3	100.000/ lote mil	929.258	10,75	R\$ 9.989,52
	EBTP4		929.254	11,00	R\$ 10.221,79
Tele Norte Leste Participações S/A	TLNP3	100/unit.	929	40,00	R\$ 37.160,00
	TLNP4		1.146	33,50	R\$ 38.391,00
Contax Participações S/A	CTAX3	100/unit.	46	87,00	R\$ 4.002,00
	CTAX4		57	79,98	R\$ 4.558,86
Telemar Norte Leste S/A RJ	TMAR3	100/unit.	22	61,55	R\$ 1.354,10
	TMAR6		22	45,55	R\$ 1.002,10
SUB-TOTAL					R\$ 371.885,78
TOTAL					R\$ 573.960,49

Fonte: Banco do Brasil-Banco Real-Banco Itaú