



DIRETORIA DE INVESTIMENTOS

Relatório Mensal de Investimentos

OUTUBRO

**Rio de Janeiro
2009**

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
Sueli Fonseca Guimarães Oliveira
Ubirajara da Silva Coelho

RELATÓRIO MENSAL DE INVESTIMENTOS

OUTUBRO DE 2009

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA DO RIOPREVIDÊNCIA	
A - Disponível	5.084.040.855
B - Segmento de Renda Fixa	4.435.967.370
1 - Carteiras Próprias	3.912.877.304
2- Operação Compromissada - Lastro: TPF	523.090.066
C - Segmento de Renda Variável	562.536
1 - Ativos em Enquadramento - Ações	562.536
D - Segmento de Imóveis	333.331.256
1 - Carteiras Próprias	333.331.256
E - Segmento de Empréstimos e Financiamentos	0
1 - Carteiras Próprias	0
F - Fundos de Investimento	314.179.694
1 - Fundos de Curto Prazo	0
2 - Fundos Referenciados DI	314.179.694
3 - Fundos de Renda Fixa	0
4 - Fundos Multimercado	0
5 - Fundos de Ações	0

A composição das aplicações do RIOPREVIDÊNCIA no encerramento do mês de outubro se apresentou conforme as tabelas abaixo, dentro dos limites estabelecidos na Resolução nº 3.790/09 do CMN e do Plano Anual de Investimentos.

OUTUBRO DE 2009

Posição consolidada da carteira do RIOPREVIDÊNCIA por tipo de risco	(R\$)	(% do total)
1- Títulos Públicos Federais	4.713.011.767	92,70%
1.1 - Prefixados (LTN, NTN-F)	0	0,00%
1.2 - Pós-fixados (LFT - Selic, LTN com DI-1 Selic, Op.Comp.)	800.134.463	15,74%
1.3 - IPCA (NTN-B)	-	-
1.4 - IGP-DI (CFT - Carteira Própria)	3.912.877.304	76,96%
2- Títulos Privados	36.067.634	0,71%
2.1 - FI com CDB de bancos de 1ª linha (*)	36.067.634	0,71%
4- Tesouraria (**)	1.067.663	0,02%
5- Imóveis	333.331.256	6,56%
6- Ativos em enquadramento - Ações (***)	562.536	0,01%
Total da Carteira	5.084.040.855	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 no Fundo: Itaú Gov. PP

(***) Ativos em enquadramento recebidos do IPERJ

OUTUBRO DE 2009

Posição Consolidada (Res. 3.506/07)	Tipo de Ativo	Valores (R\$)	(%)	Limites PAI (% total)	Limite da Res. nº 3.506/07 (***)
Renda Fixa	TPF,FI/FIC 100% TPF ou Op. Comp. com TPF	<u>4.646.860.598</u>	<u>91,40%</u>	60% - 100%	Até 100%
Renda Fixa (*)	FI/FIC Referenciado	<u>103.286.466</u>	<u>2,03%</u>	0% - 30%	Até 80%
Imóveis	Imóveis ou FII	<u>333.331.256</u>	<u>6,56%</u>	0% - 10%	Sem Limite
Ações (**)	Ativos em Enquadramento	<u>562.536</u>	<u>0,01%</u>	-	-
Total		5.084.040.855	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

(**) Ativos em enquadramento recebidos do IPERJ

(***) Prazo de enquadramento da Resolução nº 3.790/09 CMN - 26/03/2010

Em outubro, as aplicações financeiras do RIOPREVIDÊNCIA se concentraram em cotas de fundos de investimento Referenciado DI, cujos lastros são predominantemente títulos públicos federais, e em operação compromissada indexada 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.

OUTUBRO DE 2009

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			Tx. Adm. (% a.a.)	
							Mês	Ano	12 Meses		
FI BRASIL REF DI LP	RF DI	CAIXA	841.629.202,30	1,41452	1.190,50	8,68%	103,29	0,69	8,49	10,80	0,20
REGIME PRÓPRIO III RF DI	RF DI	BBDTVM	3.088.295.821,66	1,71075	5.283,31	0,00%	0,01	0,68	8,26	10,55	0,20
ITAU-GOV PP R EF. FI	RF DI	ITAÚ	35.682.715,44	44,02359	1.570,88	1,13%	17,68	0,68	8,30	10,60	0,15
SOBERANO-REF. DI FI LP	RF DI	ITAÚ	322.353.905,42	18,68488	6.023,14	1,22%	73,45	0,68	8,30	10,60	0,15
MASTER CASH FI RF	RF DI	PACTUAL	438.939.536,44	1,19916	526,36	5,94%	31,24	0,68	8,24	10,52	0,20
FI RF DI FEDERAL EXTRA	RF DI	BRANDESCO	823.905.738,16	4,65592	3.836,04	2,31%	88,52	0,68	8,30	10,59	0,15
Fonte: RIOPREVIDENCIA, B.Brasil, CEF, B.Itaú,BTG Pactual,Bradesco.							TOTAIS	314,18			

Operações Compromissadas

OUTUBRO DE 2009

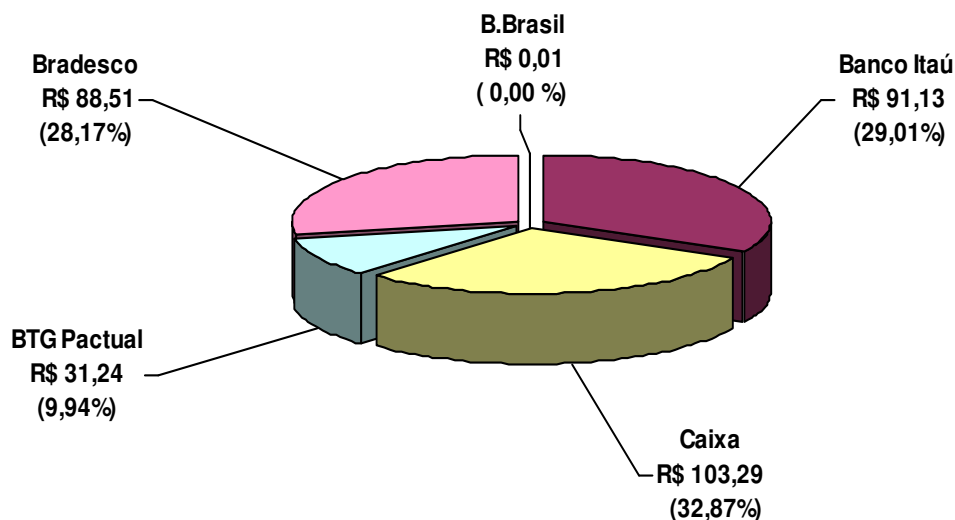
Instituição	CNPJ	Data da Contratação	Vencimento da Operação	% do Indexador	Lastro	Quantidade	P. Unitário (*)	Valor (**) Financeiro (R\$)
CAIXA	00360305000104	28/8/2009	28/12/2009	100,00% do CDI	NTN-B	107.826	1.854,839	202.841.448,95
CAIXA	00360305000104	14/10/2009	12/2/2010	100,00% do CDI	NTN-B	75.411	1.858,554	140.708.210,02
CAIXA	00360305000104	16/10/2009	18/2/2010	100,00% do CDI	NTN-B	20.124	4.026,833	81.302.288,34
CAIXA	00360305000104	20/10/2009	18/2/2010	100,00% do CDI	NTN-B	24	4.029,508	96.962,33
CAIXA	00360305000104	28/10/2009	25/2/2010	100,00% do CDI	NTN-B	52.684	18.616,052	98.141.156,80
TOTAL								523.090.066,44

Fonte: Caixa

(*) - Cotação na operação inicial

(**) - Posição em 30-10-2009

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 do CMN, essas ações serão vendidas até o final de 2010, aguardando no decorrer desse período um momento mais favorável do mercado acionário para a venda desses ativos.

Ativos em Enquadramento - Posição Acionária em 30-10-09 IPERJ E RIOPREVIDÊNCIA

IPERJ

AÇÕES	TIPO	QTD	COTAÇÃO 30/10/2009	VALOR	
Brasil Telecom Participações S/A	BRTP3	100/unit.	929	32,49	R\$ 30.183,21
	BRTP4		929	17,73	R\$ 16.471,17
Telecomunicações de São Paulo S/A	TLPP3	100/unit.	941	38,95	R\$ 36.651,95
	TLPP4		941	43,70	R\$ 41.121,70
Vivo Participações S/A	VIVO3	100/unit.	521	44,99	R\$ 23.439,79
	VIVO4		521	43,20	R\$ 22.507,20
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	5,50	R\$ 9.839,50
	TCSL4		1.789	4,15	R\$ 7.424,35
Tele Norte Celular Participações S/A	TNCP3	100/unit.	18	74,98	R\$ 1.349,64
	TNCP4		18	32,00	R\$ 576,00
Telecomunicações Brasileiras S/A	TELB3	100.000/ lote mil	929.258	0,79	R\$ 734,11
	TELB4		929.254	0,84	R\$ 780,57
SUB-TOTAL					R\$ 201.585,60

RIOPREVIDÊNCIA

AÇÕES	TIPO	QTD	COTAÇÃO 30/10/2009	VALOR	
Itaú Unibanco Banco Múltiplo S.A.(Itaú Holding Financeira S/A)	ITAU3	100/unit.	9.260	26,98	R\$ 249.834,80
Embratel Participações S/A	EBTP3	100.000/ lote mil	929.258	13,00	R\$ 12.080,35
	EBTP4		929.254	13,00	R\$ 12.080,30
Tele Norte Leste Participações S/A	TLNP3	100/unit.	929	40,50	R\$ 37.624,50
	TLNP4		1.146	33,70	R\$ 38.620,20
Contax Participações S/A	CTAX3	100/unit.	46	83,50	R\$ 3.841,00
	CTAX4		57	79,00	R\$ 4.503,00
Telemar Norte Leste S/A RJ	TMAR3	100/unit.	22	62,00	R\$ 1.364,00
	TMAR6		22	45,55	R\$ 1.002,10
SUB-TOTAL					R\$ 360.950,26

TOTAL

R\$ 562.535,85

Fonte: Banco do Brasil-Banco Real-Banco Itaú