

### **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

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**

#### **OUTUBRO DE 2009**

	1014							
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							
o i unuos uc riçoco	U							

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%
<ul> <li>1.1 - Prefixados (LTN, NTN-F)</li> <li>1.2 - Pós-fixados (LFT - Selic,LTN com DI-1 Selic,Op.Comp.)</li> <li>1.3 - IPCA (NTN-B)</li> <li>1.4 - IGP-DI (CFT - Carteira Própria)</li> </ul>	0 800.134.463 - 3.912.877.304	0,00% 15,74% - 76,96%
2- Títulos Privados	36.067.634	<u>0,71%</u>
2.1 - FI com CDB de bancos de 1ª linha (*)	36.067.634	0,71%
4- Tesouraria (**)	1.067.663	<u>0,02%</u>
5- Imóveis	333.331.256	<u>6,56%</u>
6- Ativos em enquadramento - Ações (***)	<u>562.536</u>	<u>0,01%</u>
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	4.646.860.598	91,40%	60% - 100%	Até 100%
Renda Fixa (*)	FI/FIC Referenciado	103.286.466	<u>2,03%</u>	0% - 30%	Até 80%
Imóveis	Imóveis ou FII	333.331.256	<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 F	Participação do RIOPREVIDÊNCIA nos Fundos de Investimento						Rent. Acum. (%)			
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	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	BRADESCO	823.905.738,16	4,65592	3.836,04	2,31%	88,52	0,68	8,30	10,59	0,15		
Fonte: RIOPREVIDENCIA, B.B.	Fonte: RIOPREVIDENCIA, B.Brasil, CEF, B.Itaú,BTG Pactual,Bradesco.												



#### Operações Compromissadas

ΛI	ITI	IR	PΛ	DE	2000

OUTUBRU DE	2009							
Instituição	CNPJ	Data da Contratação	Vencimento da Operação	% do Indexador	Lastro	Quantidade	P. Unitário (*)	Valor (**) Financeiro (R\$)
,		J	. ,				`,	, ,
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
CAIXA	00360305000104	20/10/2009	18/2/2010	100,00% do CDI	NTN-B	24	4.029,508	96.96

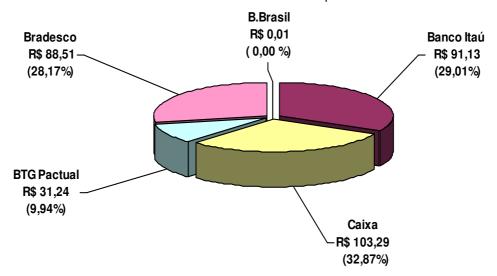
TOTAL 523.090.066,44

Fonte: Caixa

(\*) - Cotação na operação inicial

(\*\*) - Posição em 30-10-2009

## Participação por Instituição Financeira em Fundos de Investimento - R\$ Milhões





#### Carteira Própria Certificados Financeiros do Tesouro - Posição em Outubro de 2009

													Valor
Custodiante	Ativo	Cóc	digo	Data de	Data de	Data de	Quantidade	Indexador	Cupom/	PU Compra	PU Atual	Característica	Financeiro
,				Emissão	Compra	Vencimento			Taxa (%aa)	(R\$)	(R\$)	do Título	(R\$)
BANCO ITAÚ S.A.		HSTN_	_A519		14/12/99	15/11/2009	38.998	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.285,08	Pós-Fixado	89.113.549,84
BANCO ITAÚ S.A. BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN_	A520 A521	14/12/99 14/12/99	14/12/99 14/12/99	15/12/2009 15/1/2010	38.998 140.881	IGP-DI IGP-DI	6,00 6,00	1.000,00	2.285,08 2.285,08	Pós-Fixado Pós-Fixado	89.113.549,84 321.924.355,48
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A		A522		14/12/99	15/2/2010	38.998	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.285,08	Pós-Fixado Pós-Fixado	89.113.549,84
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A		A523		14/12/99	15/3/2010	38.998	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.285,08	Pós-Fixado	89.113.549,84
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A		_A524	14/12/99	14/12/99	15/4/2010	38.998	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.285,08	Pós-Fixado	89.113.549,84
BANCO ITAÚ S.A.		HSTN_	_A525	14/12/99	14/12/99	15/5/2010	38.998	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.285,08	Pós-Fixado	89.113.549,84
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A		_A526		14/12/99	15/6/2010	38.998	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.285,08	Pós-Fixado	89.113.549,84
BANCO ITAU S.A. BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A		_A527 A528		14/12/99 14/12/99	15/7/2010 15/8/2010	38.998 38.998	IGP-DI IGP-DI	6,00 6,00	1.000,00	2.285,08	Pós-Fixado Pós-Fixado	89.113.549,84 89.113.549,84
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A		A529		14/12/99	15/9/2010	38.998	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.285,08	Pós-Fixado Pós-Fixado	89.113.549,84
BANCO ITAÚ S.A.		HSTN	A530		14/12/99	15/10/2010	38.998	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.285,08	Pós-Fixado	89.113.549,84
BANCO ITAÚ S.A.			A531	14/12/99	14/12/99	15/11/2010	38.998	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.285,08	Pós-Fixado	89.113.549,84
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A		_A532		14/12/99	15/12/2010	38.998	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.285,08	Pós-Fixado	89.113.549,84
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A		_A533		14/12/99	15/1/2011	24.155	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.285,08	Pós-Fixado	55.196.107,40
BANCO ITAÚ S.A. BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A CFT-A		_A534 A535		14/12/99 14/12/99	15/2/2011 15/3/2011	24.155 24.155	IGP-DI IGP-DI	6,00 6,00	1.000,00	2.285,08 2.285,08	Pós-Fixado Pós-Fixado	55.196.107,40 55.196.107,40
BANCO ITAÚ S.A.		HSTN_	A535		14/12/99	15/4/2011	24.155	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.285,08	Pós-Fixado Pós-Fixado	55.196.107,40
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A		A537		14/12/99	15/5/2011	24.155	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.285,08	Pós-Fixado	55.196.107,40
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A		A538		14/12/99	15/6/2011	24.155	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.285,08	Pós-Fixado	55.196.107,40
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A		_A539		14/12/99	15/7/2011	24.155	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.285,08	Pós-Fixado	55.196.107,40
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A		_A540		14/12/99	15/8/2011	24.155	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.285,08	Pós-Fixado	55.196.107,40
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN_	_A541 A542		14/12/99 14/12/99	15/9/2011 15/10/2011	24.155	IGP-DI IGP-DI	6,00	1.000,00	2.285,08 2.285,08	Pós-Fixado	55.196.107,40
BANCO ITAU S.A. BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A		A542 A543		14/12/99	15/11/2011	24.155 24.155	IGP-DI	6,00 6.00	1.000,00	2.285.08	Pós-Fixado Pós-Fixado	55.196.107,40 55.196.107,40
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A		A544		14/12/99	15/12/2011	24.155	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.285,08	Pós-Fixado	55.196.107,40
BANCO ITAÚ S.A.		HSTN_	_A545		14/12/99	15/1/2012	23.181	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.285,08	Pós-Fixado	52.970.439,48
BANCO ITAÚ S.A.		HSTN_	_A546		14/12/99	15/2/2012	23.181	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.285,08	Pós-Fixado	52.970.439,48
BANCO ITAÚ S.A.		HSTN_	_A547		14/12/99	15/3/2012	23.181	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.285,08	Pós-Fixado	52.970.439,48
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A		_A548		14/12/99	15/4/2012	23.181	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.285,08	Pós-Fixado	52.970.439,48
BANCO ITAÚ S.A. BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A		_A549 A550		14/12/99 14/12/99	15/5/2012 15/6/2012	23.181 23.181	IGP-DI IGP-DI	6,00 6,00	1.000,00	2.285,08 2.285,08	Pós-Fixado Pós-Fixado	52.970.439,48 52.970.439,48
BANCO ITAÚ S.A.		HSTN	A551	14/12/99	14/12/99	15/7/2012	23.181	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.285.08	Pós-Fixado	52.970.439,48
BANCO ITAÚ S.A.		HSTN	_A552		14/12/99	15/8/2012	23.181	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.285,08	Pós-Fixado	52.970.439,48
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A		_A553		14/12/99	15/9/2012	23.181	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.285,08	Pós-Fixado	52.970.439,48
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	_	_A554		14/12/99	15/10/2012	23.181	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.285,08	Pós-Fixado	52.970.439,48
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A		_A555	14/12/99 14/12/99	14/12/99	15/11/2012	23.181	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.285,08 2.285,08	Pós-Fixado	52.970.439,48
BANCO ITAÚ S.A. BANCO ITAÚ S.A.		HSTN_ HSTN	_A556 A557		14/12/99 14/12/99	15/12/2012 15/1/2013	23.181 22.230	IGP-DI IGP-DI	6,00 6,00	1.000,00	2.285,08	Pós-Fixado Pós-Fixado	52.970.439,48 50.797.328,40
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A		A558		14/12/99	15/2/2013	22.230	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.285,08	Pós-Fixado	50.797.328,40
BANCO ITAÚ S.A.	-	HSTN	_A559	14/12/99	14/12/99	15/3/2013	22.230	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.285,08	Pós-Fixado	50.797.328,40
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A		_A560	14/12/99		15/4/2013	22.230	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.285,08	Pós-Fixado	50.797.328,40
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A			14/12/99		15/5/2013	22.230	IGP-DI	6,00	1.000,00	,	Pós-Fixado	50.797.328,40
BANCO ITAÚ S.A. BANCO ITAÚ S.A.				14/12/99 14/12/99		15/6/2013	22.230	IGP-DI IGP-DI	6,00			Pós-Fixado	50.797.328,40
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A		_	14/12/99		15/7/2013 15/8/2013	22.230 22.230	IGP-DI	6,00 6,00	1.000,00		Pós-Fixado Pós-Fixado	50.797.328,40 50.797.328,40
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A		_	14/12/99		15/9/2013	22.230	IGP-DI	6,00	1.000,00		Pós-Fixado	50.797.328,40
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A			14/12/99		15/10/2013	22.230	IGP-DI	6,00	1.000,00		Pós-Fixado	50.797.328,40
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A			14/12/99		15/11/2013	22.230	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.285,08	Pós-Fixado	50.797.328,40
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A			14/12/99		15/12/2013	22.230	IGP-DI	6,00	1.000,00		Pós-Fixado	50.797.328,40
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A			14/12/99		15/1/2014	19.128	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.285,08	Pós-Fixado	43.709.010,24
BANCO ITAÚ S.A. BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A CFT-A		A570 A571	14/12/99 14/12/99		15/2/2014 15/3/2014	19.128 19.128	IGP-DI IGP-DI	6,00 6.00	1.000,00	2.285,08 2.285,08	Pós-Fixado Pós-Fixado	43.709.010,24 43.709.010,24
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A			14/12/99		15/4/2014	19.128	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.285,08	Pós-Fixado	43.709.010,24
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A			14/12/99		15/5/2014	19.128	IGP-DI	6,00	1.000,00		Pós-Fixado	43.709.010,24
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN_	_A574	14/12/99	14/12/99	15/6/2014	19.128	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.285,08	Pós-Fixado	43.709.010,24
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A			14/12/99		15/7/2014	19.128	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.285,08	Pós-Fixado	43.709.010,24
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A			14/12/99		15/8/2014	19.128	IGP-DI	6,00	1.000,00		Pós-Fixado	43.709.010,24
BANCO ITAÚ S.A. BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A CFT-A			14/12/99 14/12/99		15/9/2014 15/10/2014	19.128 19.128	IGP-DI IGP-DI	6,00 6,00	1.000,00	2.285,08 2.285,08	Pós-Fixado Pós-Fixado	43.709.010,24 43.709.010,24
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A			14/12/99			19.128	IGP-DI	6,00	1.000,00		Pós-Fixado	43.709.010,24
BANCO ITAÚ S.A.						15/12/2014	19.304	IGP-DI	6,00	1.000,00		Pós-Fixado	44.111.184,32
TOTAL							1.712.359						3.912.877.303,72



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
biasii relecciii i articipações S/A	BRTP4	roo/ariit.	929	17,73	R\$ 16.471,17
Telecomunicações de São Paulo S/A	TLPP3	100/unit.	941	38,95	R\$ 36.651,95
relecondinicações de São Faulo S/A	TLPP4	roo/uriit.	941	43,70	R\$ 41.121,70
Vivo Participações S/A	VIVO3	100/unit.	521	44,99	R\$ 23.439,79
VIVO Faiticipações S/A	VIVO4	100/unit.	521	43,20	R\$ 22.507,20
Telemig Celular Participações S/A	TMCP3	100/unit.	92	56,00	R\$ 5.152,00
releting Cerulai Farticipações 3/A	TMCP4	92	58,20	R\$ 5.354,40	
Tim Participações	TCSL3	100/unit.	1.789	5,50	R\$ 9.839,50
Tilli Fatticipações	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
Tele Notte Celulai Farticipações S/A	TNCP4	100/uriit.	18	32,00	R\$ 576,00
Telecomunicações Brasileiras S/A	TELB3	100.000/ lote mil	929.258	0,79	R\$ 734,11
relectinum cações brasileiras S/A	TELB4	100.000/ lote IIIII	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 Multiplo S.A.(Itaú Holding Financeira S/A)	ITAU3	100/unit.	9.260	26,98	R\$ 249.834,80
Embratel Participações S/A	EBTP3 EBTP4	100.000/ lote mil	929.258 929.254	-,	R\$ 12.080,35 R\$ 12.080,30
Tele Norte Leste Participações S/A	TLNP3 TLNP4	100/unit.	929 1.146	-,	R\$ 37.624,50 R\$ 38.620,20
Contax Participações S/A	CTAX3 CTAX4	100/unit.	46 57	83,50 79,00	R\$ 3.841,00 R\$ 4.503,00
Telemar Norte Leste S/A RJ	TMAR3 TMAR6	100/unit.	22 22	62,00 45,55	R\$ 1.364,00 R\$ 1.002,10
SUB-TOTAL					R\$ 360.950,26
TOTAL					R\$ 562.535,85

Fonte: Banco do Brasil-Banco Real-Banco Itaú