



DIRETORIA DE INVESTIMENTOS

Relatório Mensal de Investimentos

JANEIRO

**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

JANEIRO DE 2010

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA DO RIOPREVIDÊNCIA	
A - Disponível	4.708.913.496
B - Segmento de Renda Fixa	3.995.860.517
1 - Carteiras Próprias	3.409.888.233
2- Operação Compromissada - Lastro: TPF	585.972.284
C - Segmento de Renda Variável	598.717
1 - Ativos em Enquadramento - Ações	598.717
D - Segmento de Imóveis	337.610.991
1 - Carteiras Próprias	337.610.991
E - Fundos de Investimento	374.843.272
1 - Fundos de Curto Prazo	0
2 - Fundos Referenciados DI	350.645.709
3 - Fundos de Renda Fixa RF IMA	24.197.562
4 - Fundos Multimercado	0
5 - Fundos de Ações	0

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

JANEIRO DE 2010

Posição consolidada da carteira do RIOPREVIDÊNCIA por tipo de risco	(R\$)	(% do total)
1- Títulos Públicos Federais	4.346.768.949	92,31%
1.1 - Prefixados (LTN, NTN-F)	0	0,00%
1.2 - Pós-fixados (LFT - Selic, LTN com DI-1 Selic, Op.Comp.)	919.595.230	19,53%
1.3 - IPCA (NTN-B)	17.285.487	0,37%
1.4 - IGP-DI (CFT - Carteira Própria)	3.409.888.233	72,41%
2- Títulos Privados	23.902.883	0,51%
2.1 - Emissores de baixo risco de crédito (*)	23.902.883	0,51%
4- Tesouraria (**)	31.956	0,00%
5- Imóveis	337.610.991	7,17%
6- Ativos em enquadramento - Ações (***)	598.717	0,01%
Total da Carteira	4.708.913.496	100,00%

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

(*) Valor em Cotas dos Fundos Caixa FI Brasil RF DI LP e Caixa FI Novo Brasil RF que estão alocados em títulos privados de baixo risco de crédito

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

(***) Ativos em enquadramento recebidos do IPERJ

JANEIRO 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>3.681.291.779</u>	<u>78,18%</u>	60% - 100%	Até 100%
Renda Fixa (*)	FI/FIC Referenciado	<u>79.242.163</u>	<u>1,68%</u>	0% - 30%	Até 80%
Renda Fixa (*)	FI/FR IMA	<u>24.197.562</u>	<u>0,51%</u>		Até 30%
Renda Fixa	Op. Compromissada com TPF	<u>585.972.284</u>	<u>12,44%</u>		Até 15%
Imóveis	Imóveis ou FII	<u>337.610.991</u>	<u>7,17%</u>	0% - 10%	Sem Limite
Renda Variável (**)	Ações (em enquadramento)	<u>598.717</u>	<u>0,01%</u>	-	-
Total		4.708.913.496	100,00%		

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

(*) Valor em Cotas dos Fundos Caixa FI Brasil RF DI LP e Caixa Novo Brasil RF 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 janeiro, as aplicações financeiras do RIOPREVIDÊNCIA se concentraram em cotas de fundos de investimento Referenciado DI, cujos lastros são predominantemente títulos públicos federais, em operações compromissadas indexadas ao CDI, e foi iniciada a alocação de recursos em fundos atrelados ao IMA.

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

JANEIRO 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	Tx. Adm. (% a.a.)
BB RPPS C.FIRF PREV.(*)	RF DI	BBDTVM	3.119.808.101,00	1,74559	5.445,90	0,00%	0,01	0,67	0,67	9,33	0,20
ITAÚ-GOV PP R EF. FI DI	RF DI	ITAÚ	36.850.102,75	44,91287	1.655,04	0,08%	1,39	0,65	0,65	9,35	0,15
SOBERANO-REF. DI LP	RF DI	ITAÚ	283.435.958,81	19,06269	5.403,05	3,30%	178,53	0,65	0,65	9,35	0,15
FI RF DI FEDERAL EXTRA	RF DI	BRADESCO	729.027.271,57	4,75008	3.462,94	2,64%	91,48	0,65	0,65	9,35	0,15
NOVO BRASIL RF CP LP (**)	RF CP	CAIXA	681.638.135,30	1,03241	703,73	3,44%	24,19	0,95	0,95	-	0,20
Fonte: RIOPREVIDÊNCIA, B.Brasil, Caixa, B.Itaú,Bradesco.							TOTAIS	374,84			

(*) Nova denominação do BB Reg. Próprio III

(**) Fundo constituído em 27/10/2009

Operações Compromissadas

JANEIRO DE 2010

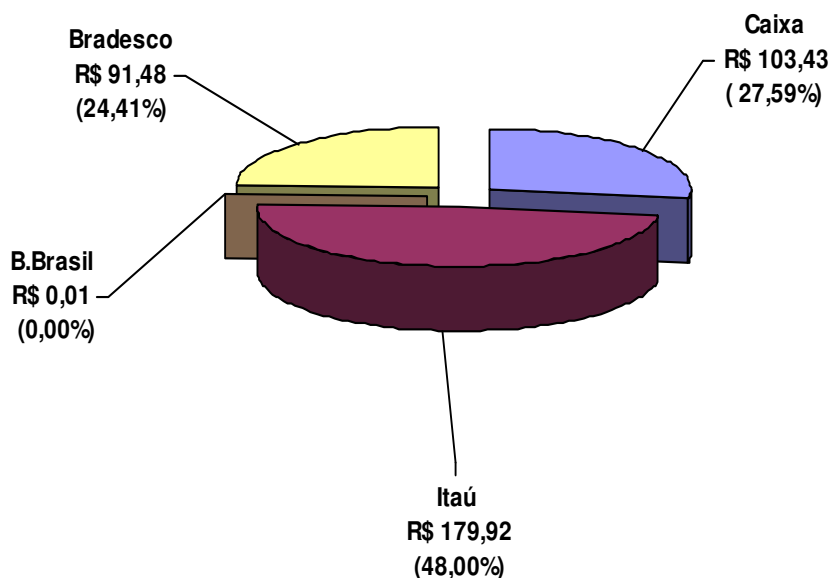
Instituição	CNPJ	Data da Contratação	Vencimento da Operação	% do Indexador	Lastro	Quantidade	P. Unitário (*)	Valor (**) Financeiro (R\$)
CAIXA	00360305000104	17/11/2009	17/3/2010	100,00% do CDI	NTN-B	59.639	1.812,817	109.938.356,84
CAIXA	00360305000104	11/12/2009	12/4/2010	100,00% do CDI	NTN-B	73.649	1.816,054	135.205.859,38
CAIXA	00360305000104	18/1/2010	18/5/2010	100,00% do CDI	NTN-B	183.974	1.847,127	340.828.068,17
TOTAL								585.972.284,39

Fonte: Caixa

(*) - Cotação na operação inicial

(**) - Posição em 29-01-2010

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.

Ativos em Enquadramento - Posição Acionária em 29/ 01/2010 - IPERJ E RIOPREVIDÊNCIA

IPERJ

AÇÕES	TIPO	QTD	COTAÇÃO 29/1/2010	VALOR	
Brasil Telecom Participações S/A	BRTP3	100/unit.	929	35,71	R\$ 33.174,59
	BRTP4		929	20,81	R\$ 19.332,49
Telecomunicações de São Paulo S/A	TLPP3	100/unit.	941	36,90	R\$ 34.722,90
	TLPP4		941	41,58	R\$ 39.126,78
Vivo Participações S/A	VIVO3	100/unit.	521	52,49	R\$ 27.347,29
	VIVO4		521	53,49	R\$ 27.868,29
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	7,00	R\$ 12.523,00
	TCSL4		1.789	4,95	R\$ 8.855,55
Tele Norte Celular Participações S/A	TNCP3	100/unit.	18	60,00	R\$ 1.080,00
	TNCP4		18	27,56	R\$ 496,08
Telecomunicações Brasileiras S/A	TELB3	100.000/ lote mil	929.258	1,80	R\$ 1.672,66
	TELB4		929.254	1,80	R\$ 1.672,66
SUB-TOTAL					R\$ 218.378,69

RIOPREVIDÊNCIA

AÇÕES	TIPO	QTD	COTAÇÃO 29/1/2010	VALOR	
Itaú Unibanco Banco Múltiplo S.A.(Itaú Holding Financeira S/A)	ITAU3	100/unit.	9.260	29,09	R\$ 269.373,40
Embratel Participações S/A	EBTP3	100.000/ lote mil	929.258	15,00	R\$ 13.938,87
	EBTP4		929.254	15,00	R\$ 13.938,81
Tele Norte Leste Participações S/A	TLNP3	100/unit.	929	39,89	R\$ 37.057,81
	TLNP4		1.146	33,60	R\$ 38.505,60
Contax Participações S/A (*)	CTAX4	100/unit.	200	24,80	R\$ 4.960,00
Telemar Norte Leste S/A RJ	TMAR3	100/unit.	22	70,98	R\$ 1.561,56
	TMAR6		22	45,55	R\$ 1.002,10
SUB-TOTAL					R\$ 380.338,15

TOTAL

R\$ 598.716,84

Fonte: Banco do Brasil-Banco Real-Banco Itaú

(*) Em 15/01/2010 ocorreu o desdobramento das ações PN e o grupamento das ações ON