



---

**DIRETORIA DE INVESTIMENTOS**

**Relatório Mensal de Investimentos**

**FEVEREIRO**

---

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](http://www.rioprevidencia.rj.gov.br)

## RELATÓRIO MENSAL DE INVESTIMENTOS

FEVEREIRO DE 2010

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA DO RIOPREVIDÊNCIA	
<b>A - Disponível</b>	<b>4.515.034.299</b>
<b>B - Segmento de Renda Fixa</b>	<b>3.633.060.417</b>
1 - Carteiras Próprias	3.354.345.546
2 - Operação Compromissada - Lastro: TPF	278.714.871
<b>C - Segmento de Renda Variável</b>	<b>583.018</b>
1 - Ativos em Enquadramento - Ações	583.018
<b>D - Segmento de Imóveis</b>	<b>337.610.991</b>
1 - Carteiras Próprias	337.610.991
<b>E - Fundos de Investimento</b>	<b>543.779.873</b>
1 - Fundos de Curto Prazo	0
2 - Fundos Referenciados DI	413.210.002
3 - Fundos de Renda Fixa RF IMA	130.569.871
4 - Fundos Multimercado	0
5 - Fundos de Ações	0

A composição das aplicações do RIOPREVIDÊNCIA no encerramento do mês de fevereiro se 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.

FEVEREIRO DE 2010

Posição consolidada da carteira do RIOPREVIDÊNCIA por tipo de risco	(R\$)	(% do total)
<b>1- Títulos Públicos Federais</b>	<b><u>4.157.146.955</u></b>	<b><u>92,07%</u></b>
1.1 - Prefixados (LTN, NTN-F)	0	0,00%
1.2 - Pós-fixados (LFT - Selic, LTN com DI-1 Selic, Op.Comp.)	714.048.563	15,81%
1.3 - IPCA (NTN-B)	88.752.846	1,97%
1.4 - IGP-DI (CFT - Carteira Própria)	3.354.345.546	74,29%
<b>2- Títulos Privados</b>	<b><u>19.691.463</u></b>	<b><u>0,44%</u></b>
2.1 - Emissores de baixo risco de crédito (*)	19.691.463	0,44%
<b>4- Tesouraria (**)</b>	<b><u>1.873</u></b>	<b><u>0,00%</u></b>
<b>5- Imóveis</b>	<b><u>337.610.991</u></b>	<b><u>7,48%</u></b>
<b>6- Ativos em enquadramento - Ações (***)</b>	<b><u>583.018</u></b>	<b><u>0,01%</u></b>
<b>Total da Carteira</b>	<b><u>4.515.034.299</u></b>	<b><u>100,00%</u></b>

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, Itaú Soberano, Bradesco F. Extra RF DI e Caixa N. Brasil, B. Brasil Atuarial e B. Brasil Liquidez.

(\*\*\*) Ativos em enquadramento recebidos do IPERJ

FEVEREIRO 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>3.699.896.126</u>	<u>81,95%</u>	60% - 100%	Até 100%
Renda Fixa (*)	FI/FIC Referenciado	<u>67.658.327</u>	<u>1,50%</u>	0% - 30%	Até 80%
Renda Fixa (**)	FI/FR IMA	<u>130.570.966</u>	<u>2,89%</u>		Até 30%
Renda Fixa	Op. Compromissada com TPF	<u>278.714.871</u>	<u>6,17%</u>		Até 15%
Imóveis	Imóveis ou FII	<u>337.610.991</u>	<u>7,48%</u>	0% - 10%	Sem Limite
Renda Variável (***)	Ações ( em enquadramento)	<u>583.018</u>	<u>0,01%</u>	-	-
<b>Total</b>		<b>4.515.034.299</b>	<b>100,00%</b>		

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

(\*\*) Valor em Cotas dos Fundos Caixa Novo Brasil RF, B.Brasil Atuarial e B. Brasil Liquidez, que permitem a alocação em títulos indexados ao IMA e IRF-M

(\*\*\*) Ativos em enquadramento recebidos do IPERJ

Em fevereiro, 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. Além disso, 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.

FEVEREIRO 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.)	
FI BRASIL REF DI LP	RF DI	CAIXA	693.186.329,50	1,45190	1.006,44	6,72%	67,66	0,58	1,25	9,27	0,20	
BB RPPS C.FIRF PREV.(*)	RF DI	BBDTV	2.977.137.240,98	1,76064	5.241,66	0,33%	17,21	0,86	1,54	9,35	0,20	
ITAÚ-GOV PP R EF. FI DI	RF DI	ITAÚ	38.828.246,21	45,17447	1.754,05	0,01%	0,17	0,58	1,23	9,06	0,15	
SOBERANO-REF. DI LP	RF DI	ITAÚ	301.341.567,96	19,17374	5.777,84	4,94%	285,59	0,58	1,23	9,07	0,15	
FI RF DI FEDERAL EXTRA	RF DI	BRADESCO	716.083.255,09	4,77776	3.421,27	1,75%	59,96	0,58	1,24	9,01	0,15	
NOVO BRASIL RF CP LP (**)	RF CP	CAIXA	1.148.415.860,00	1,04683	1.202,19	9,43%	113,36	1,40	2,36	-	0,20	
BB RPPS LIQUIDEZ (***)	RF DI	BBDTV	598.069.118,86	1,02529	613,20	0,02%	0,11	0,90	1,95	-	0,30	
Fonte: RIOPREVIDÊNCIA, B.Brasil, Caixa, B.Itaú,Bradesco.							<b>TOTAIS</b>	<b>543,78</b>				

(\*) Nova denominação do BB Reg. Próprio III

(\*\*) Fundo constituído em 27/10/2009

(\*\*\*) Fundo constituído em 08/12/2009

## Operações Compromissadas

FEVEREIRO DE 2010

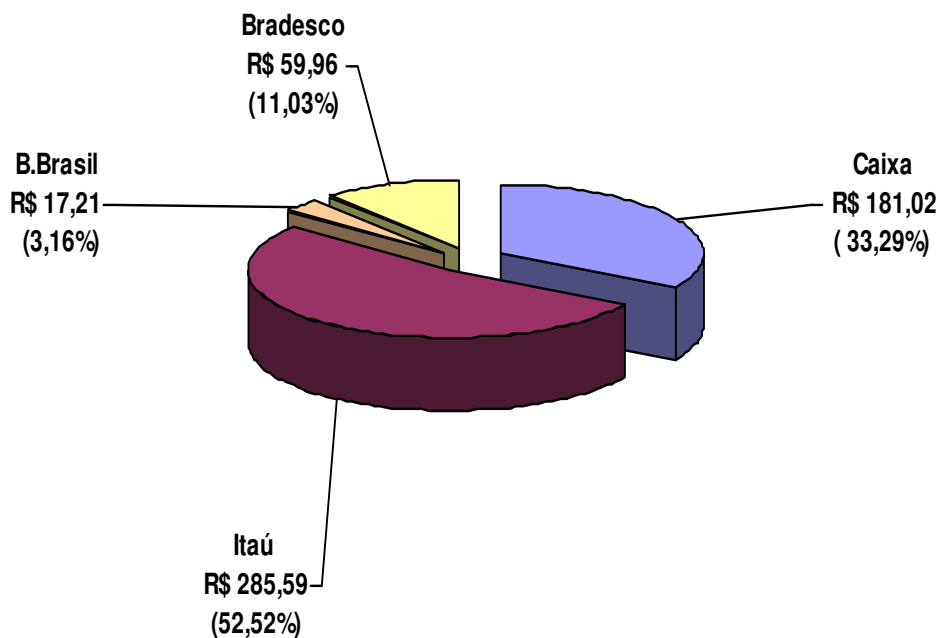
Instituição	CNPJ	Data da Contratação	Vencimento da Operação	% do Indexador	Lastro	Quantidade	P. Unitário (*)	Valor (**) Financeiro (R\$)
CAIXA	00360305000104	18/1/2010	18/5/2010	100,00% do CDI	NTN-B	149.560	1.847,127	278.714.871,21
<b>TOTAL</b>								<b>278.714.871,21</b>

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 CMN nº 3.790/09, essas ações serão vendidas até o final de 2010.

### Ativos em Enquadramento - Posição Acionária em 26/ 02/2010 - 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	35,00	R\$ 32.935,00
	TLPP4		941	39,40	R\$ 37.075,40
Vivo Participações S/A	VIVO3	100/unit.	521	48,17	R\$ 25.096,57
	VIVO4		521	47,27	R\$ 24.627,67
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	7,35	R\$ 13.149,15
	TCSL4		1.789	5,14	R\$ 9.195,46
Tele Norte Celular Participações S/A	TNCP3	100/unit.	18	55,00	R\$ 990,00
	TNCP4		18	33,00	R\$ 594,00
Telecomunicações Brasileiras S/A	TELB3	100.000/ lote mil	929.258	2,33	R\$ 2.165,17
	TELB4		929.254	2,38	R\$ 2.211,62
<b>SUB-TOTAL</b>					<b>R\$ 211.053,53</b>

#### 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	28,89	R\$ 267.521,40
Embratel Participações S/A	EBTP3	100.000/ lote mil	929.258	14,00	R\$ 13.009,61
	EBTP4		929.254	14,20	R\$ 13.195,41
Tele Norte Leste Participações S/A	TLNP3	100/unit.	929	37,50	R\$ 34.837,50
	TLNP4		1.146	31,30	R\$ 35.869,80
Contax Participações S/A (*)	CTAX4	100/unit.	200	25,00	R\$ 5.000,00
Telemar Norte Leste S/A RJ	TMAR3	100/unit.	22	69,49	R\$ 1.528,78
	TMAR6		22	45,55	R\$ 1.002,10
<b>SUB-TOTAL</b>					<b>R\$ 371.964,60</b>

#### TOTAL

**R\$ 583.018,12**

Fonte: Banco do Brasil-Banco Real-Banco Itaú

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