



---

# **DIRETORIA DE INVESTIMENTOS**

## **Relatório Mensal de Investimentos**

### **ABRIL**

---

**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

ABRIL DE 2010

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA DO RIOPREVIDÊNCIA	
<b>A - Disponível</b>	<b>3.967.837.291</b>
<b>B - Segmento de Renda Fixa</b>	<b>3.376.440.398</b>
1 - Carteiras Próprias	3.229.474.851
2 - Operação Compromissada - Lastro: TPF	146.965.547
<b>C - Segmento de Renda Variável</b>	<b>554.269</b>
1 - Ativos em Enquadramento - Ações	554.269
<b>D - Segmento de Imóveis</b>	<b>328.383.779</b>
1 - Carteiras Próprias	328.383.779
<b>E - Fundos de Investimento</b>	<b>262.458.846</b>
1 - Fundos de Curto Prazo	0
2 - Fundos Referenciados DI	262.458.846
3 - Fundos de Renda Fixa RF IMA	0
4 - Fundos Multimercado	0
5 - Fundos de Ações	0

A composição das aplicações do RIOPREVIDÊNCIA no encerramento do mês de abril 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.

ABRIL DE 2010

Posição consolidada da carteira do RIOPREVIDÊNCIA por tipo de risco	(R\$)	(% do total)
<b>1- Títulos Públicos Federais</b>	<b><u>3.638.879.303</u></b>	<b><u>91,71%</u></b>
1.1 - Prefixados (LTN, NTN-F)	0	0,00%
1.2 - Pós-fixados (LFT - Selic, LTN com DI-1 Selic, Op.Comp.)	409.404.452	10,32%
1.3 - IPCA (NTN-B)	0	0,00%
1.4 - IGP-DI (CFT - Carteira Própria)	3.229.474.851	81,39%
<b>2- Títulos Privados</b>	<b><u>0</u></b>	<b><u>0,00%</u></b>
2.1 - Emissores de baixo risco de crédito (*)	0	0,00%
<b>4- Tesouraria (**)</b>	<b><u>19.941</u></b>	<b><u>0,00%</u></b>
<b>5- Imóveis</b>	<b><u>328.383.779</u></b>	<b><u>8,28%</u></b>
<b>6- Ativos em enquadramento - Ações (***)</b>	<b><u>554.269</u></b>	<b><u>0,01%</u></b>
<b>Total da Carteira</b>	<b><u>3.967.837.291</u></b>	<b><u>100,00%</u></b>

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

(\*\*) Recursos mantidos em Tesouraria nos Fundos: Itaú Soberano, Bradesco F. Extra RF DI

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

ABRIL 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>3.491.933.697</u>	<u>88,01%</u>	60% - 100%	Até 100%
Renda Fixa	FI/FIC Referenciado	<u>0</u>	<u>0,00%</u>	0% - 30%	Até 80%
Renda Fixa	Op. Compromissada com TPF	<u>146.965.547</u>	<u>3,70%</u>		Até 15%
Imóveis	Imóveis ou FII	<u>328.383.779</u>	<u>8,28%</u>	0% - 10%	Sem Limite
Renda Variável (*)	Ações ( em enquadramento)	<u>554.269</u>	<u>0,01%</u>	-	-
<b>Total</b>		<b>3.967.837.291</b>	<b>100,00%</b>		

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

(\*) Ativos em enquadramento recebidos do IPERJ

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)

Em abril, 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.

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

ABRIL DE 2010

Fundos de Investimento			Participação do RIOPREVIDÊNCIA nos Fundos de Investimento					Rent. Acum. (%)			Tx. Adm.
Nome do Fundo	Tipo	Gestor	Quantidade	Valor	PL dos	Part. %	Valor	Mês	Ano	12 Meses	(% a.a.)
	de		Total	Unitário	Fundos	no PL dos	dos Fundos				
	Fundo		de Cotas	das Cotas	R\$ MM	Fundos	R\$ MM				
SOBERANO-REF. DI LP	RF DI	ITAÚ	279.792.467,81	19,44241	5.439,84	4,26%	231,81	0,65	2,65	8,64	0,15
FI RF DI FEDERAL EXTRA	RF DI	BRADESCO	704.889.203,23	4,84468	3.414,96	0,90%	30,65	0,65	2,65	8,64	0,15
<b>TOTAIS</b>							<b>262,46</b>				

Fonte: RIOPREVIDÊNCIA, B.Itaú, Bradesco.

## Operações Compromissadas

ABRIL 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	77.756	1.847,127	146.965.547,27

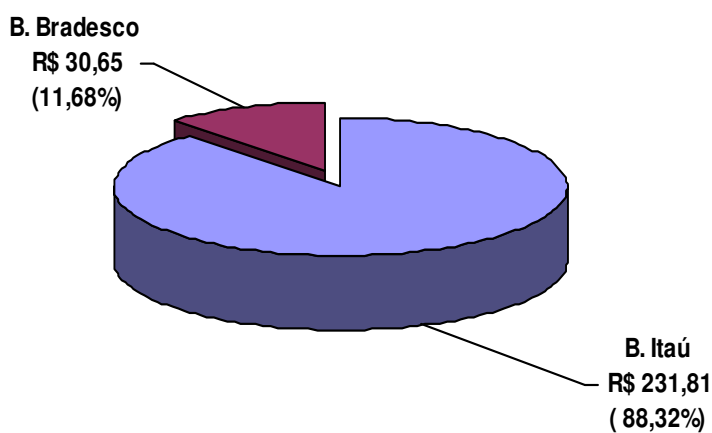
**TOTAL** 146.965.547,27

Fonte: Caixa

(\*) - Cotação na operação inicial

(\*\*) - Posição em 30-04-2010

## 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 30/04/2010 - RIOPREVIDÊNCIA

AÇÕES	TIPO	QTD	COTAÇÃO 30/4/2010	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	29,78	R\$ 28.022,98
	TLPP4		941	34,00	R\$ 31.994,00
Vivo Participações S/A	VIVO3	100/unit.	521	46,29	R\$ 24.117,09
	VIVO4		521	46,20	R\$ 24.070,20
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	6,10	R\$ 10.912,90
	TCSL4		1.789	4,52	R\$ 8.086,28
Tele Norte Celular Participações S/A	TNCP3	100/unit.	18	55,00	R\$ 990,00
	TNCP4		18	26,29	R\$ 473,22
Telecomunicações Brasileiras S/A	TELB3	100.000/ lote mil	929.258	2,00	R\$ 1.858,52
	TELB4		929.254	2,00	R\$ 1.858,51
Itaú Unibanco Banco Múltiplo S.A.(Itaú Holding Financeira S/A )	ITAU3	100/unit.	9.260	29,69	R\$ 274.929,40
Embratel Participações S/A	EBTP3	100.000/ lote mil	929.258	9,76	R\$ 9.069,56
	EBTP4		929.254	10,01	R\$ 9.301,83
Tele Norte Leste Participações S/A	TLNP3	100/unit.	929	31,30	R\$ 29.077,70
	TLNP4		1.146	26,24	R\$ 30.071,04
Contax Participações S/A (*)	CTAX4	100/unit.	200	21,60	R\$ 4.320,00
Telemar Norte Leste S/A RJ	TMAR3	100/unit.	22	49,99	R\$ 1.099,78
	TMAR6		22	45,55	R\$ 1.002,10
<b>TOTAL</b>					<b>R\$ 554.268,58</b>

Fonte: Banco do Brasil-Banco Real-Banco Itaú

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