



---

**DIRETORIA DE INVESTIMENTOS**

**Relatório Mensal de Investimentos**

**SETEMBRO**

---

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  
Luciana Pinto Venâncio  
Marcio Martins Rocha Ramos

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

Setembro de 2010

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA DO RIOPREVIDÊNCIA	
<b>A - Disponível</b>	<b>3.695.928.424</b>
<b>B - Segmento de Renda Fixa</b>	<b>3.136.502.790</b>
1 - Carteiras Próprias	2.882.973.270
2 - Operação Compromissada - Lastro: TPF	253.529.520
<b>C - Segmento de Renda Variável</b>	<b>70.214</b>
1 - Ativos em Enquadramento - Ações	70.214
<b>D - Segmento de Imóveis</b>	<b>331.006.409</b>
1 - Carteiras Próprias	331.006.409
<b>E - Fundos de Investimento</b>	<b>228.349.011</b>
1 - Fundos de Curto Prazo	0
2 - Fundos Referenciados DI	108.734.331
3 - Fundos de Renda Fixa RF IMA	119.614.680
4 - Fundos Multimercado	0
5 - Fundos de Ações	0

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

Setembro de 2010

Posição consolidada da carteira do RIOPREVIDÊNCIA por tipo de risco	(R\$)	(% do total)
<b>1- Títulos Públicos Federais</b>	<b><u>3.355.307.463</u></b>	<b><u>90,78%</u></b>
1.1 - Prefixados (LTN, NTN-F)	91.929.621	2,49%
1.2 - Pós-fixados (LFT - Selic, LTN com DI-1 Selic, Op.Comp.)	380.404.572	10,29%
1.3 - IPCA (NTN-B)	0	0,00%
1.4 - IGP-DI (CFT - Carteira Própria)	2.882.973.270	78,00%
<b>2- Títulos Privados</b>	<b><u>9.085.540</u></b>	<b><u>0,25%</u></b>
2.1 - Emissores de baixo risco de crédito (*)	9.085.540	0,25%
<b>3- Tesouraria (**)</b>	<b><u>458.798</u></b>	<b><u>0,01%</u></b>
<b>4- Imóveis</b>	<b><u>331.006.409</u></b>	<b><u>8,96%</u></b>
<b>5- Ativos em enquadramento - Ações (***)</b>	<b><u>70.214</u></b>	<b><u>0,00%</u></b>
<b>Total da Carteira</b>	<b><u>3.695.928.424</u></b>	<b><u>100,00%</u></b>

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

(\*) Valor em Cotas do Fundo Caixa FI Brasil RF DI LP que está alocado em títulos privados de baixo risco de crédito

(\*\*) Recursos mantidos em Tesouraria nos Fundos: Caixa FI Brasil, Itaú Soberano, BNP Paribas Fix e BB RPPS Liquidez

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

Setembro 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>3.024.339.289</u>	<u>81,83%</u>	60% - 100%	Até 100%
Renda Fixa (*)	FI/FIC Referenciado	<u>86.982.992</u>	<u>2,35%</u>	0% - 30%	Até 80%
Renda Fixa	Op. Compromissada com TPF	<u>253.529.520</u>	<u>6,86%</u>		Até 15%
Imóveis	Imóveis ou FII	<u>331.006.409</u>	<u>8,96%</u>	0% - 10%	Sem Limite
Renda Variável (**)	Ações ( em enquadramento)	<u>70.214</u>	<u>0,00%</u>	-	-
<b>Total</b>		<b>3.695.928.424</b>	<b>100,00%</b>		

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

(\*) Valor em Cotas do Fundo Caixa FI Brasil RF DI LP 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 setembro, 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. Destacam-se as aplicações atreladas ao IMA, que têm aumentado em nossos investimentos.

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

Setembro 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	REF DI	CAIXA	306.794.456,63	1,53408	470,65	18,48%	86,98	0,84	6,98	9,20	0,20
BRASIL SOBERANO FI (*)	REF DI	CAIXA	246.519.746,84	1,03790	255,86	17,87%	45,73	0,83	3,79	-	0,20
BB RPPS LIQUIDEZ FIC FI(**)	R Fixa	BBDTVM	934.695.299,86	1,09332	1.021,92	7,03%	71,87	0,83	8,71	-	0,30
SOBERANO-REF. DI LP	REF DI	ITAÚ	214.953.304,49	20,24634	4.352,02	0,50%	21,75	0,83	6,90	9,09	0,15
BNP Paribas Fix IRFM-1 (***)	REF DI	BNP Asset	161.948,62	101,23314	16,39	12,32%	2,02	0,81	1,23	-	0,20
<b>TOTAL</b>							<b>228,35</b>				

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

(\*) Fundo constituído em maio/2010.

(\*\*) Fundo constituído em dez/2009.

(\*\*\*) Fundo constituído em jun/2010.

## Operações Compromissadas

Setembro de 2010

Instituição	CNPJ	Data da Contratação	Vencimento da Operação	% do Indexador	Lastro	Quantidade	P. Unitário (*)	Valor (**) Financeiro (R\$)
CAIXA	00360305000104	11/8/2010	9/12/2010	100,00% do CDI	NTN-B	129.712	1.927,340	253.529.520,06
<b>TOTAL</b>								<b>253.529.520,06</b>

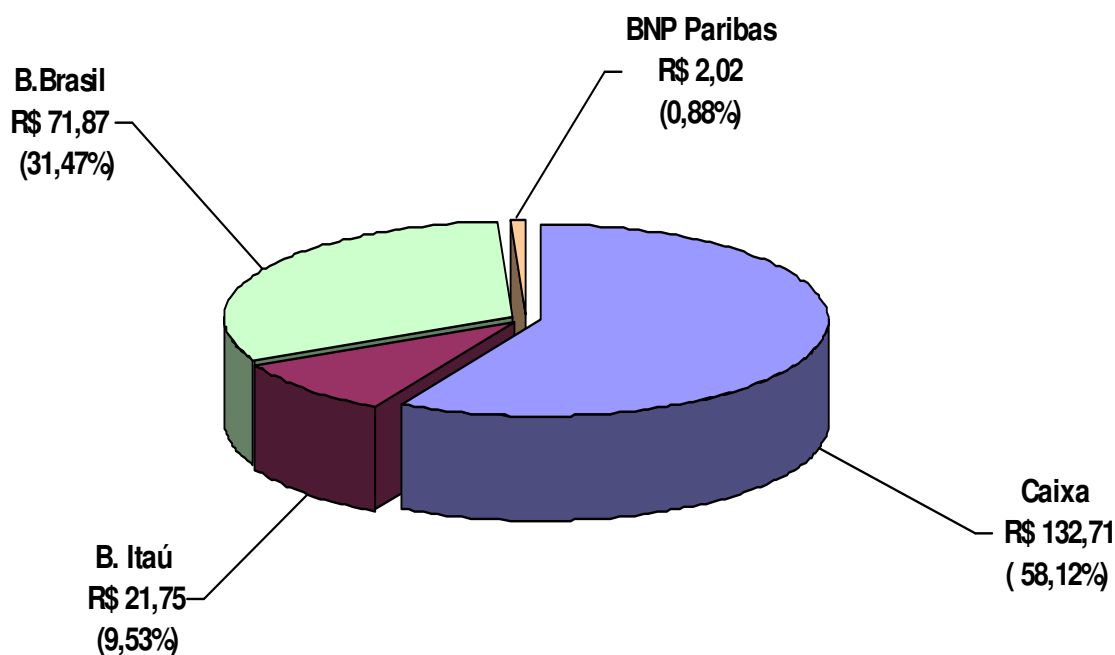
Fonte: Caixa

(\*) - Cotação na operação inicial

(\*\*) - Posição em 30-09-2010

No encerramento do mês de setembro, as aplicações financeiras em fundos de investimento totalizaram R\$ 228.349.011,33, distribuídos da forma abaixo:

### 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 30/09/2010 - RIOPREVIDÊNCIA

AÇÕES	TIPO	QTD	COTAÇÃO 30/9/2010	VALOR	
Brasil Telecom Participações S/A	B RTP3	100/unit.	1.292	15,00	R\$ 19.380,00
Telecomunicações de São Paulo S/A	TLPP3	100/unit.	41	36,71	R\$ 1.505,11
Tele Norte Celular Participações S/A	TNCP3	100/unit.	18	40,70	R\$ 732,60
Embratel Participações S/A	EBTP3	100.000/ lote mil	929.258	10,50	R\$ 9.757,21
	EBTP4		929.254	10,50	R\$ 9.757,17
Tele Norte Leste Participações S/A	TLNP3	100/unit.	1	31,45	R\$ 31,45
	TLNP4		1.146	24,20	R\$ 27.733,20
Telemar Norte Leste S/A RJ	TMAR3	100/unit.	22	59,89	R\$ 1.317,58
<b>TOTAL</b>					<b>R\$ 70.214,32</b>

Fonte: Banco Itaú