



DIRETORIA DE INVESTIMENTOS

Relatório Mensal de Investimentos

OUTUBRO

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

RELATÓRIO MENSAL DE INVESTIMENTOS

Outubro de 2010

| CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA DO RIOPREVIDÊNCIA | |
|--|----------------------|
| A - Disponível | 3.489.671.745 |
| B - Segmento de Renda Fixa | 2.818.353.275 |
| 1 - Carteiras Próprias | 2.818.353.275 |
| 2 - Operação Compromissada - Lastro: TPF | 0 |
| C - Segmento de Renda Variável | 45.096 |
| 1 - Ativos em Enquadramento - Ações | 45.096 |
| D - Segmento de Imóveis | 345.733.844 |
| 1 - Carteiras Próprias | 345.733.844 |
| E - Fundos de Investimento | 325.539.530 |
| 1 - Fundos de Curto Prazo | 0 |
| 2 - Fundos Referenciados DI | 162.752.169 |
| 3 - Fundos de Renda Fixa RF IMA | 162.787.361 |
| 4 - Fundos Multimercado | 0 |
| 5 - Fundos de Ações | 0 |

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, da Portaria MPS nº 345 e do Plano Anual de Investimentos.

Outubro de 2010

| Posição consolidada da carteira do RIOPREVIDÊNCIA por tipo de risco | (R\$) | (% do total) |
|---|-----------------------------|-----------------------|
| 1- Títulos Públicos Federais | <u>3.141.782.553</u> | <u>90,03%</u> |
| 1.1 - Prefixados (LTN, NTN-F) | 123.155.275 | 3,53% |
| 1.2 - Pós-fixados (LFT - Selic, LTN com DI-1 Selic, Op.Comp.) | 200.274.003 | 5,74% |
| 1.3 - IPCA (NTN-B) | 0 | 0,00% |
| 1.4 - IGP-DI (CFT - Carteira Própria) | 2.818.353.275 | 80,76% |
| 2- Títulos Privados | <u>1.131.121</u> | <u>0,03%</u> |
| 2.1 - Emissores de baixo risco de crédito (*) | 1.131.121 | 0,03% |
| 3- Tesouraria (**) | <u>979.131</u> | <u>0,03%</u> |
| 4- Imóveis | <u>345.733.844</u> | <u>9,91%</u> |
| 5- Ativos em enquadramento - Ações (***) | <u>45.096</u> | <u>0,00%</u> |
| Total da Carteira | <u>3.489.671.745</u> | <u>100,00%</u> |

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: Itaú Soberano, BNP Paribas Fix e BB RPPS Liquidez

(***) Ativos em enquadramento recebidos do IPERJ

Outubro 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>3.135.054.233</u> | <u>89,84%</u> | 60% - 100% | Até 100% |
| Renda Fixa (*) | FI/FIC Referenciado | <u>8.838.572</u> | <u>0,25%</u> | 0% - 30% | Até 80% |
| Renda Fixa | Op. Compromissada com TPF | <u>0</u> | <u>0,00%</u> | | Até 15% |
| Imóveis | Imóveis ou FIL | <u>345.733.844</u> | <u>9,91%</u> | 0% - 10% | Sem Limite |
| Renda Variável (**) | Ações (em enquadramento) | <u>45.096</u> | <u>0,00%</u> | - | - |
| Total | | 3.489.671.745 | 100,00% | | |

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

(*) 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

FIL - Fundo de Investimento Imobiliário

PAI - Plano Anual de Investimentos (Limites inferior e superior definidos no PAI)

(**) Ativos em enquadramento recebidos do IPERJ

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 aplicações atreladas ao IMA, que têm aumentado em nossos investimentos. Destacam-se ainda no mês, as operações compromissadas indexadas ao CDI, que foram resgatadas antes do encerramento do mês. 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 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 | 250.711.545,03 | 1,54639 | 387,70 | 2,28% | 8,84 | 0,80 | 7,83 | 9,32 | 0,20 |
| BRASIL SOBERANO FI (*) | REF DI | CAIXA | 325.988.702,90 | 1,04653 | 341,16 | 13,51% | 46,11 | 0,83 | 4,65 | - | 0,20 |
| BB RPPS LIQUIDEZ FIC FI(**) | R Fixa | BBDTVM | 969.133.352,23 | 1,10230 | 1.068,27 | 10,73% | 114,64 | 0,82 | 9,60 | - | 0,30 |
| SOBERANO-REF. DI LP | REF DI | ITAÚ | 179.939.459,51 | 20,40715 | 3.672,05 | 4,19% | 153,91 | 0,79 | 7,75 | 9,22 | 0,15 |
| BNP Paribas Fix IRFM-1 (***) | REF DI | BNP Asset | 161.948,62 | 102,06532 | 16,53 | 12,32% | 2,04 | 0,82 | 2,07 | - | 0,20 |
| TOTAL | | | | | | | 325,54 | | | | |

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

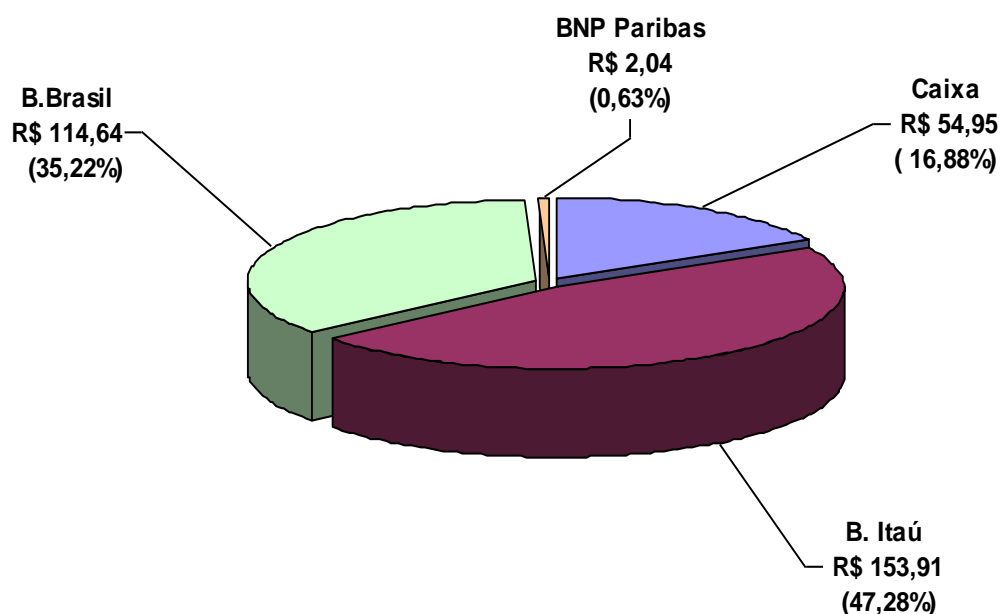
(*) Fundo constituído em maio/2010.

(**) Fundo constituído em dez/2009.

(***) Fundo constituído em jun/2010.

No encerramento do mês de outubro, as aplicações financeiras em fundos de investimento totalizaram R\$ 325.539.529,81, 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 29/10/2010 - RIOPREVIDÊNCIA

| AÇÕES | TIPO | QTD | COTAÇÃO 29/10/2010 | VALOR | |
|--------------------------------------|-------|-------------------|-----------------------|-------|----------------------|
| Telecomunicações de São Paulo S/A | TLPP3 | 100/unit. | 41 | 38,90 | R\$ 1.594,90 |
| Tele Norte Celular Participações S/A | TNCP3 | 100/unit. | 18 | 40,70 | R\$ 732,60 |
| Embratel Participações S/A | EBTP4 | 100.000/ lote mil | 929.254 | 10,84 | R\$ 10.073,11 |
| Tele Norte Leste Participações S/A | TNLP3 | 100/unit. | 1 | 34,15 | R\$ 34,15 |
| | TNLP4 | 100/unit. | 1.146 | 26,05 | R\$ 29.853,30 |
| Telemar Norte Leste S/A RJ | TMAR3 | 100/unit. | 22 | 61,00 | R\$ 1.342,00 |
| Brasil Telecom S/A | BRT03 | 100/unit. | 92 | 15,93 | R\$ 1.465,56 |
| TOTAL | | | | | R\$ 45.095,62 |



Carteira Própria

Certificados Financeiros do Tesouro - Posição em Outubro de 2010

| Custodiante | Ativo | Código | Data de Emissão | Data de Compra | Data de Vencimento | Quantidade | Indexador | Cupom/ Taxa (%aa) | PU Compra (R\$) | PU Atual (R\$) | Característica do Título | Valor Financeiro (R\$) |
|-----------------|-------|-----------|-----------------|----------------|--------------------|------------|-----------|----------------------|--------------------|-------------------|-----------------------------|------------------------------|
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A531 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/11/2010 | 38.998 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 96.201.436,34 |
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A532 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/12/2010 | 38.998 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 96.201.436,34 |
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A533 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/1/2011 | 24.155 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 59.586.278,65 |
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A534 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/2/2011 | 24.155 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 59.586.278,65 |
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A535 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/3/2011 | 24.155 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 59.586.278,65 |
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A536 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/4/2011 | 24.155 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 59.586.278,65 |
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A537 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/5/2011 | 24.155 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 59.586.278,65 |
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A538 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/6/2011 | 24.155 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 59.586.278,65 |
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A539 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/7/2011 | 24.155 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 59.586.278,65 |
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A540 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/8/2011 | 24.155 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 59.586.278,65 |
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A541 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/9/2011 | 24.155 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 59.586.278,65 |
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A542 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/10/2011 | 24.155 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 59.586.278,65 |
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A543 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/11/2011 | 24.155 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 59.586.278,65 |
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A544 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/12/2011 | 24.155 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 59.586.278,65 |
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A545 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/1/2012 | 23.181 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 57.183.586,23 |
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A546 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/2/2012 | 23.181 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 57.183.586,23 |
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A547 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/3/2012 | 23.181 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 57.183.586,23 |
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A548 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/4/2012 | 23.181 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 57.183.586,23 |
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A549 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/5/2012 | 23.181 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 57.183.586,23 |
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A550 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/6/2012 | 23.181 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 57.183.586,23 |
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A551 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/7/2012 | 23.181 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 57.183.586,23 |
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A552 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/8/2012 | 23.181 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 57.183.586,23 |
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A553 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/9/2012 | 23.181 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 57.183.586,23 |
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A554 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/10/2012 | 23.181 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 57.183.586,23 |
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A555 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/11/2012 | 23.181 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 57.183.586,23 |
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A556 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/12/2012 | 23.181 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 57.183.586,23 |
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A557 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/1/2013 | 22.230 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 54.837.630,90 |
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A558 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/2/2013 | 22.230 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 54.837.630,90 |
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A559 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/3/2013 | 22.230 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 54.837.630,90 |
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A560 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/4/2013 | 22.230 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 54.837.630,90 |
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A561 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/5/2013 | 22.230 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 54.837.630,90 |
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A562 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/6/2013 | 22.230 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 54.837.630,90 |
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A563 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/7/2013 | 22.230 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 54.837.630,90 |
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A564 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/8/2013 | 22.230 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 54.837.630,90 |
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A565 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/9/2013 | 22.230 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 54.837.630,90 |
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A566 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/10/2013 | 22.230 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 54.837.630,90 |
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A567 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/11/2013 | 22.230 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 54.837.630,90 |
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A568 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/12/2013 | 22.230 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 54.837.630,90 |
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A569 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/1/2014 | 19.128 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 47.185.524,24 |
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A570 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/2/2014 | 19.128 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 47.185.524,24 |
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A571 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/3/2014 | 19.128 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 47.185.524,24 |
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A572 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/4/2014 | 19.128 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 47.185.524,24 |
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A573 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/5/2014 | 19.128 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 47.185.524,24 |
| 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 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 47.185.524,24 |
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A575 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/7/2014 | 19.128 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 47.185.524,24 |
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A576 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/8/2014 | 19.128 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 47.185.524,24 |
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A577 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/9/2014 | 19.128 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 47.185.524,24 |
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A578 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/10/2014 | 19.128 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 47.185.524,24 |
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A579 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/11/2014 | 19.128 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 47.185.524,24 |
| BANCO ITAÚ S.A. | CFT-A | HSTN_A580 | 14/12/99 | 14/12/99 | 15/12/2014 | 19.304 | IGP-DI | 6,00 | 1.000,00 | 2.466,83 | Pós-Fixado | 47.619.686,32 |

1.142.500

2.818.353.275,00