



DIRETORIA DE INVESTIMENTOS

Relatório Mensal de Investimentos

NOVEMBRO

Rio de Janeiro
2009

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
Sueli Fonseca Guimarães Oliveira
Ubirajara da Silva Coelho

RELATÓRIO MENSAL DE INVESTIMENTOS

NOVEMBRO DE 2009

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA DO RIOPREVIDÊNCIA	
A - Disponível	5.561.533.533
B - Segmento de Renda Fixa	4.588.350.478
1 - Carteiras Próprias	3.822.190.795
2- Operação Compromissada - Lastro: TPF	766.159.684
C - Segmento de Renda Variável	613.887
1 - Ativos em Enquadramento - Ações	613.887
D - Segmento de Imóveis	333.157.149
1 - Carteiras Próprias	333.157.149
E - Fundos de Investimento	639.412.019
1 - Fundos de Curto Prazo	0
2 - Fundos Referenciados DI	639.152.019
3 - Fundos de Renda Fixa RF IMA	260.000
4 - Fundos Multimercado	0
5 - Fundos de Ações	0

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

NOVEMBRO DE 2009

Posição consolidada da carteira do RIOPREVIDÊNCIA por tipo de risco	(R\$)	(% do total)
1- Títulos Públicos Federais	5.191.586.463	93,35%
1.1 - Prefixados (LTN, NTN-F)	0	0,00%
1.2 - Pós-fixados (LFT - Selic, LTN com DI-1 Selic, Op.Comp.)	1.369.226.654	24,62%
1.3 - IPCA (NTN-B)	169.014	0,00%
1.4 - IGP-DI (CFT - Carteira Própria)	3.822.190.795	68,73%
2- Títulos Privados	35.119.189	0,63%
2.1 - FI com CDB de bancos de 1ª linha (*)	35.119.189	0,63%
4- Tesouraria (**)	1.056.846	0,02%
5- Imóveis	333.157.149	5,99%
6- Ativos em enquadramento - Ações (***)	613.887	0,01%
Total da Carteira	5.561.533.533	100,00%

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

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

(**) Recursos mantidos em Tesouraria nos Fundos: Itaú Gov. PP e Soberano DI FI

(***) Ativos em enquadramento recebidos do IPERJ

NOVEMBRO DE 2009

Segmento	Tipo de Ativo	Valores (R\$)	(%)	Limites PAI (% total)	Limite da Res. nº 3.790/09
Renda Fixa	TPF,FI/FIC 100% TPF ou Op. Comp. com TPF	<u>4.357.378.371</u>	<u>78,35%</u>	60% - 100%	Até 100%
Renda Fixa (*)	FI/FIC Referenciado DI	<u>103.964.443</u>	<u>1,87%</u>	0% - 30%	Até 80%
Renda Fixa	FI/FR IMA	<u>260.000</u>	<u>0,00%</u>		Até 30%
Renda Fixa	Op. Compromissada com TPF	<u>766.159.684</u>	<u>13,78%</u>		Até 15%
Imóveis	Imóveis ou FII	<u>333.157.149</u>	<u>5,99%</u>	0% - 10%	Sem Limite
Renda Variável (**)	Ações (em enquadramento)	<u>613.887</u>	<u>0,01%</u>	-	-
Total		5.561.533.533	100,00%		

Fonte: RIOPREVIDÊNCIA, B.Brasil, Caixa, B.Itaú,UBS Pactual,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 novembro, 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.

NOVEMBRO DE 2009

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	826.377.026,14	1,42381	1.176,60	8,84%	103,96	0,66	9,20	10,43	0,20	
REGIME PRÓPRIO III RF DI	RF DI	BBDTVM	3.118.592.157,47	1,72177	5.369,57	0,00%	0,01	0,64	8,96	10,17	0,20	
ITAÚ-GOV PP R EF. FI DI	RF DI	ITAÚ	45.228.980,18	44,30864	2.004,03	0,07%	1,37	0,65	9,00	10,21	0,15	
SOBERANO-REF. DI LP	RF DI	ITAÚ	318.461.125,81	18,80588	5.988,94	5,22%	312,86	0,65	9,00	10,22	0,15	
MASTER CASH FI REF DI	RF DI	PACTUAL	362.301.350,34	1,20687	437,25	7,19%	31,45	0,64	8,94	10,14	0,20	
FI RF DI FEDERAL EXTRA	RF DI	BRADERCO	818.476.000,50	4,68608	3.835,44	4,94%	189,51	0,65	9,00	10,21	0,15	
NOVO BRASIL RF CP LP (*)	RF CP	CAIXA	105.873.353,50	1,00950	106,88	0,24%	0,26	0,87	0,95	-	0,20	
Fonte: RIOPREVIDÊNCIA, B.Brasil, Caixa, B.Itaú,BTG Pactual,Bradesco.							TOTAIS	639,41				

(*) Fundo constituído em 27/10/2009

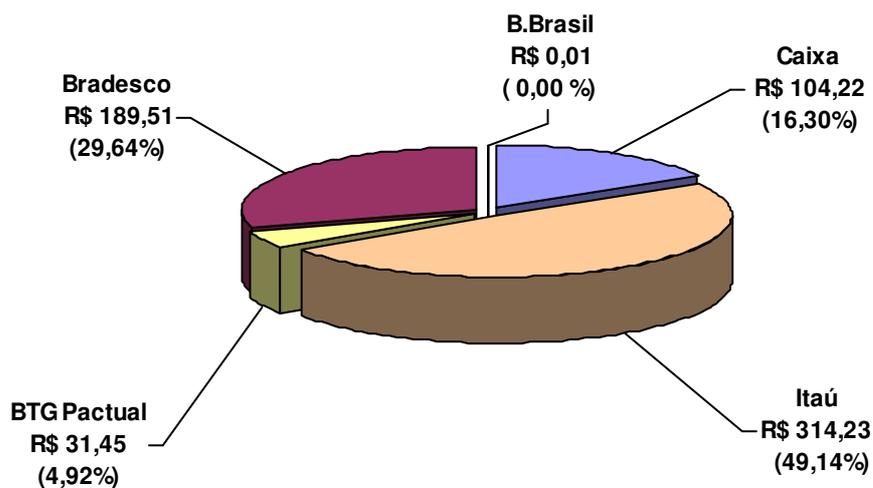
Operações Compromissadas

NOVEMBRO DE 2009

Instituição	CNPJ	Data da Contratação	Vencimento da Operação	% do Indexador	Lastro	Quantidade	P. Unitário (*)	Valor (**) Financeiro (R\$)
CAIXA	00360305000104	14/10/2009	12/2/2010	100,00% do CDI	NTN-B	75.411	1.858,554	42.390.544,87
CAIXA	00360305000104	16/10/2009	18/2/2010	100,00% do CDI	LFT	20.124	4.026,833	81.838.086,95
CAIXA	00360305000104	20/10/2009	18/2/2010	100,00% do CDI	LFT	24	4.029,508	97.601,33
CAIXA	00360305000104	28/10/2009	25/2/2010	100,00% do CDI	NTN-B	52.684	1.861,605	98.787.926,29
CAIXA	00360305000104	5/11/2009	5/3/2010	100,00% do CDI	LFT	8.104	4.037,226	32.900.870,67
CAIXA	00360305000104	11/11/2009	11/3/2010	100,00% do CDI	NTN-B	214.683	1.863,206	401.710.078,73
CAIXA	00360305000104	17/11/2009	17/3/2010	100,00% do CDI	NTN-B	59.639	1.812,817	108.434.574,70
TOTAL								766.159.683,54

Fonte: Caixa

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 30-11-09 IPERJ E RIOPREVIDÊNCIA
IPERJ

AÇÕES	TIPO	QTD	COTAÇÃO 30/11/2009	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	38,10	R\$ 35.852,10
	TLPP4		941	43,15	R\$ 40.604,15
Vivo Participações S/A	VIVO3	100/unit.	521	49,20	R\$ 25.633,20
	VIVO4		521	52,53	R\$ 27.368,13
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	6,36	R\$ 11.378,04
	TCSL4		1.789	4,36	R\$ 7.800,04
Tele Norte Celular Participações S/A	TNCP3	100/unit.	18	74,98	R\$ 1.349,64
	TNCP4		18	29,10	R\$ 523,80
Telecomunicações Brasileiras S/A	TELB3	100.000/ lote mil	929.258	0,79	R\$ 734,11
	TELB4		929.254	0,82	R\$ 761,99
SUB-TOTAL					R\$ 215.018,68

RIOPREVIDÊNCIA

AÇÕES	TIPO	QTD	COTAÇÃO 30/11/2009	VALOR	
Itaú Unibanco Banco Múltiplo S.A.(Itaú Holding Financeira S/A)	ITAU3	100/unit.	9.260	29,92	R\$ 277.059,20
Embratel Participações S/A	EBTP3	100.000/ lote mil	929.258	13,61	R\$ 12.647,20
	EBTP4		929.254	14,98	R\$ 13.920,22
Tele Norte Leste Participações S/A	TLNP3	100/unit.	929	44,00	R\$ 40.876,00
	TLNP4		1.146	36,90	R\$ 42.287,40
Contax Participações S/A	CTAX3	100/unit.	46	96,40	R\$ 4.434,40
	CTAX4		57	89,50	R\$ 5.101,50
Telemar Norte Leste S/A RJ	TMAR3	100/unit.	22	70,00	R\$ 1.540,00
	TMAR6		22	45,55	R\$ 1.002,10
SUB-TOTAL					R\$ 398.868,03

TOTAL
R\$ 613.886,71

Fonte: Banco do Brasil-Banco Real-Banco Itaú