



DIRETORIA DE INVESTIMENTOS

Relatório Mensal de Investimentos

DEZEMBRO

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

DEZEMBRO DE 2009

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA DO RIOPREVIDÊNCIA	
A - Disponível	4.995.479.341
B - Segmento de Renda Fixa	3.979.303.504
1 - Carteiras Próprias	3.735.761.571
2- Operação Compromissada - Lastro: TPF	243.541.933
C - Segmento de Renda Variável	613.067
1 - Ativos em Enquadramento - Ações	613.067
D - Segmento de Imóveis	337.610.991
1 - Carteiras Próprias	337.610.991
E - Fundos de Investimento	677.951.778
1 - Fundos de Curto Prazo	0
2 - Fundos Referenciados DI	676.342.807
3 - Fundos de Renda Fixa RF IMA	1.608.971
4 - Fundos Multimercado	0
5 - Fundos de Ações	0

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

DEZEMBRO DE 2009

Posição consolidada da carteira do RIOPREVIDÊNCIA por tipo de risco	(R\$)	(% do total)
1- Títulos Públicos Federais	4.622.572.489	92,54%
1.1 - Prefixados (LTN, NTN-F)	0	0,00%
1.2 - Pós-fixados (LFT - Selic, LTN com DI-1 Selic, Op.Comp.)	885.654.269	17,73%
1.3 - IPCA (NTN-B)	1.156.650	0,02%
1.4 - IGP-DI (CFT - Carteira Própria)	3.735.761.571	74,78%
2- Títulos Privados	31.030.299	0,62%
2.1 - Emissores de baixo risco de crédito (*)	31.030.299	0,62%
4- Tesouraria (**)	3.652.494	0,07%
5- Imóveis	337.610.991	6,76%
6- Ativos em enquadramento - Ações (***)	613.067	0,01%
Total da Carteira	4.995.479.341	100,00%

Fonte: RIOPREVIDÊNCIA, B.Brasil, Caixa, B.Itaú, UBS Pactual, 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 e Soberano DI FI

(***) Ativos em enquadramento recebidos do IPERJ

DEZEMBRO DE 2009

Segmento	Tipo de Ativo	Valores (R\$)	(%)	Limites PAI (% total)	Limite da Res. n° 3.790/09
Renda Fixa	TPF,FI/FIC 100% TPF ou Op. Comp. com TPF	<u>4.307.392.225</u>	<u>86,23%</u>	60% - 100%	Até 100%
Renda Fixa (*)	FI/FIC Referenciado DI	<u>104.712.153</u>	<u>2,10%</u>	0% - 30%	Até 80%
Renda Fixa	FI/FR IMA	<u>1.608.971</u>	<u>0,03%</u>		Até 30%
Renda Fixa	Op. Compromissada com TPF	<u>243.541.933</u>	<u>4,88%</u>		Até 15%
Imóveis	Imóveis ou FII	<u>337.610.991</u>	<u>6,76%</u>	0% - 10%	Sem Limite
Renda Variável (**)	Ações (em enquadramento)	<u>613.067</u>	<u>0,01%</u>	-	-
Total		4.995.479.341	100,00%		

Fonte: RIOPREVIDÊNCIA, B.Brasil, Caixa, B.Itaú,UBS Pactual,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 dos Fundos Caixa FI Brasil RF DI LP e Caixa Novo Brasil RF que permite a alocação em títulos privados de baixo risco de crédito

(**) Ativos em enquadramento recebidos do IPERJ

Em dezembro, 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.

DEZEMBRO DE 2009

Fundos de Investimento			Participação do RIOPREVIDÊNCIA nos Fundos de Investimento					Rent. Acum. (%)			Tx. Adm.	
Nome do Fundo	Tipo de Fundo	Gestor	Quantidade	Valor	PL dos	Part. %	Valor	Mês	Ano	12 Meses	(% a.a.)	
			Total de Cotas	Unitário das Cotas	Fundos R\$ MM	no PL dos Fundos	dos Fundos R\$ MM					
FI BRASIL REF DI LP	RF DI	CAIXA	789.425.903,12	1,43405	1.132,08	9,25%	104,71	0,72	9,98	9,98	0,20	
REGIME PRÓPRIO III RF DI	RF DI	BBOTVM	3.076.314.408,00	1,73398	5.334,26	0,00%	0,01	0,71	9,73	9,73	0,20	
ITAÚ-GOV PP R EF. FI DI	RF DI	ITAÚ	23.113.578,73	44,62413	1.031,42	0,13%	1,38	0,71	9,78	9,78	0,15	
SOBERANO-REF. DI LP	RF DI	ITAÚ	292.054.016,17	18,94003	5.531,51	6,29%	347,72	0,71	9,78	9,78	0,15	
MASTER CASH FI REF DI	RF DI	PACTUAL	329.017.591,25	1,21539	399,89	7,92%	31,67	0,71	9,71	9,71	0,20	
FI RF DI FEDERAL EXTRA	RF DI	BRANDESCO	772.611.988,72	4,71950	3.646,34	5,23%	190,86	0,71	9,78	9,78	0,15	
NOVO BRASIL RF CP LP (*)	RF CP	CAIXA	387.100.164,60	1,02266	395,87	0,41%	1,61	1,30	2,27	-	0,20	
Fonte: RIOPREVIDÊNCIA, B.Brasil, Caixa, B.Itaú,BTG Pactual,Bradesco.							TOTAIS	677,95				

(*) Fundo constituído em 27/10/2009

Operações Compromissadas

DEZEMBRO DE 2009

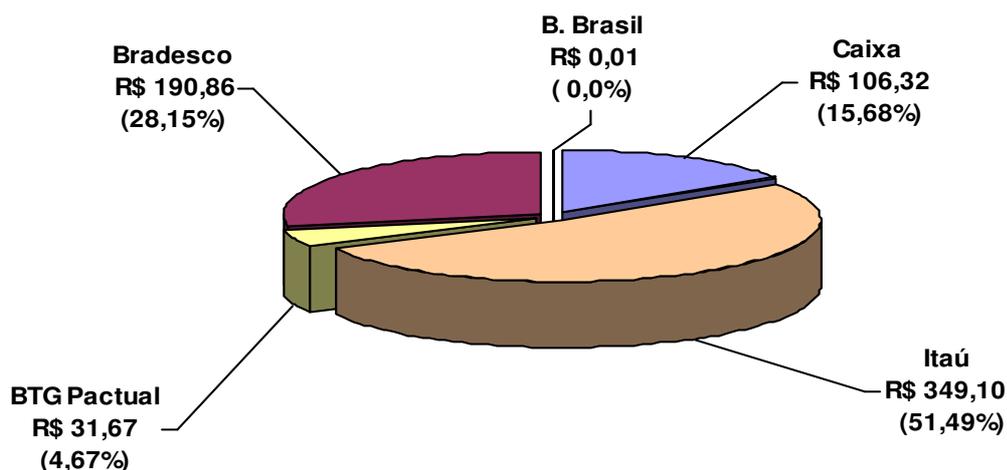
Instituição	CNPJ	Data da Contratação	Vencimento da Operação	% do Indexador	Lastro	Quantidade	P. Unitário (*)	Valor (**) Financeiro (R\$)
CAIXA	00360305000104	17/11/2009	17/3/2010	100,00% do CDI	NTN-B	59.639	1.812,817	109.219.790,47
CAIXA	00360305000104	11/12/2009	12/4/2010	100,00% do CDI	NTN-B	73.649	1.816,054	134.322.142,71
TOTAL								243.541.933,18

Fonte: Caixa

(*) - Cotação na operação inicial

(**) - Posição em 30-11-2009

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 -12- 09 IPERJ E RIOPREVIDÊNCIA

IPERJ

AÇÕES	TIPO	QTD	COTAÇÃO 30/12/2009	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	37,58	R\$ 35.362,78
	TLPP4		941	43,12	R\$ 40.575,92
Vivo Participações S/A	VIVO3	100/unit.	521	53,74	R\$ 27.998,54
	VIVO4		521	54,22	R\$ 28.248,62
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	7,15	R\$ 12.791,35
	TCSL4		1.789	5,12	R\$ 9.159,68
Tele Norte Celular Participações S/A	TNCP3	100/unit.	18	60,00	R\$ 1.080,00
	TNCP4		18	27,91	R\$ 502,38
Telecomunicações Brasileiras S/A	TELB3	100.000/ lote mil	929.258	0,79	R\$ 734,11
	TELB4		929.254	0,75	R\$ 696,94
SUB-TOTAL					R\$ 220.163,80

RIOPREVIDÊNCIA

AÇÕES	TIPO	QTD	COTAÇÃO 30/12/2009	VALOR	
Itaú Unibanco Banco Múltiplo S.A.(Itaú Holding Financeira S/A)	ITAU3	100/unit.	9.260	28,91	R\$ 267.706,60
Embratel Participações S/A	EBTP3	100.000/ lote mil	929.258	15,00	R\$ 13.938,87
	EBTP4		929.254	15,05	R\$ 13.985,27
Tele Norte Leste Participações S/A	TLNP3	100/unit.	929	44,70	R\$ 41.526,30
	TLNP4		1.146	37,10	R\$ 42.516,60
Contax Participações S/A	CTAX3	100/unit.	46	107,48	R\$ 4.944,08
	CTAX4		57	100,00	R\$ 5.700,00
Telemar Norte Leste S/A RJ	TMAR3	100/unit.	22	71,99	R\$ 1.583,78
	TMAR6		22	45,55	R\$ 1.002,10
SUB-TOTAL					R\$ 392.903,60

TOTAL

R\$ 613.067,41

Fonte: Banco do Brasil-Banco Real-Banco Itaú