

Relatório Mensal

2010

Agosto

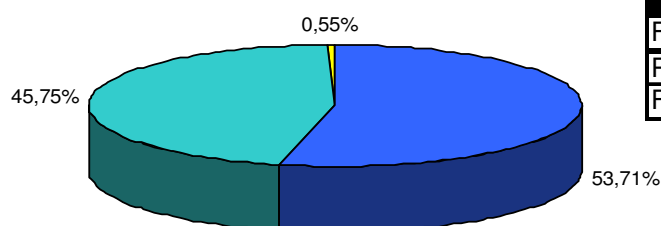
Instituto de Previdência e Assistência do Município do Rio
de Janeiro - PREVI-RIO

DIRETORIA DE
INVESTIMENTOS

Composição da Carteira

Ativos Mobiliários e Imobiliários

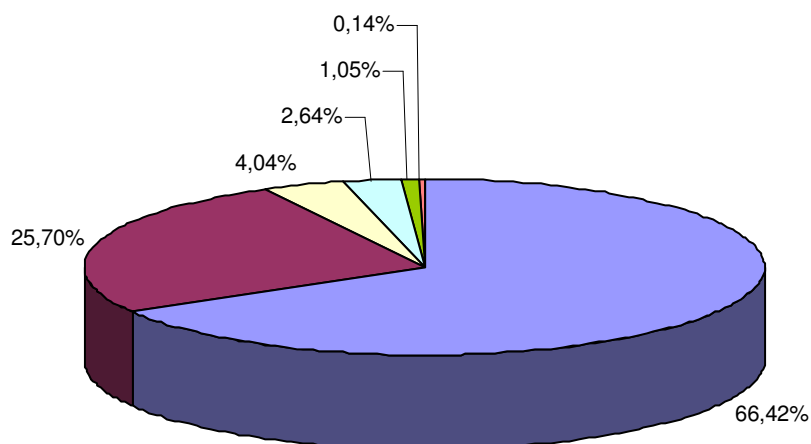
TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)



Valor da carteira	
FUNPREVI	R\$ 1.632.488.983,01
PREVI-RIO	R\$ 1.390.528.313,26
FASS	R\$ 16.675.624,93



FUNPREVI

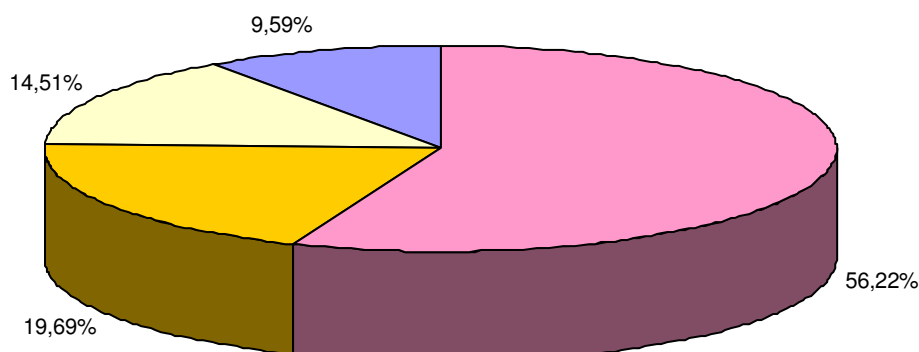


Valor da carteira	
LFT	R\$ 1.084.317.988,26
NTN-B	R\$ 419.538.747,44
Operações Compromissadas	R\$ 66.003.961,78
BB RPPS Atuarial Conservador FI RF	R\$ 43.167.171,70
Ações	R\$ 17.098.052,00
Letras Hipotecárias	R\$ 2.363.061,83

Composição da Carteira

Ativos Mobiliários e Imobiliários

PREVI-RIO

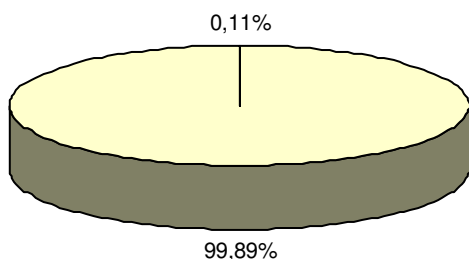


■ Empréstimos e financiamentos aos segurados ■ Imóveis ■ Operações compromissadas ■ LFT

Valor da carteira	
Empréstimos e financiamentos aos segurados	R\$ 781.676.888,66
Imóveis	R\$ 273.727.512,29
Operações compromissadas	R\$ 201.754.110,00
LFT	R\$ 133.337.595,66
Caixa FIC Prático CP - Aplicação Automática	R\$ 29.525,30
Caixa FIC Curto Prazo	R\$ 2.681,35

A modalidade de aplicação Empréstimos e Financiamentos aos segurados é composta pelas seguintes rubricas: Financiamentos Imobiliários (R\$781.577.803,73), Empréstimos e Financiamentos Concedidos (R\$ 74.690,46) e Financiamento Mobiliário (R\$ 24.394,47) constante do Balancete de Verificação do mês de junho/2010.

FASS



Valor da carteira	
Operações compromissadas	R\$ 16.657.785,86
Caixa FI PCRJ RF	R\$ 17.839,07

■ Operações compromissadas ■ Caixa FI PCRJ RF

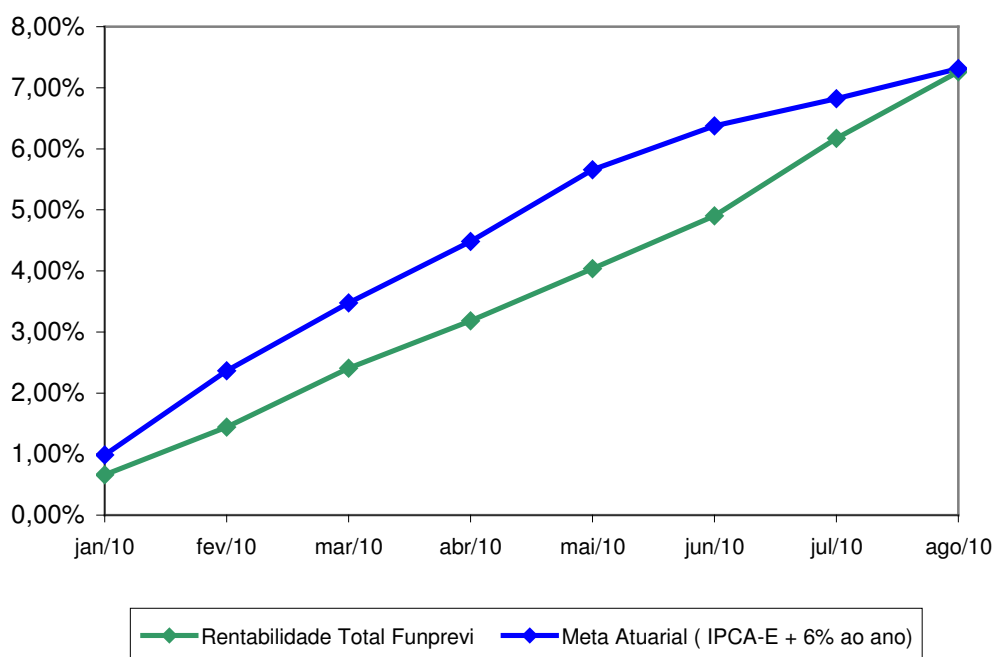
Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade (em relação à Meta Atuarial)	
	ago/10	Acum. Ano	ago/10	Acum. Ano
Títulos Públicos - LFT e NTN-B	1,01%	7,06%	217,87%	96,57%
Letras Hipotecárias	0,90%	10,53%	193,93%	143,95%
Operações compromissadas - 99,90% Selic - CEF	0,89%	6,13%	192,15%	83,75%
Operações compromissadas - 99,90% Selic - BB	0,89%	6,13%	192,15%	83,75%
BB RPPS Atuarial Conservador FI Renda Fixa	1,89%	8,15% *	408,94%	118,97%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Funprevi	1,02%	7,26%	221,89%	99,24%

* Rentabilidade Acumulada do Fundo de Investimento BB RPPS Atuarial Conservador FI Renda Fixa a partir de 15/01/2010.

Rentabilidade Acumulada - Funprevi x Meta Atuarial



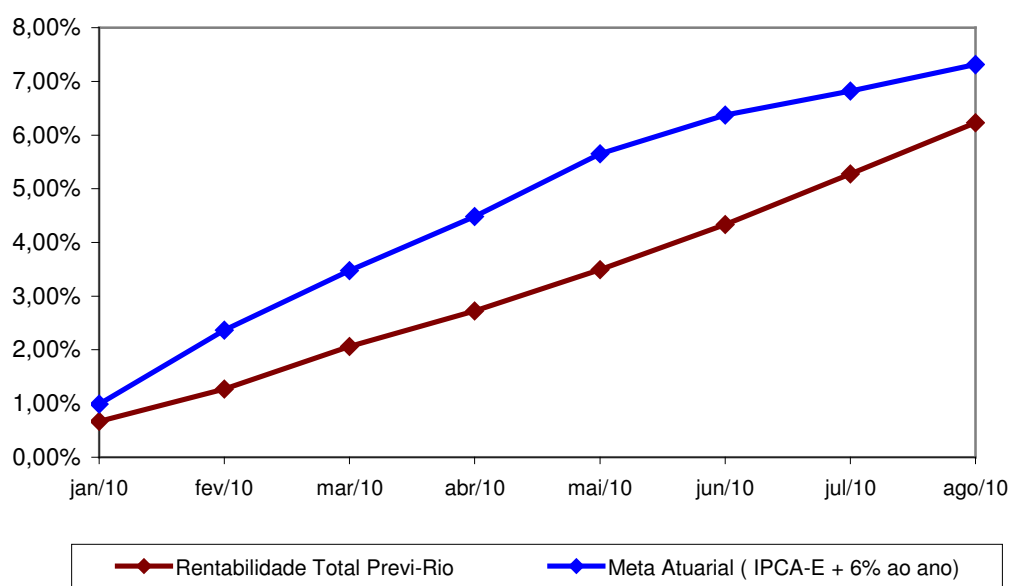
Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade (em relação à Meta Atuarial)	
	ago/10	Acum. Ano	ago/10	Acum. Ano
Títulos Públicos - LFT e NTN-B	0,93%	6,34%	201,48%	86,72%
Operações compromissadas - 99,90% Selic - CEF	0,89%	6,13%	192,15%	83,75%
Operações compromissadas - 99,75% Selic - CEF	0,89%	1,01% *	191,87%	195,36%
Operações compromissadas - 99,90% Selic - BB	0,89%	6,13%	192,15%	83,75%
Caixa FIC Curto Prazo	0,61%	3,95%	132,61%	53,95%
Caixa FIC Prático CP - Aplicação Automática	0,45%	2,66%	96,96%	36,32%
Rentabilidade Total Previ-Rio	0,90%	6,23%	195,86%	85,17%

* Rentabilidade Acumulada de Operações compromissadas rendendo 99,75% da Selic – CEF a partir de 28/07/2010.

Rentabilidade Acumulada - Previ-Rio x Meta Atuarial



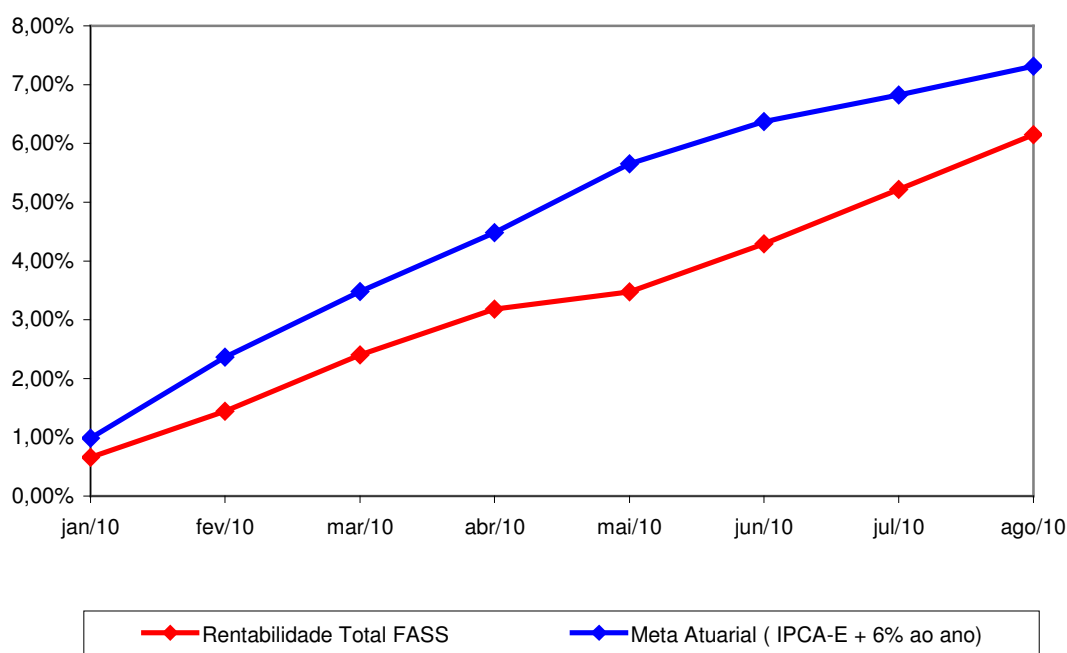
Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade (em relação à Meta Atuarial)	
	ago/10	Acum. Ano	ago/10	Acum. Ano
Operações compromissadas - 99,85% Selic - CEF	0,89%	6,12%	192,06%	83,71%
Operações compromissadas - 99,80% Selic - CEF	0,89%	4,56% *	191,96%	101,40%
Operações compromissadas - 99,90% Selic - CEF	0,89%	4,40% *	192,15%	97,68%
Caixa FI PCRJ RF	0,87%	5,98%	188,24%	81,72%
Rentabilidade Total FASS	0,89%	6,15%	192,08%	84,07%

* Rentabilidade Acumulada de Operações compromissadas rendendo 99,80% e 99,90% da Selic – CEF a partir de, respectivamente, 10/03/2010 e 17/03/2010.

Rentabilidade Acumulada - FASS x Meta Atuarial



Rentabilidade da Carteira de Ativos Imobiliários

PREVI-RIO

ATIVOS IMOBILIÁRIOS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade (em relação à Meta Atuarial)	
	ago/10	Acum. Ano	ago/10	Acum. Ano
Empréstimos e financiamentos aos segurados	0,59%	7,76%	128,53%	106,15%

Com relação aos imóveis, compostos em expressiva parcela por terrenos, observa-se que, em função de sua reduzida liquidez, o acompanhamento da rentabilidade é realizado em maiores espaços de tempo.

O mês de agosto foi caracterizado pelas incertezas quanto à recuperação das principais economias do globo - marcadamente dos EUA - e o conseqüente desapontamento de boa parte dos agentes econômicos, refletindo-se nos preços dos ativos nos mercados financeiros.

No Brasil, a diminuição do ritmo de crescimento também se mostrou evidente, levando o COPOM (Comitê de Política Monetária) a realizar uma pausa no ciclo de elevação da taxa básica de juros, mantendo a Taxa Selic em 10,75% ao ano. As justificativas foram moderação dos índices de preços correntes recentemente observados, implicando a melhora do balanço de riscos para o cenário prospectivo de inflação, e o já salientado cenário externo.

O mercado de juros futuros local reagiu revendo para baixo suas expectativas. Com isso, os papéis de prazo mais longo e os indexados a índices de preços foram os maiores beneficiados.

As NTN-B's (título público pós fixado atrelado ao IPCA) e o Fundo de Investimento BB RPPS Atuarial Conservador Renda Fixa Previdenciário, que possui um percentual considerável daquele título, em conjunto com as Letras Hipotecárias apresentaram as melhores performances, relativamente à Meta Atuarial (IPCA-E + 6% ao ano) no mês.

Registra-se também os bons desempenhos nas rentabilidades das operações compromissadas em relação à Meta Atuarial, pois o IPCA-E apresentou no mês de agosto deflação de 0,05%.