



Relatório de Carteira de Investimentos

Valores Mobiliários e Títulos da Dívida Pública Federal

Novembro de 2022





Governo do Estado do Rio de Janeiro
Secretaria de Estado de Fazenda
Fundo Único de Previdência Social do Estado do Rio de Janeiro

Comitê de Investimentos

Aloisio Villeth Lemos – Diretor de Investimentos

Raphael da Motta e Silva – Secretaria de Fazenda

Robson Luis Barbosa – Secretaria de Planejamento e Gestão

Tatiana Santos - Secretaria de Planejamento e Gestão

Diretoria Executiva

Diretor-Presidente

Sergio Aureliano Machado da Silva

Diretor de Administração e Finanças

Marcelo Passos Pereira

Diretor de Investimentos

Aloisio Villeth Lemos

Diretor de Seguridade

Marcelo Fresteiro Dias Ferreira

Diretora Jurídica

Fabiana Moraes Braga Machado

Gerência de Operações e Investimentos – GEROI

Nícolhas Ribeiro da Costa Cardoso – Gerente

Alisson José Ramos Batista - Coordenador

Transparência Investimentos –

<https://transparencia.rioprevidencia.rj.gov.br/investimentos>



Governo do Estado do Rio de Janeiro
Secretaria de Estado de Fazenda
Fundo Único de Previdência Social do Estado do Rio de Janeiro

Conteúdo

1.	Carteira de Investimentos em Valores Mobiliários e Títulos de Dívida Pública do Rioprevidência	3
1.1.	Fundo Financeiro.....	3
1.2.	Fundo Previdenciário	4
1.3.	Fundos Administrativo e Militar	9
1.3.1.	Fundo Administrativo	9
1.3.2.	Fundo Militar	9
2.	ENQUADRAMENTO.....	10



Govorno do Estado do Rio de Janeiro
Secretaria de Estado de Fazenda
Fundo Único de Previdência Social do Estado do Rio de Janeiro

1. Carteira de Investimentos em Valores Mobiliários e Títulos de Dívida Pública do Rioprevidência

1.1. Fundo Financeiro

Tabela 1. Resultado do Fundo Financeiro no mês de Novembro e comparação ao CDI.

	%End Wgt		Total Return MTD (%)			P&L MTD		Total Return YTD (%)			P&L YTD		End Mkt Val	
	Port	Port	Port	Bench	+/-	Port	Port	Bench	+/-	Port	Port	Port	Port	
RP_FINANC	100,00	1,01	1,02	-0,01	54.781.647	11,15	11,12	0,03	390.156.128	7.028.920.149				
Renda Fixa	100,00	1,01		1,01	54.781.647	11,15		11,15	390.156.128	7.028.920.149				
<u>Renda fixa conforme CVM Art. 7º, III, a</u>	81,02	1,01		1,01	43.695.091	11,19		11,19	286.479.342	5.694.672.374				
BB INSTITUCIONAL FI RF	0,00	1,03		1,03	3.236	11,44		11,44	32.597	317.483				
BB RF REF DI TP FI LP	28,13	1,01		1,01	17.216.158	11,15		11,15	92.583.152	1.977.226.622				
BRAD FI REF DI PRE	13,91	1,06		1,06	7.694.998	5,44		5,44	27.597.923	977.597.970				
BRAD H FI REFERENCIADO DI	0,00	1,00		1,00	31	11,05		11,05	316	3.177				
BTG TESOIRO SELIC FI DI	0,00	1,00		1,00	12	11,04		11,04	117	1.172				
FI CAIXA BRASIL TP RF LP	21,56	0,98		0,98	8.569.734	11,21		11,21	79.852.294	1.515.668.736				
ITAU INS REF DI FI	0,04	1,07		1,07	27.173	11,87		11,87	271.975	2.563.204				
SAFRA SOB PRO FIC FI REF DI	5,41	1,00		1,00	3.759.853	8,75		8,75	30.039.092	380.039.115				
SANT DI INST PREM FIC FUNDO	0,00	1,05		1,05	242	11,60		11,60	2.427	23.339				
SANT DI TP PREM FIC FI	11,97	1,00		1,00	6.421.578	11,09		11,09	56.078.584	841.031.404				
SANT RF REF DI PREM FIC FI	0,00	1,05		1,05	2.075	11,64		11,64	20.866	200.152				
<u>Fundos Renda fixa 100% TP/ETF Art. 7º, I, b</u>	18,98	1,01		1,01	11.086.556	11,07		11,07	103.676.786	1.334.247.775				
BB PREV IRF M1 TP FIC FI						3,73		3,73	7.779.502	0				
ITAU SOBERANO SIMPLES FIC FI	18,98	1,01		1,01	11.086.556	11,12		11,12	95.897.284	1.334.247.775				

Fonte: Bloomberg e elaboração GEROI



Govorno do Estado do Rio de Janeiro
Secretaria de Estado de Fazenda
Fundo Único de Previdência Social do Estado do Rio de Janeiro

1.2. Fundo Previdenciário

Tabela 2. Resultado do Fundo Previdenciário no mês de Novembro e comparação à Meta Atuarial.

	% End Wgt		Total Return MTD (%)				Total Return YTD (%)			P&L YTD		P&L MTD	End Mkt Val
	Port		Port	Bench	+/-	Port	Bench	+/-	Port	Port	Port		
RIOPREVIDENCIA_AUTO	100,00	1,28	0,00	1,28	6,19	9,15	-2,96	159.744.100	36.147.834	2.875.085.892			
Exterior	9,19	10,96		10,96	-23,15		-23,15	-44.910.111	26.097.077	264.118.348			
<u>FIC Aberto - Investimento no Exterior Art. 9º II</u>	9,19	10,96		10,96	-23,15		-23,15	-44.910.111	26.097.077	264.118.348			
ITAU MER EME FIC FIA	4,52	15,21		15,21	-24,13		-24,13	-35.599.239	17.150.972	129.879.419			
SANT GLB EQU DOL MST FIC FIM	4,67	7,14		7,14	-23,92		-23,92	-9.310.872	8.946.104	134.238.929			
Renda Variavel	4,83	-8,09		-8,09	-1,66		-1,66	-2.348.959	-12.222.119	138.940.377			
<u>Fundo de Ações CVM Art. 8º I</u>	4,83	-8,09		-8,09	-1,66		-1,66	-2.348.959	-12.222.119	138.940.377			
BTG ABS INS FIC FIA	4,83	-8,09		-8,09	-1,66		-1,66	-2.348.959	-12.222.119	138.940.377			
Renda Fixa	85,98	0,91		0,91	9,72		9,72	207.003.170	22.272.876	2.472.027.167			
<u>Renda fixa conforme CVM Art. 7º, III, a</u>	25,98	1,04		1,04	11,43		11,43	79.227.268	7.419.317	746.856.887			
BTG TESOIRO SELIC FI DI	0,00	1,00		1,00	11,04		11,04	762	76	7.657			
FI CAIXA BRASIL TP RF LP	9,80	0,98		0,98	11,21		11,21	30.027.661	1.759.215	281.692.912			
FIC FI CAIXA BR RF ATIVA LP					1,77		1,77	1.795.666		0			
ITAU INS REF DI FI	14,14	1,07		1,07	11,87		11,87	37.037.092	5.080.575	406.586.412			
ITAU INST GLB DIN FIC FI	0,00	0,48		0,48	10,54		10,54	3.974.193	0	22			
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RF					1,33		1,33	702.359		0			
SAFRA SOB PRO FIC FI REF DI	2,04	1,00		1,00	9,06		9,06	4.867.188	579.451	58.569.883			
SANTANDER RF ATIVO FIC FI					0,99		0,99	822.348		0			
<u>Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC) Art. 7º, I, a</u>	50,55	1,07		1,07	10,84		10,84	93.059.449	15.637.070	1.453.404.573			
.BAI 6 05/15/55	1,45	1,00		1,00	10,19		10,19	4.047.763	450.700	41.572.902			
.BBI 6 08/15/50	3,64	1,08		1,08	8,61		8,61	8.491.403	1.119.083	104.777.410			
.BBII 6 05/15/35	3,56	1,00		1,00	8,42		8,42	8.369.912	1.108.498	102.426.873			
.BBIII 6 08/15/30	3,61	1,07		1,07	8,57		8,57	8.370.449	1.096.042	103.737.182			
.BBIV 6 05/15/45	3,56	1,01		1,01	8,39		8,39	8.337.968	1.114.553	102.367.983			
.BBV 6 08/15/40	3,61	1,08		1,08	8,46		8,46	8.266.234	1.110.928	103.699.281			
.BCI 6 08/15/30	3,58	1,08		1,08	7,19		7,19	7.060.632	1.097.359	103.033.980			
.BCII 6 05/15/35	3,55	1,00		1,00	7,21		7,21	7.213.187	1.106.833	101.957.144			
.BCIII 6 05/15/45	3,57	1,01		1,01	7,03		7,03	7.079.159	1.115.111	102.503.968			
.BDI 6 08/15/40	3,67	1,07		1,07	5,42		5,42	5.520.416	1.116.054	105.412.669			
.BDII 6 08/15/50	3,66	1,08		1,08	5,57		5,57	5.661.167	1.121.519	105.275.491			
.BDIII 6 05/15/55	2,15	1,01		1,01	5,19		5,19	3.193.009	671.611	61.690.272			
.BEI 6 08/15/50	3,59	1,09		1,09	4,25		4,25	4.271.400	1.112.076	103.158.028			
.BEII 6 08/15/50	3,58	1,09		1,09	4,18		4,18	4.196.722	1.109.913	102.955.195			
.BGI 6 08/15/60	3,48	1,11		1,11	2,15		2,15	2.113.328	1.094.907	100.172.331			
.BKI 6 05/15/55	0,30	0,99		0,99	10,52		10,52	866.699	91.883	8.663.863			
<u>Fundos Renda fixa 100% TP/ETF Art. 7º, I, b</u>	9,45	-0,29		-0,29	8,72		8,72	34.716.452	-783.511	271.765.707			
BB PREV 20 734 931 0001 20	0,26	-0,51		-0,51	8,80		8,80	1.272.904	-38.408	7.437.073			
BB PREV ALO ATIVA RET FIC FI					0,65		0,65	740.360		0			
BB PREV RF TP IPCA FI	1,71	0,74		0,74	10,35		10,35	4.844.572	365.944	49.185.809			
BB PREV RF TP IPCA I FI					8,85		8,85	5.931.369		0			
BB PREV RF TP IPCA VI FI	0,09	-0,51		-0,51	9,07		9,07	632.640	-13.661	2.651.596			
BB PREV RF TP XI FI					8,80		8,80	2.608.842		0			
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TP	6,16	-0,51		-0,51	7,63		7,63	12.901.637	-913.176	176.977.047			
FI CAIXA BRASIL 2024 VI TP R	1,23	-0,52		-0,52	7,59		7,59	2.568.108	-183.643	35.436.472			
FIC FI CAI BRA GES EST					1,63		1,63	3.211.355		0			
ITAU INS ALO DIN FIC FI	0,00	-1,03		-1,03	5,24		5,24	1	0	11			
SAFRA IMA INST FIC FI RF	0,00	-0,77		-0,77	6,11		6,11	3.944	-534	68.507			
SANTANDER FI IMA B 5 TOP RF	0,00	-0,36		-0,36	8,52		8,52	722	-33	9.193			

Fonte: Bloomberg elaboração GEROI



Governo do Estado do Rio de Janeiro
Secretaria de Estado de Fazenda
Fundo Único de Previdência Social do Estado do Rio de Janeiro

Tabela 3. Retorno dos fundos e contribuição para o retorno total em Novembro.

	Avg %Wgt	Total Return (%)	Contribution to Return (%)
RIOPREVIDENCIA_AUTO	100,00	1,28	1,28
Exterior	8,99	10,96	0,93
<u>FIC Aberto - Investimento no Exterior Art. 9º.II</u>	8,99	10,96	0,93
ITAU MER EME FIC FIA	4,37	15,21	0,61
SANT GLB EQU DOL MST FIC FIM	4,62	7,14	0,32
Renda Variavel	5,08	-8,09	-0,44
<u>Fundo de Ações CVM Art. 8º.I</u>	5,08	-8,09	-0,44
BTG ABS INS FIC FIA	5,08	-8,09	-0,44
Renda Fixa	85,93	0,91	0,79
<u>Renda fixa conforme CVM Art. 7º. III. a</u>	25,13	1,04	0,26
BTG TESOURO SELIC FI DI	0,00	1,00	0,00
FI CAIXA BRASIL TP RF LP	6,37	0,98	0,06
ITAU INS REF DI FI	16,71	1,07	0,18
ITAU INST GLB DIN FIC FI	0,00	0,48	0,00
SAFRA SOB PRO FIC FI REF DI	2,05	1,00	0,02
<u>Titulos Públicos de emissão do TN (SELIC) Art. 7º. I. a</u>	51,20	1,07	0,55
.BAI 6 05/15/55	1,48	1,00	0,02
.BBI 6 08/15/50	3,67	1,08	0,04
.BBII 6 05/15/35	3,64	1,00	0,04
.BBIII 6 08/15/30	3,63	1,07	0,04
.BBIV 6 05/15/45	3,64	1,01	0,04
.BBV 6 08/15/40	3,63	1,08	0,04
.BCI 6 08/15/30	3,61	1,08	0,04
.BCII 6 05/15/35	3,63	1,00	0,04
.BCIII 6 05/15/45	3,65	1,01	0,04
.BDI 6 08/15/40	3,69	1,07	0,04
.BDII 6 08/15/50	3,69	1,08	0,04
.BDIII 6 05/15/55	2,19	1,01	0,02
.BEI 6 08/15/50	3,61	1,09	0,04
.BEII 6 08/15/50	3,61	1,09	0,04
.BGI 6 08/15/60	3,51	1,11	0,04
.BKI 6 05/15/55	0,31	0,99	0,00
<u>Fundos Renda fixa 100% TP/ETF Art. 7º. I. b</u>	9,60	-0,29	-0,03
BB PREV 20 734 931 0001 20	0,26	-0,51	0,00
BB PREV RF TP IPCA FI	1,75	0,74	0,01
BB PREV RF TP IPCA VI FI	0,09	-0,51	0,00
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TP	6,24	-0,51	-0,03
FI CAIXA BRASIL 2024 VI TP R	1,25	-0,52	-0,01
ITAU INS ALO DIN FIC FI	0,00	-1,03	0,00
SAFRA IMA INST FIC FI RF	0,00	-0,77	0,00
SANTANDER FI IMA B 5 TOP RF	0,00	-0,36	0,00

Fonte: Bloomberg elaboração GEROI



Govorno do Estado do Rio de Janeiro
Secretaria de Estado de Fazenda
Fundo Único de Previdência Social do Estado do Rio de Janeiro

Tabela 4. Índices de Riscos da Carteira do Previdenciário.

	Std Dev	Var	Dnside Risk	Max Draw
	Port	Port	Port	Port
RIOPREVIDENCIA_AUTO	2,20	-0,20	1,56	-0,96
Exterior	21,16	-2,04	13,86	-33,32
<u>FIC Aberto - Investimento no Exterior Art. 9º,II</u>	21,16	-2,04	13,86	-33,32
ITAU MER EME FIC FIA	22,33	-2,24	14,74	-35,52
SANT GLB EQU DOL MST FIC FIM	22,50	-2,25	14,89	-34,63
Renda Variavel	23,82	-2,31	16,74	-22,50
<u>Fundo de Ações CVM Art. 8º, I</u>	23,82	-2,31	16,74	-22,50
BTG ABS INS FIC FIA	23,82	-2,31	16,74	-22,50
Renda Fixa	1,05	-0,02	0,75	-0,58
<u>Renda fixa conforme CVM Art. 7º, III, a</u>	0,20	0,02	0,18	0,00
BTG TESOURO SELIC FI DI	0,16	0,03	0,15	0,00
FI CAIXA BRASIL TP RF LP	0,18	0,03	0,16	0,00
FIC FI CAIXA BR RF ATIVA LP	0,26		0,18	0,00
ITAU INS REF DI FI	0,20	0,03	0,17	0,00
ITAU INST GLB DIN FIC FI	0,82	-0,03	0,58	-0,29
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RF	0,77		0,52	-0,12
SAFRA SOB PRO FIC FI REF DI	0,16	0,03	0,15	0,00
SANTANDER RF ATIVO FIC FI	1,02		0,68	-0,27
<u>Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC) Art. 7º, I, a</u>	1,64	-0,01	1,15	-0,97
.BAI 6 05/15/55	4,20	-0,01	2,97	-2,71
.BBI 6 08/15/50	0,75	-0,01	0,44	-0,22
.BBII 6 05/15/35	4,56	-0,01	3,23	-2,75
.BBIII 6 08/15/30	0,76	-0,01	0,44	-0,23
.BBIV 6 05/15/45	4,58	-0,01	3,24	-2,75
.BBV 6 08/15/40	0,75	-0,01	0,44	-0,21
.BCI 6 08/15/30	0,75	-0,01	0,42	-0,22
.BCII 6 05/15/35	4,79	-0,01	3,39	-2,76
.BCIII 6 05/15/45	4,80	-0,01	3,40	-2,74
.BDI 6 08/15/40	0,60	-0,01	0,38	-0,23
.BDII 6 08/15/50	0,60	-0,01	0,38	-0,22
.BDIII 6 05/15/55	5,02	-0,01	3,55	-2,74
.BEI 6 08/15/50	0,55	-0,01	0,35	-0,21
.BEII 6 08/15/50	0,55	-0,01	0,35	-0,21
.BGI 6 08/15/60	0,49	-0,01	0,29	-0,19
.BKI 6 05/15/55	3,97	-0,01	2,81	-2,60
<u>Fundos Renda fixa 100% TP/ETF Art. 7º, I, b</u>	2,24	-0,19	1,54	-1,01
BB PREV 20 734 931 0001 20	2,29	-0,20	1,66	-1,34
BB PREV ALO ATIVA RET FIC FI	1,42		0,93	-0,43
BB PREV RF TP IPCA FI	1,99	-0,14	1,41	-0,83
BB PREV RF TP IPCA I FI	1,79	-0,06	1,45	-0,91
BB PREV RF TP IPCA VI FI	2,21	-0,22	1,64	-1,34
BB PREV RF TP XI FI	1,79	-0,06	1,45	-0,91
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TP	2,98	-0,24	1,99	-1,83
FI CAIXA BRASIL 2024 VI TP R	2,98	-0,24	1,99	-1,84
FIC FI CAI BRA GES EST	0,78		0,53	-0,11
ITAU INS ALO DIN FIC FI	3,60	-0,29	2,71	-2,96
SAFRA IMA INST FIC FI RF	5,47	-0,46	3,70	-3,12
SANTANDER FI IMA B 5 TOP RF	2,63	-0,22	1,80	-1,33

Fonte: Bloomberg elaboração GEROI



Governo do Estado do Rio de Janeiro
 Secretaria de Estado de Fazenda
 Fundo Único de Previdência Social do Estado do Rio de Janeiro

Tabela 5. Distribuição do Fundo Previdenciário dividido por Segmentação.

	1/31/2022	2/28/2022	3/31/2022	4/29/2022	5/31/2022	6/30/2022	7/29/2022	8/31/2022	9/30/2022	10/31/2022	11/30/2022
RIOPREVIDENCIA_AUTO	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00
Exterior											
<u>FIC Aberto - Investimento no Exterior Art. 9º II</u>	8,03	7,50	6,62	7,13	6,68	9,70	9,78	9,52	8,78	8,48	9,19
ITAU MER EME FIC FIA	5,72	5,34	4,66	5,27	4,95	4,99	4,86	4,82	4,38	4,02	4,52
SANT GLB EQU DOL MST FIC FIM	2,31	2,16	1,96	1,86	1,73	4,71	4,92	4,70	4,40	4,47	4,67
Renda Fixa	85,81	86,54	87,16	87,43	88,02	85,63	85,26	85,32	86,11	86,13	85,98
<u>Fundos Renda fixa 100% TP/ETF Art. 7º, I, b</u>	24,17	21,69	15,37	15,38	15,14	14,97	14,65	9,83	9,79	9,76	9,45
BB PREV 20 734 931 0001 20	0,66	0,64	0,64	0,64	0,64	0,63	0,62	0,27	0,27	0,27	0,26
BB PREV ALO ATIVA RET FIC FI	4,16	2,08									
BB PREV RF TP IPCA FI	1,96	1,96	1,96	1,98	1,89	1,87	1,83	1,80	1,79	1,79	1,71
BB PREV RF TP IPCA I FI	2,87	2,79	2,78	2,79	2,76	2,73	2,69				
BB PREV RF TP IPCA VI FI	0,32	0,32	0,31	0,32	0,31	0,31	0,30	0,10	0,10	0,09	0,09
BB PREV RF TP XI FI	1,27	1,23	1,23	1,24	1,22	1,21	1,19				
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TP	7,22	7,02	7,03	7,01	6,93	6,85	6,68	6,38	6,36	6,34	6,16
FI CAIXA BRASIL 2024 VI TP R	1,45	1,40	1,41	1,40	1,39	1,37	1,34	1,28	1,27	1,27	1,23
FIC FI CAI BRA GES EST	4,26	4,25									
ITAU INS ALO DIN FIC FI				0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
SAFRA IMA INST FIC FI RF	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
SANTANDER FI IMAB 5 TOP RF	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
<u>Renda fixa conforme CVM Art. 7º, III, a</u>	59,62	42,49	37,50	27,04	20,78	18,76	15,85	22,51	23,72	24,59	25,98
BTG TESOIRO SELIC FI DI	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL TP RF LP	28,77	16,59	24,41	13,97	6,53	6,71	2,83	4,67	4,68	6,41	9,80
FIC FI CAIXA BR RF ATIVA LP	4,25	4,23									
ITAU INS REF DI FI	10,64	9,89	10,93	10,93	12,12	9,93	10,92	15,75	16,94	16,11	14,14
ITAU INST GLB DIN FIC FI	9,88	7,78	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RF	2,21	2,20									
SAFRA SOB PRO FIC FI REF DI			2,16	2,14	2,12	2,12	2,09	2,09	2,09	2,07	2,04
SANTANDER RF ATIVO FIC FI	3,88	1,80									
<u>Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC) Art. 7º, I, a</u>	2,01	22,36	34,30	45,00	52,10	51,90	54,76	52,99	52,61	51,77	50,55
.BAI 6 05/15/55	1,66	1,66	1,65	1,65	1,60	1,59	1,57	1,54	1,53	1,51	1,45
.BBI 6 08/15/50		4,08	4,05	4,06	4,03	4,02	3,95	3,78	3,75	3,69	3,64
.BBII 6 05/15/35		4,10	4,07	4,08	3,94	3,93	3,86	3,80	3,78	3,72	3,56
.BBIII 6 08/15/30		4,04	4,01	4,02	4,00	3,98	3,91	3,74	3,72	3,66	3,61
.BBIV 6 05/15/45		4,10	4,07	4,08	3,94	3,93	3,86	3,80	3,77	3,71	3,56
.BBV 6 08/15/40		4,03	4,00	4,01	3,99	3,98	3,91	3,74	3,72	3,66	3,61
.BCI 6 08/15/30			3,98	3,99	3,97	3,95	3,88	3,72	3,69	3,63	3,58
.BCII 6 05/15/35			4,05	4,06	3,93	3,91	3,84	3,79	3,76	3,70	3,55
.BCIII 6 05/15/45			4,07	4,08	3,95	3,93	3,86	3,81	3,78	3,72	3,57
.BDI 6 08/15/40				4,08	4,06	4,04	3,97	3,81	3,78	3,72	3,67
.BDII 6 08/15/50				4,08	4,05	4,04	3,97	3,80	3,77	3,71	3,66
.BDIII 6 05/15/55				2,46	2,37	2,37	2,32	2,29	2,27	2,24	2,15
.BEI 6 08/15/50					3,97	3,96	3,89	3,72	3,70	3,64	3,59
.BEII 6 08/15/50					3,96	3,95	3,88	3,71	3,69	3,63	3,58
.BGI 6 08/15/60							3,77	3,61	3,59	3,53	3,48
.BKI 6 05/15/55	0,35	0,35	0,34	0,34	0,33	0,33	0,33	0,32	0,32	0,31	0,30
Renda Variável	6,16	5,96	6,21	5,45	5,31	4,67	4,96	5,17	5,11	5,39	4,83
<u>Fundo de Ações CVM Art. 8º, I</u>	6,16	5,96	6,21	5,45	5,31	4,67	4,96	5,17	5,11	5,39	4,83
BTG ABS INS FIC FIA	6,16	5,96	6,21	5,45	5,31	4,67	4,96	5,17	5,11	5,39	4,83

Fonte: Bloomberg, elaboração GEROI.



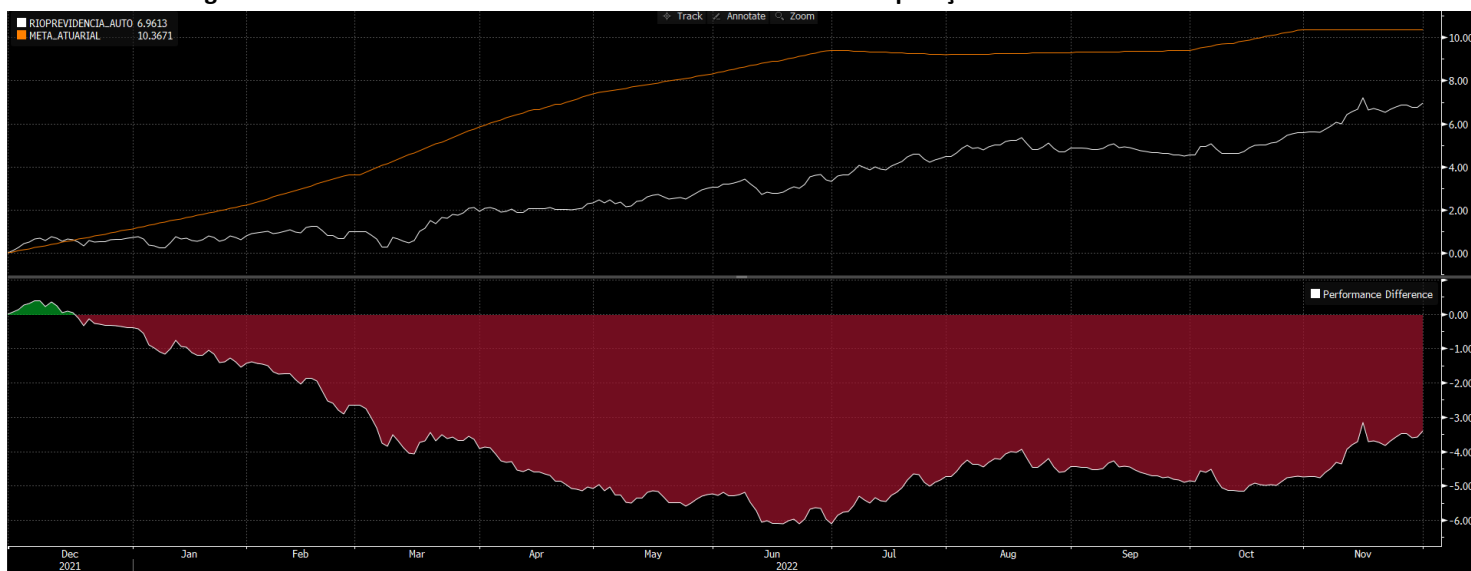
Governo do Estado do Rio de Janeiro
Secretaria de Estado de Fazenda
Fundo Único de Previdência Social do Estado do Rio de Janeiro

Figura 1. Rentabilidade Acumulada no Ano Atual e Comparação com a Meta Atuarial.



Fonte: Bloomberg.

Figura 2. Rentabilidade Acumulada nos Últimos 12 meses e Comparação com a Meta Atuarial.



Fonte: Bloomberg.



Governo do Estado do Rio de Janeiro
Secretaria de Estado de Fazenda
Fundo Único de Previdência Social do Estado do Rio de Janeiro

1.3. Fundos Administrativo e Militar

Além dos citados fundos de natureza previdenciária, o Rioprevidência faz a gestão de dois outros fundos: (i) o Fundo Administrativo, que acumula os recursos advindos do recolhimento da taxa de administração e são utilizados para o custeio da Autarquia ou constituição de reserva; e (ii) o Fundo Militar, denominado gerencialmente assim, que tem como objetivo efetuar os pagamentos relacionados ao Sistema de Proteção Social dos Militares (SPSM).

1.3.1. Fundo Administrativo

Tabela 6. Fundo Administrativo em Novembro e seu comparativo em relação ao CDI.

	%End Wgt		Total Return MTD (%)			P&L MTD		Total Return YTD (%)			P&L YTD		End Mkt Val	
	Port	Port	Port	Bench	+/-	Port	Port	Bench	+/-	Port	Port	Port	Port	
RP_ADM	100,00	1,02	1,02	0,00	1.799.661	11,33	11,12	0,21	14.074.212	191.886.216				
Renda Fixa	100,00	1,02		1,02	1.799.661	11,33		11,33	14.074.212	191.886.216				
<u>Renda fixa conforme CVM Art. 7º, III, a</u>	100,00	1,02		1,02	1.799.661	11,33		11,33	14.074.212	191.886.216				
BB AUT SETOR PUB FIC FI								1,69	7.417	0				
BB PREV DI PERFIL FIC FI	100,00	1,02		1,02	1.799.661	11,34		11,34	14.066.796	191.886.216				

Fonte Bloomberg elaboração própria.

1.3.2. Fundo Militar

Tabela 7. Fundo Militar em Novembro e seu comparativo em relação ao CDI.

	%End Wgt		Total Return MTD (%)			P&L MTD		Total Return YTD (%)			P&L YTD		End Mkt Val	
	Port	Port	Port	Bench	+/-	Port	Port	Bench	+/-	Port	Port	Port	Port	
RP_MIL	100,00	1,02	1,02	0,00	1.657.963	10,71	11,12	-0,42	20.759.504	123.858.032				
Renda Fixa	100,00	1,02		1,02	1.657.963	10,71		10,71	20.759.504	123.858.032				
<u>Renda fixa conforme CVM Art. 7º, III, a</u>	100,00	1,02		1,02	1.657.963	10,71		10,71	20.759.504	123.858.032				
BB AUT SETOR PUB FIC FI								1,69	2.782.231	0				
BB PREV DI PERFIL FIC FI	100,00	1,02		1,02	1.657.963	9,50		9,50	17.977.273	123.858.032				

Fonte: Bloomberg elaboração GEROI



Governo do Estado do Rio de Janeiro
Secretaria de Estado de Fazenda
Fundo Único de Previdência Social do Estado do Rio de Janeiro

2. ENQUADRAMENTO

Tabela 8. Enquadramento Consolidado do Patrimônio do Fundo Financeiro/ Previdenciário/ Administrativo

Dispositivo 4.963/2021	Alocação	% PL Rioprev	Pró-gestão - Nível II	Pró-gestão	Limite - Nível II	Tipos de Ativos	% PL Fundo	Espaço
Art 7 - I - a	R\$1.451.995.028,75	14,39%	100,00%	100,00%	R\$10.088.279.003,79	Título Público de emissão do TN (SELIC)	-	R\$8.636.283.975,04
Art 7 - I - b	R\$2.445.160.584,01	24,24%	100,00%	100,00%	R\$10.088.279.003,79	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF	100,00%	R\$7.643.118.419,78
Art 7 - III - a	R\$5.789.983.393,69	57,39%	70,00%	60,00%	R\$7.061.795.302,65	Renda fixa conforme CVM	15,00%	R\$1.271.811.908,96
Art 8 - I - a	R\$135.759.297,79	1,35%	40,00%	30,00%	R\$4.035.311.601,52	Fundo de Ações CVM	15,00%	R\$3.899.552.303,73
Art 9 - II	R\$265.380.699,55	2,63%	10,00%	10,00%	R\$1.008.827.900,38	FIC Aberto - Investimento no Exterior	15,00%	R\$743.447.200,83
Art 9 - III	R\$0,00	0,00%	10,00%	10,00%	R\$1.008.827.900,38	Fundo de Ações – BDR Nível I	15,00%	R\$1.008.827.900,38
Art 10 - I - a	R\$0,00	0,00%	10,00%	10,00%	R\$1.008.827.900,38	Fundos Multimercados	15,00%	R\$1.008.827.900,38
Art 11	R\$0,00	0,00%	10,00%	5,00%	R\$1.008.827.900,38	FI Imobiliários	15,00%	R\$743.447.200,83
Art 12	R\$0,00	0,00%	10,00%	5,00%	R\$1.008.827.900,38	Empréstimos Consignados	-	R\$743.447.200,83
TOTAL	R\$10.088.279.003,79	100,00%				ENQUADRAMENTO CORRETO		

www.rioprevidencia.rj.gov.br



**GOV
RJ**