



Relatório de Carteira de Investimentos

Valores Mobiliários e Títulos da Dívida Pública Federal

Outubro 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



Governo 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 Outubro e comparação ao CDI

	Total Return MTD (%)			P&L 1M	Total Return YTD (%)			P&L YTD	End Mkt Val
	Port	Bench	+/-	Port	Port	Bench	+/-	Port	Port
RP_FINANC	1,04	1,02	0,01	47.634.678	10,04	10,00	0,04	335.374.481	4.490.884.855
Renda Fixa	1,04		1,04	47.634.678	10,04		10,04	335.374.481	4.490.884.855
<u>Renda fixa conforme CVM Art. 7º, III, a</u>	1,04		1,04	35.767.229	10,07		10,07	242.784.251	3.419.750.457
BB INSTITUCIONAL FI RF	1,04		1,04	3.240	10,31		10,31	29.361	314.247
BB RF REF DI TP FI LP	1,03		1,03	9.151.398	10,04		10,04	75.366.994	850.011.064
BRAD FI REF DI PRE	1,07		1,07	7.648.990	4,34		4,34	19.902.925	719.902.869
BRAD H FI REFERENCIADO DI	1,02		1,02	32	9,95		9,95	285	3.146
BTG TESOURO SELIC FI DI	1,02		1,02	12	9,94		9,94	105	1.160
FI CAIXA BRASIL TP RF LP	1,01		1,01	7.436.276	10,13		10,13	71.282.559	707.099.001
ITAU INS REF DI FI	1,09		1,09	27.286	10,68		10,68	244.802	2.536.031
SAFRA SOB PRO FIC FI REF DI	1,02		1,02	3.807.370	7,68		7,68	26.279.239	376.279.263
SANT DI INST PREM FIC FUNDO	1,05		1,05	240	10,45		10,45	2.185	23.097
SANT DI TP PREM FIC FI	1,03		1,03	7.690.297	9,99		9,99	49.657.006	763.382.501
SANT RF REF DI PREM FIC FI	1,07		1,07	2.089	10,48		10,48	18.790	198.077
<u>Fundos Renda fixa 100% TP/ETF Art. 7º, I, b</u>	1,03		1,03	11.867.449	9,97		9,97	92.590.230	1.071.134.398
BB PREV IRF M1 TP FIC FI					3,73		3,73	7.779.502	0
ITAU SOBERANO SIMPLES FIC FI	1,03		1,03	11.867.449	10,02		10,02	84.810.728	1.071.134.398

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 Outubro e comparação à Meta Atuarial

	% End Wgt			Total Return MTD (%)			Total Return YTD (%)			P&L YTD		End Mkt Val
	Port	Port	Bench	+/-	Port	Bench	+/-	Port	Port	Port		
RIOPREVIDENCIA_AUTO	100,00	1,01	0,88	0,13	4,84	9,15	-4,30	123.596.266	27.941.565	2.805.914.290		
Exterior	8,48	-1,31		-1,31	-30,75		-30,75	-71.007.187	-3.156.624	238.021.271		
<u>FIC Aberto - Investimento no Exterior Art. 9º,II</u>	8,48	-1,31		-1,31	-30,75		-30,75	-71.007.187	-3.156.624	238.021.271		
ITAU MER EME FIC FIA	4,02	-6,25		-6,25	-34,15		-34,15	-52.750.211	-7.516.574	112.728.447		
SANT GLB EQU DOL MST FIC FIM	4,47	3,61		3,61	-28,99		-28,99	-18.256.976	4.359.950	125.292.824		
Renda Variavel	5,39	7,78		7,78	6,99		6,99	9.873.160	10.915.685	151.162.496		
<u>Fundo de Ações CVM Art. 8º, I</u>	5,39	7,78		7,78	6,99		6,99	9.873.160	10.915.685	151.162.496		
BTG ABS INS FIC FIA	5,39	7,78		7,78	6,99		6,99	9.873.160	10.915.685	151.162.496		
Renda Fixa	86,13	0,85		0,85	8,73		8,73	184.730.293	20.182.505	2.416.730.522		
<u>Renda fixa conforme CVM Art. 7º, III, a</u>	24,59	1,07		1,07	10,28		10,28	71.807.951	7.068.141	690.068.563		
BTG TESOIRO SELIC FI DI	0,00	1,02		1,02	9,94		9,94	686	77	7.581		
FI CAIXA BRASIL TP RF LP	6,41	1,01		1,01	10,13		10,13	28.268.445	1.302.935	179.977.692		
FIC FI CAIXA BR RF ATIVA LP					1,77		1,77	1.795.666		0		
ITAU INS REF DI FI	16,11	1,09		1,09	10,68		10,68	31.956.517	5.178.355	452.092.836		
ITAU INST GLB DIN FIC FI	0,00	1,00		1,00	10,02		10,02	3.974.193	0	22		
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RF					1,33		1,33	702.359		0		
SAFRA SOB PRO FIC FI REF DI	2,07	1,02		1,02	7,98		7,98	4.287.736	586.774	57.990.432		
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>	51,77	0,54		0,54	9,67		9,67	77.422.379	7.855.417	1.452.667.969		
.BAI 6 05/15/55	1,51	0,54		0,54	9,10		9,10	3.597.063	227.279	42.295.467		
.BBI 6 08/15/50	3,69	0,54		0,54	7,45		7,45	7.372.320	558.873	103.658.327		
.BBII 6 05/15/35	3,72	0,54		0,54	7,34		7,34	7.261.414	558.559	104.251.538		
.BBIII 6 08/15/30	3,66	0,53		0,53	7,42		7,42	7.274.407	541.493	102.641.140		
.BBIV 6 05/15/45	3,71	0,55		0,55	7,31		7,31	7.223.415	565.705	104.186.592		
.BBV 6 08/15/40	3,66	0,54		0,54	7,30		7,30	7.155.305	555.466	102.588.353		
.BCI 6 08/15/30	3,63	0,54		0,54	6,05		6,05	5.963.273	546.736	101.936.621		
.BCII 6 05/15/35	3,70	0,54		0,54	6,15		6,15	6.106.354	560.278	103.783.474		
.BCIII 6 05/15/45	3,72	0,55		0,55	5,97		5,97	5.964.048	565.639	104.322.020		
.BDI 6 08/15/40	3,72	0,53		0,53	4,30		4,30	4.404.362	552.578	104.296.615		
.BDII 6 08/15/50	3,71	0,54		0,54	4,45		4,45	4.539.647	558.760	104.153.971		
.BDIII 6 05/15/55	2,24	0,55		0,55	4,14		4,14	2.521.399	340.866	62.778.559		
.BEI 6 08/15/50	3,64	0,55		0,55	3,13		3,13	3.159.324	559.285	102.045.951		
.BEII 6 08/15/50	3,63	0,55		0,55	3,06		3,06	3.086.809	559.288	101.845.282		
.BGI 6 08/15/60	3,53	0,57		0,57	1,03		1,03	1.018.422	559.174	99.077.425		
.BKI 6 05/15/55	0,31	0,52		0,52	9,45		9,45	774.816	45.437	8.806.634		
<u>Fundos Renda fixa 100% TP/ETF Art. 7º, I, b</u>	9,76	1,96		1,96	9,03		9,03	35.499.963	5.258.947	273.993.990		
BB PREV 20 734 931 0001 20	0,27	1,89		1,89	9,36		9,36	1.311.311	138.443	7.475.480		
BB PREV ALO ATIVA RET FIC FI					0,65		0,65	740.360		0		
BB PREV RF TP IPCA FI	1,79	2,24		2,24	9,55		9,55	4.478.628	1.102.479	50.264.637		
BB PREV RF TP IPCA I FI					8,85		8,85	5.931.369		0		
BB PREV RF TP IPCA VI FI	0,09	1,88		1,88	9,63		9,63	646.301	49.296	2.665.257		
BB PREV RF TP XI FI					8,80		8,80	2.608.842		0		
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TP	6,34	1,89		1,89	8,19		8,19	13.814.814	3.307.065	177.890.223		
FI CAIXA BRASIL 2024 VI TP R	1,27	1,89		1,89	8,15		8,15	2.751.751	660.628	35.620.115		
FIC FI CAI BRA GES EST					1,63		1,63	3.211.355		0		
ITAU INS ALO DIN FIC FI	0,00	0,88		0,88	6,34		6,34	1	0	11		
SAFRA IMA INST FIC FI RF	0,00	1,27		1,27	6,94		6,94	4.478	866	69.041		
SANTANDER FI IMA B 5 TOP RF	0,00	1,88		1,88	8,91		8,91	755	170	9.227		

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

	Avg % Wgt	Total Return (%)	Contribution to Return (%)
RIOPREVIDENCIA_AUTO	100,00	1,01	1,01
Exterior	8,66	-1,31	-0,11
<u>FIC Aberto - Investimento no Exterior Art. 9º.II</u>	8,66	-1,31	-0,11
ITAU MER EME FIC FIA	4,24	-6,25	-0,27
SANT GLB EQU DOL MST FIC FIM	4,42	3,61	0,16
Renda Variavel	5,24	7,78	0,40
<u>Fundo de Ações CVM Art. 8º. I</u>	5,24	7,78	0,40
BTG ABS INS FIC FIA	5,24	7,78	0,40
Renda Fixa	86,10	0,85	0,73
<u>Renda fixa conforme CVM Art. 7º. III. a</u>	24,02	1,07	0,26
BTG TESOURO SELIC FI DI	0,00	1,02	0,00
FI CAIXA BRASIL TP RF LP	4,67	1,01	0,05
ITAU INS REF DI FI	17,26	1,09	0,19
ITAU INST GLB DIN FIC FI	0,00	1,00	0,00
SAFRA SOB PRO FIC FI REF DI	2,08	1,02	0,02
<u>Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC) Art. 7º. I. a</u>	52,30	0,54	0,28
.BAI 6 05/15/55	1,52	0,54	0,01
.BBI 6 08/15/50	3,73	0,54	0,02
.BBII 6 05/15/35	3,75	0,54	0,02
.BBIII 6 08/15/30	3,70	0,53	0,02
.BBIV 6 05/15/45	3,75	0,55	0,02
.BBV 6 08/15/40	3,69	0,54	0,02
.BCI 6 08/15/30	3,67	0,54	0,02
.BCII 6 05/15/35	3,74	0,54	0,02
.BCIII 6 05/15/45	3,76	0,55	0,02
.BDI 6 08/15/40	3,76	0,53	0,02
.BDII 6 08/15/50	3,75	0,54	0,02
.BDIII 6 05/15/55	2,26	0,55	0,01
.BEI 6 08/15/50	3,67	0,55	0,02
.BEII 6 08/15/50	3,67	0,55	0,02
.BGI 6 08/15/60	3,57	0,57	0,02
.BKI 6 05/15/55	0,32	0,52	0,00
<u>Fundos Renda fixa 100% TP/ETF Art. 7º. I. b</u>	9,78	1,96	0,19
BB PREV 20 734 931 0001 20	0,27	1,89	0,01
BB PREV RF TP IPCA FI	1,79	2,24	0,04
BB PREV RF TP IPCA VI FI	0,10	1,88	0,00
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TP	6,35	1,89	0,12
FI CAIXA BRASIL 2024 VI TP R	1,27	1,89	0,02
ITAU INS ALO DIN FIC FI	0,00	0,88	0,00
SAFRA IMA INST FIC FI RF	0,00	1,27	0,00
SANTANDER FI IMA B 5 TOP RF	0,00	1,88	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	2,15	-0,20	1,55	-0,96
Exterior	19,80	-2,06	13,55	-33,18
<u>FIC Aberto - Investimento no Exterior Art. 9º.II</u>	19,80	-2,06	13,55	-33,18
ITAU MER EME FIC FIA	21,41	-2,25	14,34	-35,52
SANT GLB EQU DOL MST FIC FIM	20,77	-2,27	14,52	-34,63
Renda Variavel	23,39	-2,10	16,02	-22,50
<u>Fundo de Ações CVM Art. 8º. I</u>	23,39	-2,10	16,02	-22,50
BTG ABS INS FIC FIA	23,39	-2,10	16,02	-22,50
Renda Fixa	0,58	-0,02	0,38	-0,05
<u>Renda fixa conforme CVM Art. 7º, III, a</u>	0,19	0,02	0,17	0,00
BTG TESOURO SELIC FI DI	0,16	0,03	0,14	0,00
FI CAIXA BRASIL TP RF LP	0,17	0,03	0,15	0,00
FIC FI CAIXA BR RF ATIVA LP	0,26		0,18	0,00
ITAU INS REF DI FI	0,19	0,03	0,16	0,00
ITAU INST GLB DIN FIC FI	0,76	-0,03	0,51	-0,12
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RF	0,77		0,52	-0,12
SAFRA SOB PRO FIC FI REF DI	0,15	0,03	0,14	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>	0,74	-0,01	0,44	-0,21
.BAI 6 05/15/55	0,75	-0,01	0,44	-0,22
.BBI 6 08/15/50	0,77	-0,01	0,45	-0,22
.BBII 6 05/15/35	0,77	-0,01	0,45	-0,22
.BBIII 6 08/15/30	0,78	-0,01	0,45	-0,23
.BBIV 6 05/15/45	0,77	-0,01	0,44	-0,21
.BBV 6 08/15/40	0,77	-0,01	0,45	-0,21
.BCI 6 08/15/30	0,77	-0,01	0,43	-0,22
.BCII 6 05/15/35	0,76	-0,01	0,43	-0,22
.BCIII 6 05/15/45	0,77	-0,01	0,43	-0,21
.BDI 6 08/15/40	0,60	-0,01	0,37	-0,23
.BDII 6 08/15/50	0,60	-0,01	0,38	-0,22
.BDIII 6 05/15/55	0,56	-0,01	0,36	-0,21
.BEI 6 08/15/50	0,54	-0,01	0,33	-0,21
.BEII 6 08/15/50	0,54	-0,01	0,33	-0,21
.BGI 6 08/15/60	0,41	-0,02	0,25	-0,19
.BKI 6 05/15/55	0,74	-0,01	0,44	-0,24
<u>Fundos Renda fixa 100% TP/ETF Art. 7º, I, b</u>	2,14	-0,15	1,44	-0,98
BB PREV 20 734 931 0001 20	2,12	-0,17	1,51	-1,02
BB PREV ALO ATIVA RET FIC FI	1,42		0,93	-0,43
BB PREV RF TP IPCA FI	2,01	-0,14	1,44	-0,83
BB PREV RF TP IPCA I FI	1,79	-0,07	1,45	-0,91
BB PREV RF TP IPCA VI FI	2,02	-0,17	1,48	-1,02
BB PREV RF TP XI FI	1,79	-0,07	1,45	-0,91
FI CAIXA BRASIL 2024 IV TP	2,92	-0,23	1,91	-1,83
FI CAIXA BRASIL 2024 VI TP R	2,92	-0,23	1,92	-1,84
FIC FI CAI BRA GES EST	0,78		0,53	-0,11
ITAU INS ALO DIN FIC FI	2,27	-0,21	1,52	-0,74
SAFRA IMA INST FIC FI RF	5,08	-0,42	3,37	-3,12
SANTANDER FI IMA B 5 TOP RF	2,45	-0,19	1,64	-1,16

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.

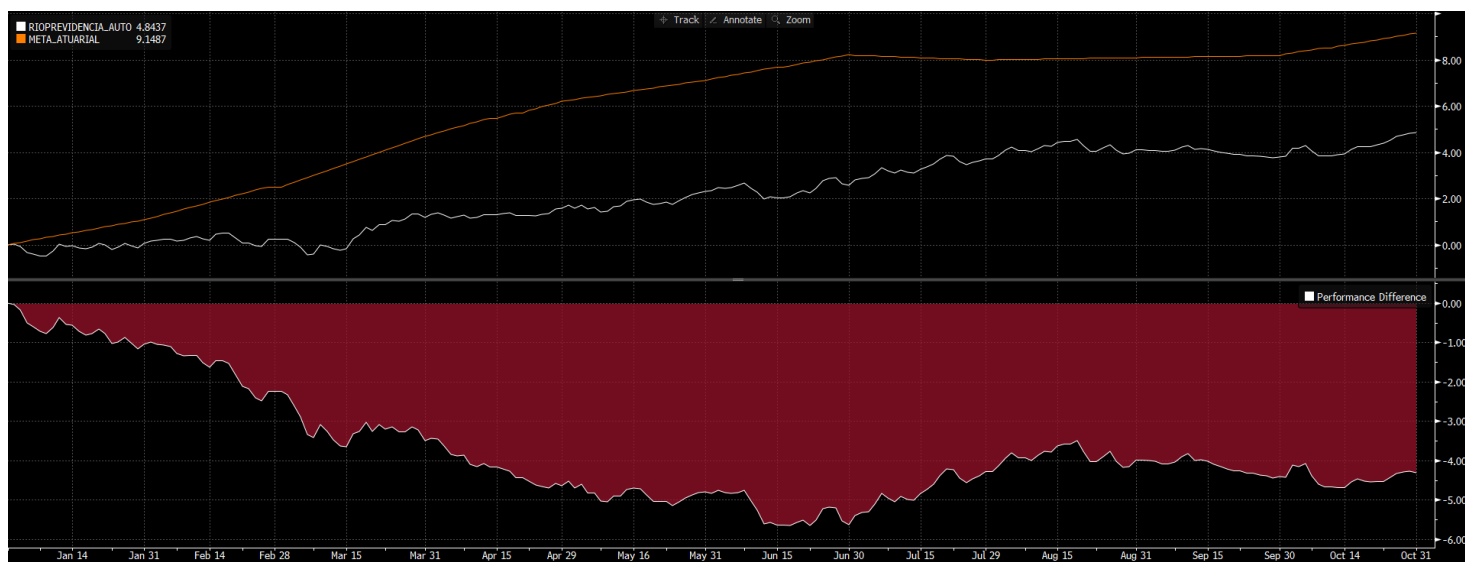
	1/31/2022	2/28/2022	3/31/2022	4/29/2022	5/31/2022	6/30/2022	7/29/2022	8/31/2022	9/30/2022	10/31/2022
RIOPREVIDENCIA_AUTO	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00
Exterior	8,03	7,50	6,62	7,13	6,68	9,70	9,78	9,52	8,78	8,48
<u>FIC Aberto - Investimento no Exterior Art. 9º.II</u>	8,03	7,50	6,62	7,13	6,68	9,70	9,78	9,52	8,78	8,48
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
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
Renda Fixa	85,81	86,54	87,16	87,43	88,02	85,63	85,26	85,32	86,11	86,13
<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
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
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
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
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
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
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
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
SANTANDER FI IMA B 5 TOP RF	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
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
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
FIC FI CAIXA BR RF ATIVALP	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
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
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
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
.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
.BBI 6 08/15/50		4,08	4,05	4,06	4,03	4,02	3,95	3,78	3,75	3,69
.BBII 6 05/15/35		4,10	4,07	4,08	3,94	3,93	3,86	3,80	3,78	3,72
.BBIII 6 08/15/30		4,04	4,01	4,02	4,00	3,98	3,91	3,74	3,72	3,66
.BBIV 6 05/15/45		4,10	4,07	4,08	3,94	3,93	3,86	3,80	3,77	3,71
.BBV 6 08/15/40		4,03	4,00	4,01	3,99	3,98	3,91	3,74	3,72	3,66
.BCI 6 08/15/30			3,98	3,99	3,97	3,95	3,88	3,72	3,69	3,63
.BCII 6 05/15/35			4,05	4,06	3,93	3,91	3,84	3,79	3,76	3,70
.BCIII 6 05/15/45			4,07	4,08	3,95	3,93	3,86	3,81	3,78	3,72
.BDI 6 08/15/40				4,08	4,06	4,04	3,97	3,81	3,78	3,72
.BDII 6 08/15/50				4,08	4,05	4,04	3,97	3,80	3,77	3,71
.BDIII 6 05/15/55				2,46	2,37	2,37	2,32	2,29	2,27	2,24
.BEI 6 08/15/50					3,97	3,96	3,89	3,72	3,70	3,64
.BEII 6 08/15/50					3,96	3,95	3,88	3,71	3,69	3,63
.BGI 6 08/15/60							3,77	3,61	3,59	3,53
.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
Renda Variavel	6,16	5,96	6,21	5,45	5,31	4,67	4,96	5,17	5,11	5,39
<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
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

Fonte: Bloomberg, elaboração GEROI.



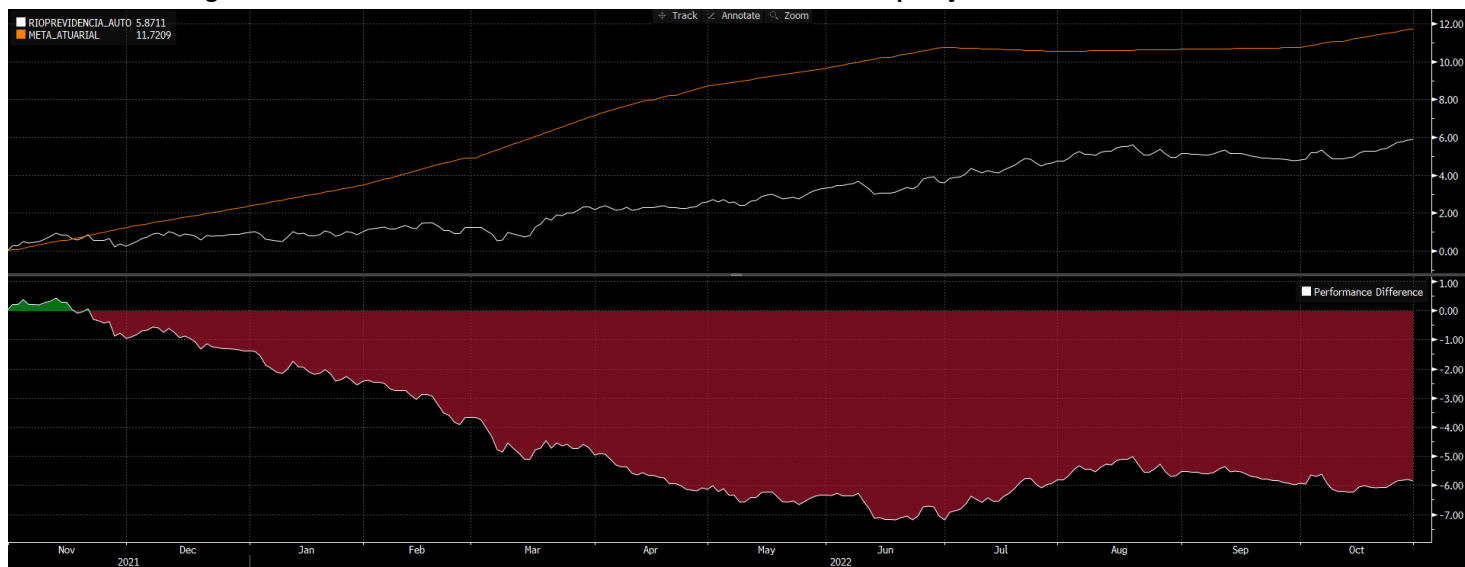
Governo do Estado do Rio de Janeiro
Secretaria de Estado de Fazenda
Fundo Único de Previdência Social do Estado do Rio de Janeiro

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 Outubro e seu comparativo em relação ao CDI.

	Total Return MTD (%)			P&L 1M	Total Return YTD (%)			P&L YTD	End Mkt Val
	Port	Bench	+/-	Port	Port	Bench	+/-	Port	Port
RP_ADM	1,04	1,02	0,02	1.699.554	10,21	10,00	0,21	12.274.552	178.453.185
Renda Fixa	1,04		1,04	1.699.554	10,21		10,21	12.274.552	178.453.185
<u>Renda fixa conforme CVM Art. 7º, III, a</u>	1,04		1,04	1.699.554	10,21		10,21	12.274.552	178.453.185
BB AUT SETOR PUB FIC FI							1,69	7.417	0
BB PREV DI PERFIL FIC FI	1,04		1,04	1.699.554	10,21		10,21	12.267.135	178.453.185

Fonte Bloomberg elaboração própria.

1.3.2. Fundo Militar

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

	Total Return MTD (%)			P&L 1M	Total Return YTD (%)			P&L YTD	End Mkt Val
	Port	Bench	+/-	Port	Port	Bench	+/-	Port	Port
RP_MIL	1,04	1,02	0,02	2.023.953	9,59	10,00	-0,42	19.101.541	223.551.334
Renda Fixa	1,04		1,04	2.023.953	9,59		9,59	19.101.541	223.551.334
<u>Renda fixa conforme CVM Art. 7º, III, a</u>	1,04		1,04	2.023.953	9,59		9,59	19.101.541	223.551.334
BB AUT SETOR PUB FIC FI							1,69	2.782.231	0
BB PREV DI PERFIL FIC FI	1,04		1,04	2.023.953	8,40		8,40	16.319.310	223.551.334

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\$1.452.025.911,64	19,44%	100,00%	100,00%	R\$7.471.115.698,78	Título Público de emissão do TN (SELIC)	-	R\$6.019.089.787,14
Art 7 - I - b	R\$2.107.182.303,83	28,20%	100,00%	100,00%	R\$7.471.115.698,78	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF	100,00%	R\$5.363.933.394,95
Art 7 - III - a	R\$3.523.910.163,02	47,17%	70,00%	60,00%	R\$5.229.780.989,15	Renda fixa conforme CVM	15,00%	R\$1.705.870.826,13
Art 8 - I - a	R\$144.413.726,31	1,93%	40,00%	30,00%	R\$2.988.446.279,51	Fundo de Ações CVM	15,00%	R\$2.844.032.553,20
Art 9 - II	R\$243.583.593,98	3,26%	10,00%	10,00%	R\$747.111.569,88	FIC Aberto - Investimento no Exterior	15,00%	R\$503.527.975,90
Art 9 - III	R\$0,00	0,00%	10,00%	10,00%	R\$747.111.569,88	Fundo de Ações – BDR Nível I	15,00%	R\$747.111.569,88
Art 10 - I - a	R\$0,00	0,00%	10,00%	10,00%	R\$747.111.569,88	Fundos Multimercados	15,00%	R\$747.111.569,88
Art 11	R\$0,00	0,00%	10,00%	5,00%	R\$747.111.569,88	FI Imobiliários	15,00%	R\$503.527.975,90
Art 12	R\$0,00	0,00%	10,00%	5,00%	R\$747.111.569,88	Empréstimos Consignados	-	R\$503.527.975,90
TOTAL	R\$7.471.115.698,78	100,00%	ENQUADRAMENTO CORRETO					

www.rioprevidencia.rj.gov.br



**GOV
RJ**