

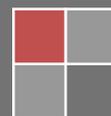
2020



Relatório Mensal de Investimentos

Fundos Administrativo,
Financeiro e Previdenciário

SETEMBRO



Diretoria de Investimentos

Aloisio Villeth Lemos
Diretor de Investimentos

Gerência de Operações e Planejamento

Nícolás Ribeiro da Costa Cardoso
Gerência de Operações e Planejamento

Rodrigo Santos Martins
Assessoria de Investimentos

Alisson José Ramos Batista
Coordenadoria de Operações Financeiras

Equipe:

Flávio Carramanhos Werneck
Flávio de Matos Silva
Gustavo Vergete Marins
Kenia da Silva Braga
Leonardo Monteiro Magalhães
Maynara da Silva Tannis

Fundo Único de Previdência do Estado do Rio de Janeiro – RIOPREVIDÊNCIA

Rua da Quitanda nº 106

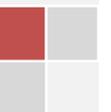
20091-005 – Centro – Rio de Janeiro – RJ

Telefone: (21) 2332-5151

Home page: www.rioprevidencia.rj.gov.br



Fundo Administrativo



ALOCAÇÃO DOS RECURSOS Fundos de Investimentos

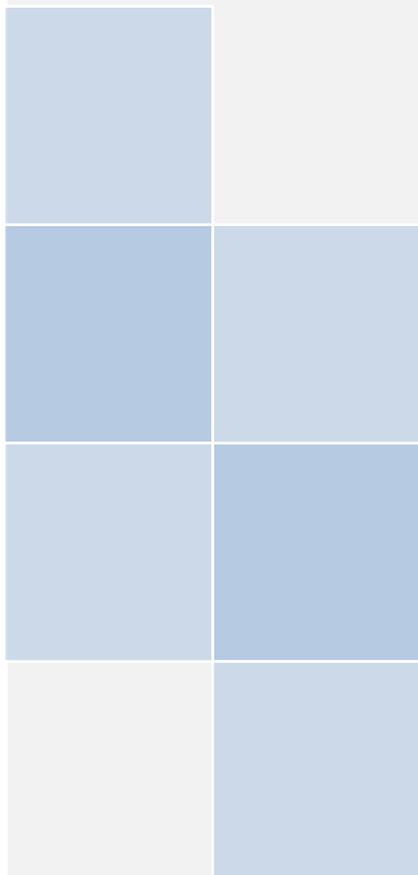
Fundo de Investimento		Fundo Administrativo				
Nome	CNPJ	Saldo em	Mês	Ano	12 meses	Taxa Adm.
		30/09/2020				% a.a.
BB Setor Público	04.288.966/0001-27	32,04	0,01%	0,46%	0,94%	1,75
TOTAL		32,04				
						Valores em R\$ milhões

COMITÊ DE INVESTIMENTO – SETEMBRO/2020

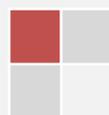
Conforme a Ata da Reunião do Comitê de Investimento do Fundo Único de Previdência Social do Estado do Rio de Janeiro – Rioprevidência, realizado no dia 23 de setembro de 2020, na Sede Administrativa, à Rua da Quitanda nº 106 – Centro - Rio de Janeiro, foi aprovada a seguinte proposta para o período:

Fundo Administrativo:

Com a perspectiva de utilização quase total das reservas financeiras no curto prazo, recomendamos a manutenção da estratégia de aplicações em fundos com elevada liquidez, baixa volatilidade e máxima rentabilidade observando as diretrizes do PAI e da Resolução CMN 3.922/2010 e alterações posteriores.



Fundo Financeiro



ALOCAÇÃO DOS RECURSOS Fundos de Investimentos

Fundo de Investimento		Fundo Financeiro				
Nome	CNPJ	Saldo em	Mês	Ano	12 meses	Taxa Adm.
		30/09/2020				
% a.a.						
BB Referenciado	11.046.645/0001-81	156,55	0,00%	2,03%	3,27%	0,10
Itaú Soberano	06.175.696/0001-73	47,59	0,01%	2,02%	3,25%	0,15
BB Institucional	02.296.928/0001-90	0,27	0,08%	1,83%	2,99%	0,20
Santander Corporate	03.069.104/0001-40	0,17	0,19%	1,71%	2,81%	0,20
Itaú Institucional	00.832.435/0001-00	0,01	0,14%	2,03%	3,19%	0,18
Santander FIC REF DI	02.224.354/0001-45	0,01	0,04%	1,46%	2,58%	0,20
TOTAL		204,61	Valores em R\$ milhões			

COMPOSIÇÃO DAS APLICAÇÕES POR BENCHMARK

Fundos	Participação	R\$ (milhões)
DI	100,00%	R\$204,61
TOTAL	100%	R\$204,61

DISTRIBUIÇÃO DAS CARTEIRAS DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição	Participação	R\$ (milhões)
Bradesco	0,00%	R\$0,00
Caixa	0,00%	R\$0,00
BB	76,64%	R\$156,82
Itaú	23,27%	R\$47,61
BTG	0,00%	R\$0,00
Santander	0,09%	R\$0,18
TOTAL	100%	R\$204,61

COMITÊ DE INVESTIMENTO – SETEMBRO/2020

Conforme a Ata da Reunião do Comitê de Investimento do Fundo Único de Previdência Social do Estado do Rio de Janeiro – Rioprevidência, realizado no dia 23 de setembro de 2020, na Sede Administrativa, à Rua da Quitanda nº 106 – Centro - Rio de Janeiro, foi aprovada a seguinte proposta para o período:

Fundo Financeiro:

Com a perspectiva de utilização quase total das reservas financeiras no curto prazo, recomendamos a manutenção da estratégia de aplicações em fundos com elevada liquidez, baixa volatilidade e máxima rentabilidade observando as diretrizes do PAI e da Resolução CMN 3.922/2010 e alterações posteriores.



Fundo Previdenciário



ALOCAÇÃO DOS RECURSOS Fundos de Investimentos

Fundo de Investimento		Fundo Previdenciário				
Nome	CNPJ	Saldo em	Mês	Ano	12 meses	Taxa Adm.
		30/09/2020				
						% a.a.
Caixa Gestão	23.215.097/0001-55	317,59	-0,50%	4,53%	6,41%	0,20
BTG Absoluto Inst FIA	11.977.794/0001-64	203,94	-2,97%	-4,02%	5,55%	3,00
Caixa Brasil 2024 IV	20.139.595/0001-78	170,97	-0,77%	4,64%	7,67%	0,20
Itaú Ações FOF Genesis FICFI	32.665.845/0001-92	153,12	-4,28%	-10,15%	1,63%	0,80
BB Alloc. Ativa Retorno Total	35.292.588/0001-89	148,83	-1,19%	nd	nd	0,30
Itaú Global Dinâmico	09.093.819/0001-15	133,73	-0,09%	3,31%	nd	0,50
BB Alloc Ativa	25.078.994/0001-90	104,65	-0,75%	1,86%	3,70%	0,30
Santander Renda Fixa Ativo FIC	26.507.132/0001-06	99,78	-0,23%	1,93%	4,33%	0,40
Itaú Alloc Dinâmica	21.838.150/0001-49	70,50	-0,23%	2,47%	3,69%	0,40
CEF Brasil Renda Fixa Ativa TP	35.536.532/0001-22	69,41	0,13%	2,97%	4,34%	0,20
BB Prev TP RF IPCA I	19.303.793/0001-46	65,99	0,20%	5,28%	7,86%	0,15
Santander G Equities MM IE	17.804.792/0001-50	65,92	0,54%	54,82%	61,88%	1,00
Caixa Brasil 2030 III	20.139.534/0001-00	62,33	-1,92%	1,01%	2,77%	0,20
BB Prev TP RF IPCA	15.486.093/0001-83	47,50	-0,30%	5,57%	8,40%	0,15
BB Ações Valor FIC FIA	29.258.294/0001-38	42,83	0,24%	3,22%	4,58%	2,00
Caixa Brasil 2024 VI	22.791.074/0001-26	34,26	-0,77%	4,62%	7,64%	0,20
BB Prev TP RF IPCA XI	24.117.278/0001-01	29,18	0,19%	5,23%	7,79%	0,20
BB Prev TP RF IPCA X	20.734.931/0001-20	15,47	-0,26%	3,97%	6,65%	0,20
BB Prev TP RF IPCA VI	19.523.306/0001-50	7,54	-0,14%	5,03%	7,75%	0,20
Itaú Institucional DI	00.832.435/0001-00	7,09	0,14%	2,03%	3,19%	0,18
Safra Executive 2	10.787.647/0001-69	0,03	-0,03%	2,53%	3,78%	0,50
Santander	Floating Global Equities	64,00				
TOTAL		1914,65				Valores em R\$ milhões

COMPOSIÇÃO DAS APLICAÇÕES POR BENCHMARK

Fundos	Participação	R\$ (milhões)
DI	0,38%	R\$7,09
IMA Geral	51,04%	R\$944,49
IMA B 5+	23,41%	R\$433,23
IRFM1	0,00%	R\$0,03
IE	3,56%	R\$129,92
IBOV	21,61%	R\$399,90
TOTAL	100,00%	R\$1.914,65

DISTRIBUIÇÃO DAS CARTEIRAS DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição	Participação	R\$ (milhões)
Bradesco	0,00%	R\$0,00
Caixa	35,37%	R\$654,55
BB	24,96%	R\$461,99
Itaú	19,69%	R\$364,45
Safra	0,00%	R\$0,03
Santander	8,95%	R\$229,70
BTG	11,02%	R\$203,94
TOTAL	100,00%	R\$1.914,65

ATA DA REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS DO RIOPREVIDÊNCIA REALIZADA NO DIA 23 DE SETEMBRO DE 2020

Ao vigésimo terceiro dia do mês de setembro de dois mil e vinte, às onze horas e trinta minutos, reuniu-se o Comitê de Investimentos do Fundo Único de Previdência Social do Estado do Rio de Janeiro – Rioprevidência – por meio de videoconferência. Presentes os membros votantes, os senhores Aloisio Villeth Lemos (Diretor de Investimentos e Presidente do Comitê) e Raphael da Mota e Silva (Representante da Secretaria de Estado de Fazenda – SEFAZ); bem como os membros designados pelo Diretor de Investimentos, o Sr. Nícolás Ribeiro da Costa Cardoso (Gerente de Operações e Planejamento), o Sr. Alisson José Ramos Batista (Secretaria dos trabalhos), o Sr. Rodrigo Santos Martins, o Sr. Flávio de Matos Silva e o Sr. Flávio Carramanhos Werneck. Instalou-se a reunião aberta pelo Presidente do Comitê de Investimentos com a seguinte pauta: Item Um. Prestação de Contas sobre a proposta vigente aprovada em 24 de agosto de 2020. Item Dois. Apreciação do Fluxo de Caixa referente ao período. Item Três. Apresentação do resultado da Carteira de Investimentos Consolidada. Item Quatro. Debate sobre a conjuntura econômica e sobre as expectativas de mercado. Item Cinco. Análise e aprovação da Proposta Mensal de Investimentos. O senhor Aloisio Villeth Lemos deu as boas-vindas a todos os presentes e, após as considerações iniciais, foram abordados os itens em pauta. No Item Um da pauta, foi explicado que, da proposta aprovada na última reunião, houve movimentação entre alguns produtos das carteiras de Renda Fixa, Renda Variável e Investimento no Exterior. Houve migração para produtos de renda fixa ativa com perfil mais conservador. Assim, a nova ponderação dos índices de referência da carteira foi demonstrada, salientando que as movimentações na renda variável bem como no investimento no exterior ainda não estão refletidas no cômputo, em função do prazo de liquidação dos produtos. Os recursos novos fizeram parte das realocações recentes, o que deixou o caixa no patamar suficiente para as obrigações do ano. Passando para o Item Dois, foi demonstrado o fluxo de entradas e saídas no mês de agosto, bem como as projeções de desembolsos e de saldo esperado no fim do exercício de 2020. No Item Três, apresentou-se o desempenho do mercado no mês de agosto, a distribuição dos recursos da carteira por produto e a performance dos investimentos da autarquia no período. No Item Quatro, avaliou-se a conjuntura econômica com especial atenção para a dinâmica dos índices de preços ao consumidor, buscando constituir expectativa sobre a trajetória da meta atuarial até o fim do exercício. No Item Cinco, a proposta mensal de investimentos foi apresentada e posta em votação. A proposta objetivou ampliar a margem de exposição na renda fixa ativa, da mesma forma que sustentar as posições aprovadas na reunião anterior na renda variável e no investimento no exterior. Após as considerações dos membros votantes do Comitê de Investimentos, os parâmetros da proposta foram aprovados por unanimidade e seguem em anexo (8540616).

Proposta Mensal de Investimentos

FUNDOS ADMINISTRATIVO E FINANCEIRO - Alocação Tática

Motivação: A perspectiva de utilização quase total das reservas financeiras no curto prazo.

Renda Fixa

Manutenção da estratégia de aplicações em fundos com elevada liquidez e baixa volatilidade.

Vedações

Fundos de Investimento de Direitos Creditórios (FIDC);
 Fundos de Investimento de Debêntures;
 CDB ou Poupança;
 Letras Imobiliárias Garantidas (LIG);
 Fundos de Investimento classificados como Renda Variável; e
 Fundos de Investimento classificados como Investimento no Exterior

DI – Sempre disponível como movimento defensivo em realocação ou com recurso novo

8

Proposta Mensal de Investimentos

FUNDO PREVIDENCIÁRIO - Alocação Tática

Motivação: 1) Alta volatilidade em diversos mercados; e
 2) Necessidade de agilidade para defesa e capturar oportunidades

Limitação: Res. 3922/2020 e PAI 2020 (aprovação CONAD em 08/11/2019)

Renda Fixa – Artigo 7º **50% a 100% do PL**

Fundos RF Prefixados (IDKA, IRF-M e subíndices)
 Fundos RF Indexados (IDKA, IMA e subíndices)
 Fundos RF Estratégia Ativa

Proposta de Alocação RF Ativa – Até 70% do PL (Prev)

DI – Sempre disponível como movimento defensivo em realocação ou com recurso novo

57

Proposta Mensal de Investimentos

FUNDO PREVIDENCIÁRIO - Alocação Estratégica

Motivação: 1) Diversificação da Carteira; e
 2) Busca de Rentabilidade Longo Prazo

Renda Variável – Artigo 8º **Até 40% do PL**

Fundo de Renda Variável

Limite da Resolução nº 3922/2010 – 30% do PL (8.II) e 10% do PL (8.III)

Proposta de Alocação – Até 20% do PL (Prev)

Investimento no Exterior – Artigo 9º **Até 10% do PL**

Fundo de Investimentos no Exterior

Limite da Resolução nº 3922/2010 – 10% do PL

Proposta de Alocação – Até 10% do PL (Prev)

DI – Sempre disponível como movimento defensivo em realocação ou com recurso novo

58

Nada mais havendo a tratar, o senhor Aloisio Villeth Lemos (Diretor de Investimentos e Presidente do Comitê), em comum acordo com os demais membros, encerrou a reunião, e eu, Alisson Batista, lavrei a presente ata que será assinada pelos demais membros deste Comitê de Investimentos.