



DIRETORIA DE INVESTIMENTOS

Relatório Mensal de Investimentos

Fundo Financeiro e Previdenciário

Outubro

Rio de Janeiro

2015

Diretoria de Investimentos

Gustavo de Oliveira Barbosa – Diretor Presidente

Gerência de Operações e Planejamento

Fabio Rodrigo Amaral de Assunção
Luciana Pinto Venâncio
Angela Maria Monteiro Pandolfo
Bruno Luís Lacerda dos Santos
Juliana Chaves Monteiro
Kelli Manhães Pessanha
Ubirajara da Silva Coelho

Fundo Único de Previdência do Estado do Rio de Janeiro – RIOPREVIDÊNCIA
Rua da Quitanda nº 106
20.011-030 – Centro – Rio de Janeiro – RJ
Telefone: (21) 2332-5757
Home page: www.rioprevidencia.rj.gov.br

Elaborado por: Juliana Chaves Monteiro



Fundo Financeiro

RELATÓRIO MENSAL DE INVESTIMENTOS

Outubro de 2015 Fundo Financeiro	
CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA DO RIOPREVIDÊNCIA	
	(R\$)
A - Disponível	456.725.563
B - Segmento de Renda Fixa	0
1 - Carteiras Próprias	0
2- Operação Compromissada - Lastro: TPF	0
C - Segmento de Imóveis	389.146.582
1 - Carteiras Próprias	389.146.582
D - Fundos de Investimento	67.578.981
1 - Fundos de Curto Prazo	0
2 - Fundos Referenciados DI	67.578.981
3 - Fundos de Renda Fixa RF IMA	0
4 - Fundos Multimercado	0
5 - Fundos de Ações	0

A composição das aplicações do FUNDO FINANCEIRO no encerramento do mês de Outubro se apresentou conforme as tabelas abaixo, dentro dos limites estabelecidos na Resolução nº 3.922/10 do CMN, alterações da 4.392/14 e do Plano Anual de Investimentos.

Rioprevidência - Fundo Financeiro - Outubro de 2015

Posição Consolidada da Carteira por tipo de risco	(R\$)	(% do total)
1- Títulos Públicos Federais	43.658.051	9,6%
1.1 - Prefixados (LTN, NTN-F)	50.014	0,0%
1.2 - Pós-fixados (LFT - Selic, LTN com DI-1 Selic, Oper. Comp.)	43.608.037	9,5%
2- Títulos Privados de Baixo Risco de Crédito (I)	23.276.544	5,1%
2.1 - CDB	3.096.305	0,7%
2.2 - Let. Financeira	17.032.984	3,7%
2.3 - Debêntures	2.753.205	0,6%
2.4 - DPGE	301.281	0,1%
2.6 - Outros Títulos	92.770	0,0%
3- Cotas de Fundos (II)	644.359	0,1%
4- Tesouraria (III)	27	0,0%
5- Imóveis (IV)	389.146.582	85,2%
Total da Carteira	456.725.563	100,0%

Fonte: RIOPREVIDÊNCIA, Bradesco, HSBC, Caixa, Santander, Itaú e B. Brasil.

(I) Valor em Cotas do Fundo Caixa FI Brasil DI, HSBC DI LP, Itaú Institucional DI, Bradesco Premium DI, BB Institucional, BB Prev. Perfil e Santander Corporate que está alocado em títulos privados de baixo risco de crédito.

(II) Valor em Cotas dos Fundos: HSBC DI LP, Bradesco Premium DI, BB Institucional, BB Previd. Perfil e Santander, investido em outros fundos de investimento.

(III) Recursos mantidos em Tesouraria nos fundos investidos.

(IV) Refere-se ao valor apurado em 31/10/2015.

Rioprevidência - Fundo Financeiro - Outubro de 2015

Posição da Carteira em 30/10/2015, por Limites do PAI e Resolução nº 3.922/10 e alterações

Segmento	Tipo de Ativo	Valores (R\$)	% (V)	Limites PAI (% total)	Limite da Res. nº 3.922/10
Renda Fixa	TPF	0	0,00%	100,0%	Até 100,0%
Renda Fixa (I)	FI/FIC RF ou Referenciado	0	0,00%	80,0%	Até 80,0%
Renda Fixa (II)	FI/FIC RF ou Referenciado	67.578.981	0,11%	4,0%	Até 30,0%
Renda Fixa	FI/FIC RF ou Ref. (Crédito Privado)	0	0,00%	1,5%	Até 5,0%
Renda Fixa	Op. Compromissada com TPF	0	0,00%	2,8%	Até 15,0%
Total Renda Fixa		67.578.981	0,11%		
Total do Ativo do Rioprevidência (III) (Res. 3.922/10)		60.188.902.910			
Imóveis (IV)	Terrenos e Edificações	389.146.582			

Fonte: RIOPREVIDÊNCIA, Bradesco, HSBC, Caixa, Santander, Itaú, B.Brasil, BTG Pactual.

Glossário:

TPF - Título Público Federal

FI/FIC - Fundos de Investimento

PAI - Plano Anual de Investimentos (Limites definidos no PAI)

(I) Subíndices do IMA ou do IDkA, exceto subíndice atrelado a taxa de juros de 1 dia.

(II) Qualquer indicador de desempenho de Renda Fixa. Inclui valor em cotas dos Fundos : Caixa FI Brasil, HSBC DI LP, Itaú Institucional DI, Bradesco Premium DI e BB Institucional RF que permite a alocação em títulos privados de baixo risco de crédito.

(III) Valor total do Ativo do Rioprevidência em 31/10/2015 (F. Financeiro + F. Previdenciário)

(IV) Refere-se ao valor apurado em 31/10/2015.

(V) Refere-se ao valor do ativo total apurado em 31/10/2015. (F. Financeiro + F. Previdenciário)

Em Outubro, as aplicações financeiras do FUNDO FINANCEIRO se concentraram em cotas de Fundos de Investimento Referenciado DI, cujos lastros são predominantemente títulos públicos federais.

A estratégia de alocação de recursos segue os critérios estabelecidos na legislação vigente, no Plano Anual de Investimentos e pelo Comitê de Investimentos.

Outubro de 2015 - Fundo Financeiro

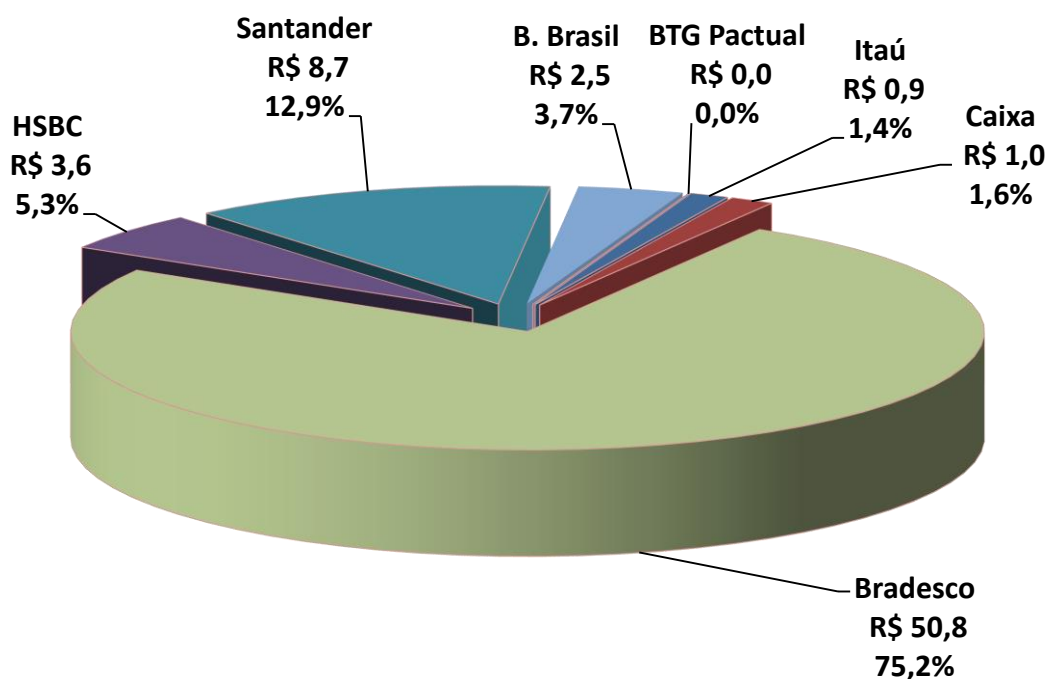
Fundos de Investimento			Participação do RIOPREVIDÊNCIA				Rent. Acum. (% Tx. Adm.)				
Nome do Fundo	Tipo de Fundo	Gestor	Quantidade Total de Cotas	Valor Unitário das Cotas	PL dos Fundos R\$ MM	Part. % no PL dos Fundos	Valor dos Fundos R\$ MM	Mês	Ano	12 M.	(%a.a.)
FI Brasil REF DI LP	REFDI	CAIXA	1.574.508.574,89	2,53788	3.995,91	0,03%	1,05	1,11	10,86	12,87	0,20
Itaú Institucional Ref. DI FI	REFDI	B. Itaú	583.362,47	2.160,62	1.260,43	0,07%	0,93	1,11	10,90	12,91	0,18
Bradesco FI RFDI Premium	REFDI	BRAM-Asset	791.775.792,05	8,29327	6.566,41	0,77%	50,70	1,11	10,88	12,91	0,20
Bradesco FI RFDI Federal Extra	REFDI	BRAM-Asset	518.135.870,99	8,26413	4.281,94	0,00%	0,09	1,10	10,64	12,61	0,15
BTG Pactual Master Cash DI (*)	REFDI	BTGP. Asset	471.617.635,27	2,12117	1.000,38	0,00%	0,00	1,09	10,58	12,58	0,20
Santander FIC FI Corporate	REFDI	Sant.-Asset	620.297.093,12	8,53239	5.292,62	0,16%	8,70	1,10	10,89	12,90	0,20
BB Institucional FI Renda Fixa	R Fixa	BBDTV	222.151.503,00	6,18560	1.374,14	0,04%	0,55	1,10	10,93	13,00	0,20
BB Previdenciário RF Perfil FC	R Fixa	BBDTV	3.717.580.468,07	1,55966	5.798,17	0,01%	0,85	1,12	10,96	13,05	0,20
BB Referenciado DI TP FI LP	REFDI	BBDTV	1.625.667.375,75	1,72467	2.803,74	0,04%	1,13	1,10	10,67	12,70	0,10
HSBC FI Ref. DI LP	REFDI	HSBC	485.139.994,82	20,77025	10.076,48	0,04%	3,58	1,12	10,96	12,99	0,15
TOTAL							67,58				

Fonte: RIOPREVIDÊNCIA, Itaú, Bradesco, Caixa, HSBC, Santander, B.Brasil, BTG Pactual.

(*) - Valor bloqueado, em verificação pelo Rioprevidência.

No encerramento do mês de Outubro, as aplicações financeiras do Fundo Financeiro em fundos de investimento totalizaram R\$ 67.578.981,12 distribuídos da forma abaixo:

Participação por Instituição Financeira em Fundos de Investimento - R\$ Milhões



COMITÊ DE INVESTIMENTO

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 28 de outubro de 2015, na Sede Administrativa, à Rua da Quitanda nº 106 – Centro - Rio de Janeiro, foi aprovada a seguinte proposta para o mês de novembro:

Fundo Financeiro:

As incertezas quanto a data do aumento dos juros nos EUA continuam provocando instabilidade aos mercados. No Brasil, as crises econômica e política persistem, mantendo a volatilidade interna.

Com a manutenção desse cenário e a perspectiva de utilização quase que 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 feitas pela 4.392/2014.



Fundo Previdenciário

RELATÓRIO MENSAL DE INVESTIMENTOS

Outubro de 2015	
Fundo Previdenciário	
CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA DO RIOPREVIDÊNCIA	(R\$)
A - Disponível	234.772.717
B - Segmento de Renda Fixa	0
1 - Carteiras Próprias	0
2- Operação Compromissada - Lastro: TPF	0
C - Segmento de Imóveis	0
1 - Carteiras Próprias	0
D - Fundos de Investimento	234.772.717
1 - Fundos de Curto Prazo	0
2 - Fundos Referenciados DI	25.378.706
3 - Fundos de Renda Fixa RF IMA	205.523.568
4 - Fundos de Renda Fixa - Crédito Privado	3.870.442
5 - Fundos Multimercado	0
6 - Fundos de Ações	0

A composição das aplicações do FUNDO PREVIDENCIÁRIO no encerramento do mês de Outubro se apresentou conforme as tabelas abaixo, dentro dos limites estabelecidos na Resolução nº 3.922/10 do CMN, alterações da Resolução nº 4.392/14 e do Plano Anual de Investimentos.

Rioprevidência - Fundo Previdenciário - Outubro de 2015

Posição consolidada da carteira por tipo de risco	(R\$)	(% do total)
1- Títulos Públicos Federais	222.050.237	94,6%
1.1 - Prefixados (LTN, NTN-F)	0	0,0%
1.2 - Pós-fixados (LFT - Selic, LTN com DI-1 Selic, Op.Comp.)	17.396.674	7,4%
1.3 - NTN-B (IPCA)	204.653.563	87,2%
2- Títulos Privados de Baixo Risco de Crédito (I)	12.638.189	5,4%
2.1 - CDB	2.141.270	0,9%
2.2 - Let. Financeira	9.785.354	4,2%
2.3 - Debêntures	505.755	0,2%
2.4 - DPGE	205.811	0,1%
2.5 - Outros Títulos	0	0,0%
3 - Cotas de Fundos (II)	82.975	0,0%
4- Tesouraria (III)	1.316	0,0%
5- Imóveis	0	0,0%
Total da Carteira	234.772.717	100,0%

Fonte: RIOPREVIDÊNCIA, Bradesco, Banco do Brasil, Caixa.

(I) Valor em Cotas do Fundo Bradesco Premium DI e Bradesco Inst. Cred. Privado que está alocado em títulos privados de baixo risco de crédito.

(II) Valor em Cotas dos Fundos: Bradesco Premium DI e Bradesco Inst. Créd. Privado investido em outros fundos de investimento.

(III) Recursos mantidos em Tesouraria nos fundos investidos.

Rioprevidência - Fundo Previdenciário - Outubro de 2015
Posição da Carteira em 30/10/2015, por Limites do PAI e Resolução nº 3.922/10 e alterações.

Segmento	Tipo de Ativo	Valores (R\$)	% (IV)	Limites PAI (% total)	Limite da Res. nº 3.922/10
Renda Fixa	TPF	<u>0</u>	<u>0,00%</u>	100,0%	Até 100,0%
Renda Fixa (I)	FI/FIC RF ou Referenciado (Art. 7º,I,b)	<u>205.523.568</u>	<u>0,34%</u>	100,0%	Até 100,0%
Renda Fixa (II)	FI/FIC RF ou Referenciado	<u>25.378.706</u>	<u>0,04%</u>	4,0%	Até 30,0%
Renda Fixa	FI/FIC RF ou Ref. (Crédito Privado-Art 7º-VII-b)	<u>3.870.442</u>	<u>0,01%</u>	1,5%	Até 5,0%
Renda Fixa	Op. Compromissada com TPF	<u>0</u>	<u>0,00%</u>	2,8%	Até 15,0%
Total Renda Fixa		<u>234.772.717</u>	<u>0,39%</u>		
Total do Ativo do Rioprevidência (III) (Res. 3.922/10)		60.188.902.910			
Imóveis	Terrenos e Edificações	0			

Fonte: RIOPREVIDÊNCIA, Bradesco, B. do Brasil, Caixa.

Glossário:

TPF - Título Público Federal

FI/FIC - Fundos de Investimento

PAI - Plano Anual de Investimentos (Limites definidos no PAI)

(I) Subíndices do IMA ou do IDkA, exceto subíndice atrelado a taxa de juros de 1 dia.

(II) Qualquer indicador de desempenho de Renda Fixa. Inclui valor em cotas dos Fundos : Bradesco Premium DI e Bradesco Inst. Créd. Privado que permite a alocação em títulos privados de baixo risco de crédito.

(III) Valor total do Ativo total apurado em 31/10/2015. (F Financeiro + F. Previdenciário)

(IV) Refere-se ao ativo total apurado em 31/10/2015. (F Financeiro + F. Previdenciário)

Em outubro, a maior parcela das aplicações financeiras do FUNDO PREVIDENCIÁRIO se concentrou em cotas de Fundos de Renda Fixa – IMA. Outra parte dos recursos está aplicada em cotas de Fundos de Investimento Referenciado DI, e menor parcela em Fundo de Renda Fixa de Crédito Privado.

A estratégia de alocação de recursos segue os critérios estabelecidos na legislação vigente, no Plano Anual de Investimentos e pelo Comitê de Investimentos.

Outubro de 2015 - Fundo Previdenciário

Fundos de Investimento			Participação do RIOPREVIDÊNCIA					Rent. Acum. (%)			Tx. Adm.
Nome do Fundo	Tipo de Fundo	Gestor	Quantidade Total de Cotas	Valor Unitário das Cotas	PL dos Fundos R\$ MM	Part. % no PL dos Fundos	Valor dos Fundos R\$ MM	Mês	Ano	12 M.	(% a.a.)
Bradesco FI RF DI Premium	REF DI	BRAM-Asset	791.775.792,05	8,29327	6.566,41	0,19%	12,36	1,11	10,88	12,91	0,20
Bradesco FI RF DI Federal Extra	REF DI	BRAM-Asset	518.135.870,99	8,26413	4.281,94	0,00%	0,03	1,10	10,64	12,61	0,20
Bradesco I. FI RF Créd. Privado	R. Fixa	BRAM-Asset	239.170.026,99	1,47955	353,86	1,09%	3,87	1,14	11,25	13,38	0,40
FI Brasil IMA B 5 Mais RF LP	R. Fixa	Caixa	313.119.680,43	1,19388	373,83	5,49%	20,54	2,59	2,78	2,46	0,20
FI Brasil REF DI LP	Ref DI	Caixa	1.574.508.574,89	2,53788	3.995,91	0,32%	12,98	1,11	10,86	12,87	0,20
FI Brasil 2030 III TP RF (1)	R. Fixa	Caixa	144.178.158,19	0,98429	141,91	23,98%	34,04	2,90	1,85	-	0,20
FI Brasil 2024 IV TP RF (2)	R. Fixa	Caixa	328.142.212,14	1,00198	328,79	17,48%	57,48	1,36	3,47	-	0,20
FI Brasil 2020 III TP RF (3)	R. Fixa	Caixa	96.810.000,00	1,01362	98,13	15,49%	15,20	2,22	4,37	-	0,20
FI Brasil 2016 II TP RF (4)	R. Fixa	Caixa	757.514.065,52	1,04303	790,11	1,32%	10,43	2,05	7,31	-	0,20
FI Brasil 2018 IV TP RF (5)	R. Fixa	Caixa	236.850.539,88	1,03476	245,08	8,44%	20,70	3,15	6,48	-	0,20
FI Brasil 2020 IV TP RF (6)	R. Fixa	Caixa	360.798.737,01	0,98572	355,65	5,54%	19,71	2,22	1,62	-	0,20
FI Brasil 2024 VI TP RF (7)	R. Fixa	Caixa	141.162.713,72	0,99165	139,98	15,94%	22,31	1,36	-0,84	-	0,20
BB Prev. RF. TP IPCA VI FI	R. Fixa	BB DTVM	212.073.834,22	1,19400	253,22	2,02%	5,11	1,37	6,09	6,91	0,20
TOTAL							234,77				

Fonte: RIOPREVIDÊNCIA, Bradesco, Banco do Brasil, Caixa.

(1) - Fundo constituído em 16/03/2015

(2) - Fundo constituído em 09/03/2015

(3) - Fundo constituído em 01/04/2015

(4) - Fundo constituído em 21/05/2015

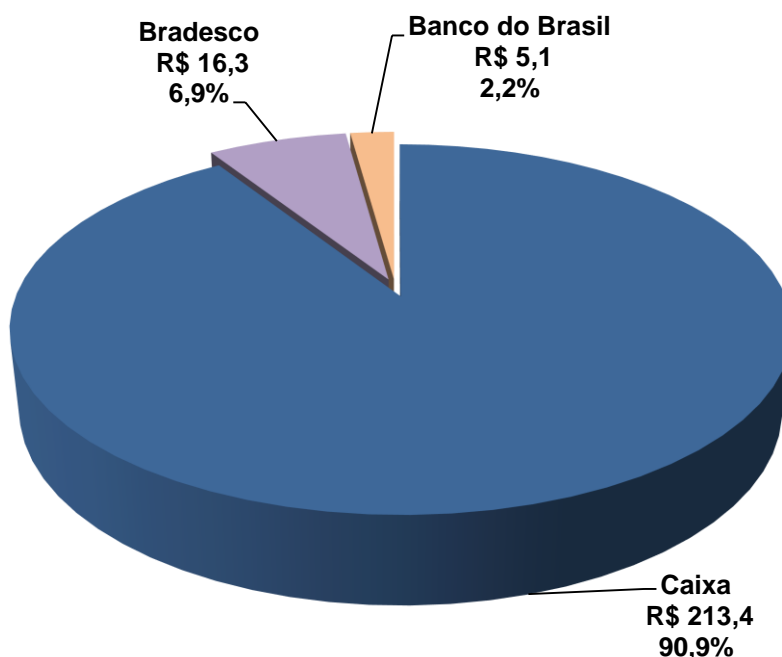
(5) - Fundo constituído em 08/05/2015

(6) - Fundo constituído em 28/07/2015

(7) - Fundo constituído em 19/08/2015

No encerramento do mês de Outubro, as aplicações financeiras do Fundo Previdenciário em fundos de investimento totalizaram R\$ 234.772.716,79 distribuídos da forma abaixo:

Participação por Instituição Financeira em Fundos de Investimento - R\$ Milhões



COMITÊ DE INVESTIMENTO

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 28 de outubro de 2015, na Sede Administrativa, à Rua da Quitanda nº 106 – Centro - Rio de Janeiro, foi aprovada a seguinte proposta para o mês de novembro:

Fundo Previdenciário:

Considerando a forte volatilidade e os investimentos já aprovados por este comitê, propomos a alocação das receitas em fundos DI.

Em caso de fundos atrelados à NTN-B com benchmark igual ou superior a meta atuarial, propomos a aplicação nestes fundos com limite máximo de 95% do saldo dos fundos DI.