

2016



Relatório Mensal de Investimentos

Fundos Financeiro e Previdenciário

Fevereiro



Diretoria de Investimentos

Gustavo de Oliveira Barbosa
Diretor Presidente

Gerência de Operações e Planejamento

Fabio Rodrigo Amaral de Assunção
Gerente de Operações e Planejamento

Luciana Pinto Venâncio
Coordenadora de Operações e Planejamento

Equipe Técnica:

Angela Maria Monteiro Pandolfo
Bruno Luís Lacerda dos Santos
Isadora Medeiros Frias
Kelli Manhães Pessanha
Pedro Daflon Fraiz
Ubirajara da Silva Coelho

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

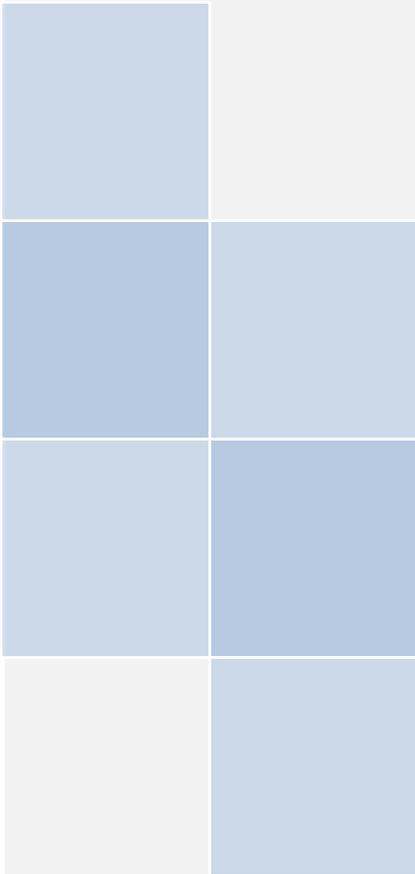
Rua da Quitanda nº 106

20.011-030 – Centro – Rio de Janeiro – RJ

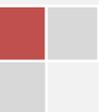
Telefone: (21) 2332-5757

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

Elaborado por: Juliana Chaves Monteiro – Agente de Conformidade de Investimento



Fundo Financeiro



FUNDO FINANCEIRO

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA

A - Disponível	464.369.025
B - Segmento de Renda Fixa	0
1 - Carteiras Próprias	0
2- Operação Compromissada - Lastro: TPF	0
C - Segmento de Imóveis	359.750.983
1 - Carteiras Próprias	359.750.983
D - Fundos de Investimento	104.618.042
1 - Fundos de Curto Prazo	0
2 - Fundos Referenciados DI	104.618.042
3 - Fundos de Renda Fixa RF IMA	0
4 - Fundos Multimercado	0
5 - Fundos de Ações	0

ALOCAÇÃO DOS RECURSOS Fundos de Investimentos

FUNDO FINANCEIRO					FEVEREIRO 2016			
Fundos de Investimento		Participação do RIOPREVIDÊNCIA			Rent. Acum. (%)		Tx. Adm.	
Nome do Fundo	Gestor	PL dos Fundos	Part. % no PL dos Fundos	Valor dos Fundos (R\$ MM)	Mês	Ano	12 meses	(% a.a.)
BB Institucional FI Renda Fixa	BB DTVM	1.295,92	0,04%	0,54	0,94	1,99	13,60	0,20
BB Perfil FIC Renda Fixa Previdenciário	BB DTVM	6.776,83	0,16%	11,04	0,97	2,03	13,74	0,20
BB Títulos Públicos FI Ref. DI LP	BB DTVM	3.196,81	0,04%	1,12	0,98	2,04	13,45	0,10
Bradesco Federal Extra FI RF Ref. DI	BRAM-Asset	5.085,80	0,00%	0,10	0,97	2,03	13,40	0,15
Bradesco Premium FI Ref. DI	BRAM-Asset	6.543,44	1,01%	66,06	0,99	2,05	13,65	0,20
BTG Pactual Master Cash DI (*)	BTG P.- Asset	828,95	0,00%	0,00	0,97	2,02	13,33	0,20
Caixa Brasil FI Ref. DI LP	CAIXA	4.480,38	0,24%	10,96	0,99	2,05	13,63	0,20
HSBC FI Ref. DI LP	HSBC-Asset	10.201,04	0,04%	3,73	0,99	2,05	13,58	0,15
Itaú Institucional FI RF Ref. DI	Itaú	1.473,15	0,74%	10,87	1,00	2,06	13,68	0,18
Santander Corporate FIC Ref. DI	Sant.-Asset	5.193,54	0,00%	0,18	0,98	2,04	13,67	0,20
TOTAL				104,62				

Fonte: RIOPREVIDÊNCIA, Banco do Brasil, BTG Pactual, Bradesco, Caixa, HSBC, Itaú, e Santander.
(*) - Valor bloqueado, em verificação pelo Rioprevidência.

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

COMPOSIÇÃO DAS APLICAÇÕES

FUNDO FINANCEIRO Fevereiro de 2016

Posição Consolidada da Carteira	(R\$)	(% do total)
1- Títulos Públicos Federais	67.619.409	14,6%
1.1 - Prefixados	30.548	0,0%
1.2 - Pós-fixados	32.182.239	6,9%
1.3 - Operações Compromissadas	35.406.622	7,6%
2- Títulos Privados de Baixo Risco de Crédito (I)	36.249.236	7,8%
3.1 - CDB	4.685.136	1,0%
3.2 - Let. Financeira	26.818.289	5,8%
3.3 - Debêntures	4.154.414	0,9%
3.4 - DPGE	463.861	0,1%
3.5 - Outros Títulos	127.536	0,0%
3- Cotas de Fundos (II)	749.316	0,2%
4- Tesouraria (III)	81	0,0%
5- Imóveis (IV)	359.750.983	77,5%
Total da Carteira	464.369.025	100,0%

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

(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: BB Institucional, BB Prev. Perfil, Bradesco Premium DI, HSBC DI e Santander Corporate, investido em outros fundos de investimento.

(III) Recursos mantidos em Tesouraria nos fundos investidos.

(IV) Refere-se ao valor apurado em 31/12/2015.

LIMITES DE CONCENTRAÇÃO

FUNDO FINANCEIRO				FEVEREIRO DE 2016	
Posição da Carteira em 29/02/2016, por Limites do PAI e Resolução nº 3.922/10 e alterações					
Segmento	Tipo de Ativo	Valores (R\$)	% (IV)	Limites PAI (% total)	Limite da Resolução nº 3.922/10
Renda Fixa (I)	FI/FIC RF ou Referenciado (Art. 7º, IV)	<u>104.618.042</u>	<u>0,31%</u>	8,0%	Até 30,0%
Total Renda Fixa		<u>104.618.042</u>	<u>0,31%</u>		
Total do Ativo do Rioprevidência (II)		33.836.308.906			
Imóveis (III)	Terrenos e Edificações	359.750.983			

Fonte: RIOPREVIDÊNCIA, Banco do Brasil, Bradesco, BTG Pactual, Caixa, HSBC, Itaú e Santander.

Glossário:

FI/FIC - Fundos de Investimento

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

(I) 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.

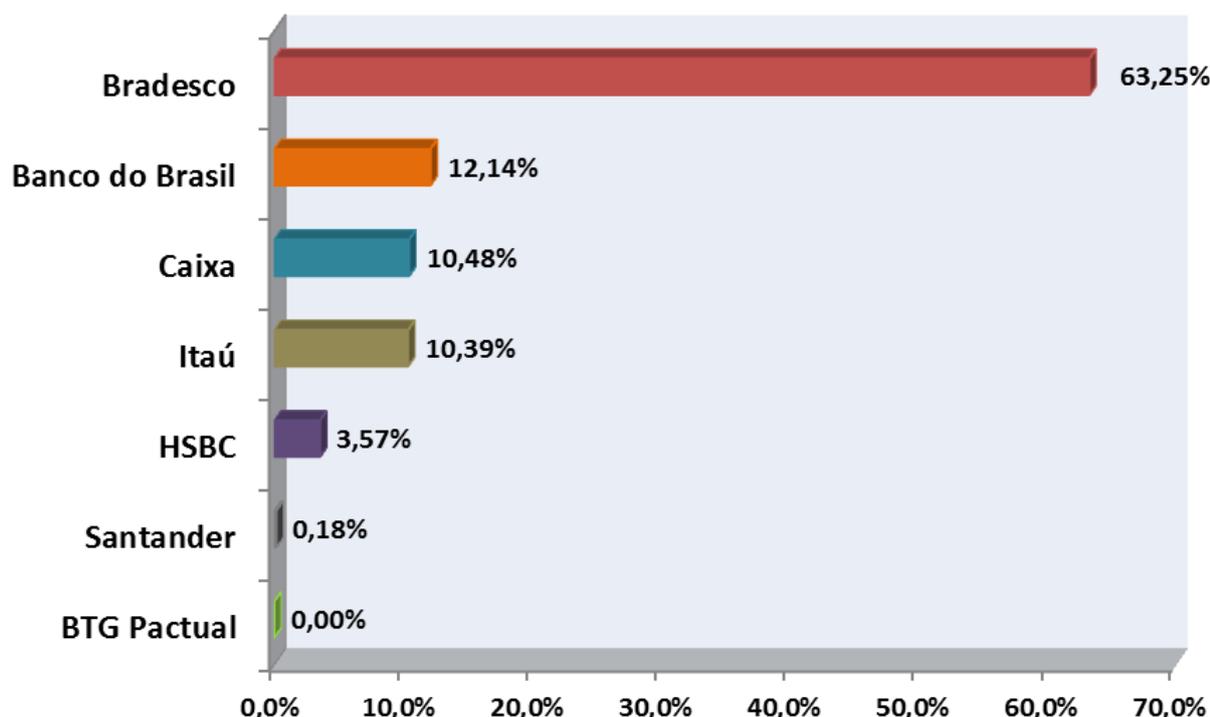
(II) Valor total do Ativo do Rioprevidência em 31/12/2015 (F. Financeiro + F. Previdenciário)

(III) Refere-se ao valor apurado em 31/12/2015.

(IV) Refere-se ao valor do ativo total apurado em 31/12/2015. (F. Financeiro + F. Previdenciário)

No mês de fevereiro, as alocações do FUNDO FINANCEIRO se apresentaram em conformidade em relação aos limites estabelecidos na Resolução nº 3.922/10 do CMN, alterações da 4.392/14 e do Plano Anual de Investimentos.

DISTRIBUIÇÃO DAS CARTEIRAS DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA



No encerramento do mês de fevereiro, as aplicações financeiras do Fundo Financeiro em Fundos de Investimento totalizaram R\$ 104.617.937,23.

COMITÊ DE INVESTIMENTO – FEVEREIRO 2016

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 03 de fevereiro de 2016, na Sede Administrativa, à Rua da Quitanda nº 106 – Centro - Rio de Janeiro, foi aprovada a seguinte proposta para o mês de fevereiro:

Fundo Financeiro:

No cenário externo, há grande preocupação com a desaceleração da economia chinesa, provocando grande aversão ao risco. No Brasil, a crise 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



FUNDO PREVIDENCIÁRIO

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA

A - Disponível	308.490.862
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	308.490.862
1 - Fundos de Curto Prazo	0
2 - Fundos Referenciados DI	49.370.991
3 - Fundos de Renda Fixa RF IMA	259.119.871
4 - Fundos de Renda Fixa - Crédito Privado	0
5 - Fundos Multimercado	0
6 - Fundos de Ações	0

ALOCAÇÃO DOS RECURSOS

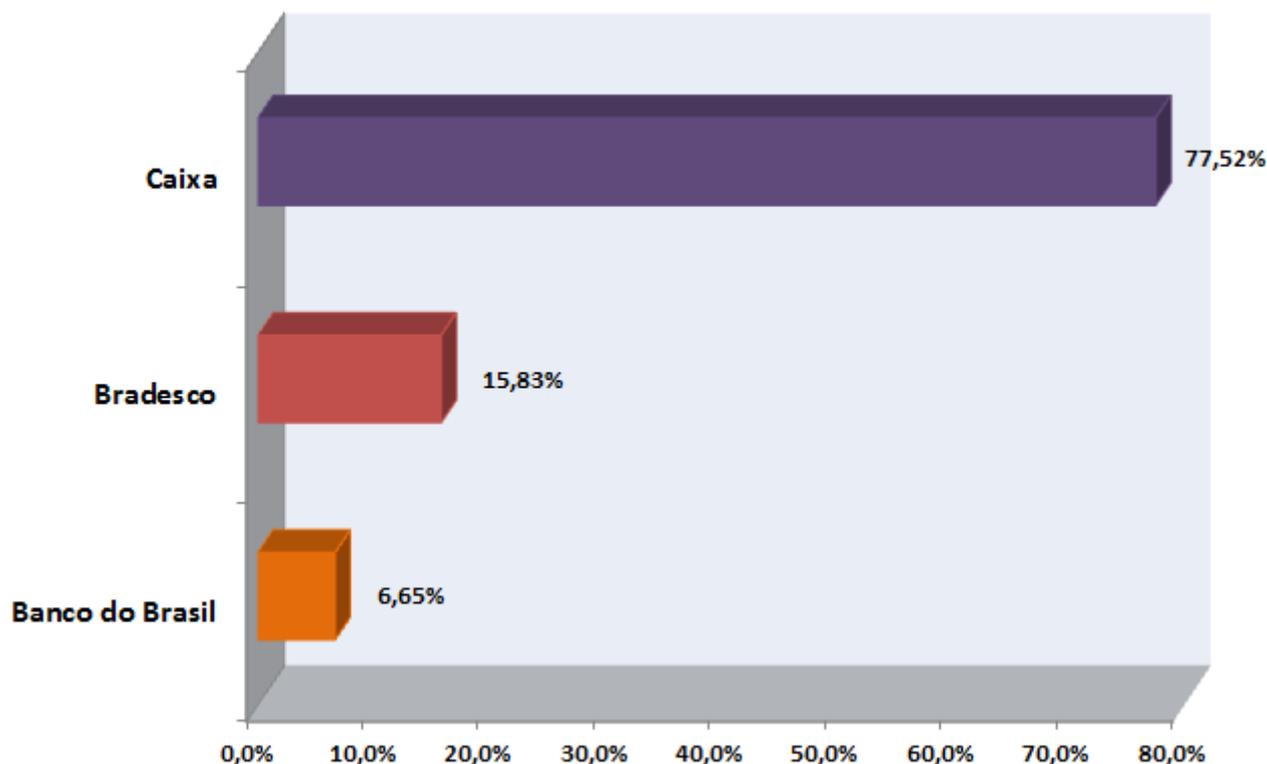
Fundos de Investimentos

FUNDO PREVIDENCIÁRIO					FEVEREIRO 2016				
Fundos de Investimento		Participação do RIOPREVIDÊNCIA			Rent. Acum. (%)			Tx. Adm.	
Nome do Fundo	Gestor	PL dos Fundos	Part. % no PL dos Fundos	Valor dos Fundos (R\$ MM)	Mês	Ano	12 meses	(% a.a.)	
BB TP IPCA VI FI RF Previdenciário	BB DTVM	268,36	2,02%	5,42	3,03	5,24	11,73	0,20	
BB TP X FI RF Previdenciário	BB DTVM	415,59	3,64%	15,11	3,06	5,55	-	0,20	
Bradesco Federal Extra FI RF Ref. DI	BRAM-Asset	5.085,80	0,00%	0,03	0,97	2,03	13,40	0,15	
Bradesco Premium FI Ref. DI	BRAM-Asset	6.543,44	0,75%	48,80	0,99	2,05	13,65	0,20	
Caixa Brasil IMA B 5+ TP FI RF LP	Caixa	289,01	7,54%	21,79	2,71	3,81	5,12	0,20	
Caixa Brasil FI Ref. DI LP	Caixa	4.480,38	0,01%	0,54	0,99	2,05	13,63	0,20	
Caixa Brasil 2030 III TP FI RF (1)	Caixa	168,84	20,93%	35,35	2,58	5,00	9,08	0,20	
Caixa Brasil 2024 IV TP FI RF (2)	Caixa	675,68	13,08%	88,34	3,72	5,34	12,66	0,20	
Caixa Brasil 2020 III TP FI RF (3)	Caixa	104,59	15,49%	16,21	2,66	6,33	14,18	0,20	
Caixa Brasil 2016 II TP FI RF (4)	Caixa	808,56	1,32%	10,67	0,96	2,54	12,79	0,20	
Caixa Brasil 2018 IV TP FI RF (5)	Caixa	255,53	8,44%	21,58	1,36	4,65	13,97	0,20	
Caixa Brasil 2020 IV TP FI RF (6)	Caixa	457,43	4,58%	20,97	2,63	6,28	11,08	0,20	
Caixa Brasil 2024 VI TP FI RF (7)	Caixa	148,57	15,94%	23,68	3,77	5,42	8,51	0,20	
TOTAL				308,49					

Em fevereiro, 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.

No mês de fevereiro, as alocações do FUNDO PREVIDENCIÁRIO se apresentaram em conformidade em relação aos limites estabelecidos na Resolução nº 3.922/10 do CMN, alterações da 4.392/14 e do Plano Anual de Investimentos.

DISTRIBUIÇÃO DAS CARTEIRAS DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA



No encerramento do mês de fevereiro, as aplicações financeiras do Fundo Previdenciário em Fundos de Investimento totalizaram R\$ 308.490.862,31.

COMITÊ DE INVESTIMENTO – FEVEREIRO 2016

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 03 de fevereiro de 2016, na Sede Administrativa, à Rua da Quitanda nº 106 – Centro - Rio de Janeiro, foi aprovada a seguinte proposta para o mês de fevereiro:

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.