

2016



Relatório Mensal de Investimentos

Fundos Financeiro e Previdenciário

Junho



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

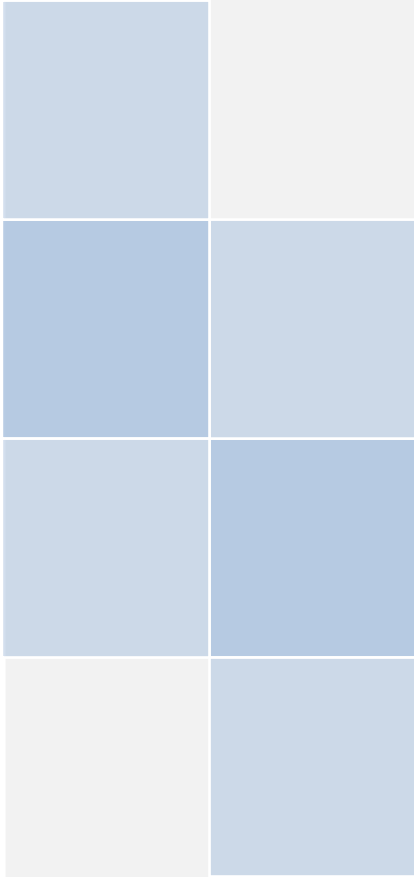
Rua da Quitanda nº 106

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	
CARTEIRA GLOBAL	
Segmento	Valor
Renda Fixa	3.926.683
Fundos de Investimentos	
Fundos Referenciados DI	3.926.683
Imóveis	359.750.983
Carteira Própria	359.750.983
TOTAL	363.677.666

ALOCAÇÃO DOS RECURSOS

Fundos de Investimentos

FUNDO FINANCEIRO						JUNHO 2016			
Fundos de Investimento	Participação do RIOPREVIDÊNCIA					Rent. Acum. (%)		Tx. Adm.	
Nome do Fundo	Gestor	Valor dos Fundos (R\$ MM)	Part. % no PL dos Fundos	PL dos Fundos	Mês	Ano	12 meses	(% a.a.)	
BB Institucional FI Renda Fixa	BB DTVM	0,07	0,01%	1.023,77	0,53	5,93	13,28	0,20	
BB Perfil FIC Renda Fixa Previdenciário	BB DTVM	0,05	0,00%	5.796,61	1,07	6,49	13,92	0,20	
BB Títulos Públicos FI Ref. DI LP	BB DTVM	0,00	0,00%	3.903,73	1,15	6,63	13,92	0,10	
Bradesco Premium FI Ref. DI	BRAM-Asset	3,60	0,06%	6.049,75	1,18	6,72	14,11	0,20	
BTG Pactual Master Cash DI (*)	BTG P.- Asset	0,00	0,00%	652,95	1,14	6,56	13,80	0,20	
Caixa Brasil FI Ref. DI LP	CAIXA	0,00	0,00%	4.476,58	1,16	6,73	14,15	0,20	
HSBC FI Ref. DI LP	HSBC-Asset	0,01	0,00%	10.008,69	1,17	6,73	14,17	0,15	
Itaú Institucional FI RF Ref. DI	Itaú	0,01	0,00%	1.175,71	1,17	6,75	14,21	0,18	
Santander Corporate FIC Ref. DI (*)	Sant.-Asset	0,18	0,00%	5.471,76	1,18	6,71	14,14	0,20	
TOTAL		3,93							

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

(*) - Valores bloqueados, em verificação pelo Rioprevidência.

Em junho, 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

JUNHO 2016

Posição Consolidada da Carteira	(R\$)	(% do total)
1- Títulos Públicos Federais	2.539.759	0,7%
1.1 - Prefixados	4.264	0,0%
1.2 - Pós-fixados	1.306.438	0,4%
1.3 - Operações Compromissadas	1.229.057	0,3%
2- Títulos Privados de Baixo Risco de Crédito (I)	1.379.092	0,4%
3.1 - CDB	212.828	0,1%
3.2 - Let. Financeira	1.013.555	0,3%
3.3 - Debêntures	136.226	0,0%
3.4 - DPGE	14.488	0,0%
3.5 - Outros Títulos	1.994	0,0%
3- Cotas de Fundos (II)	7.830	0,0%
4- Tesouraria (III)	2	0,0%
5- Imóveis (IV)	359.750.983	98,9%
Total da Carteira	363.677.666	100,0%

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

(I) Valor em Cotas dos Fundos BB Institucional, BB Prev. Perfil, Bradesco Premium DI, Caixa FI Brasil DI, HSBC DI LP, Itaú Institucional DI 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 LP e Santander Corporate investido em outros fundos de investimento.

(III) Recursos mantidos em Tesouraria nos fundos investidos.

(IV) Refere-se ao valor apurado em 30/05/2016.

LIMITES DE CONCENTRAÇÃO

FUNDO FINANCEIRO

JUNHO 2016

Posição da Carteira em 30/06/2016, 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>3.926.683</u>	<u>0,01%</u>	8,0%	Até 30,0%
Total Renda Fixa		<u>3.926.683</u>	<u>0,01%</u>		
Total do Ativo do Rioprevidência (II)		36.306.964.842			
Imóveis (III)	Terrenos e Edificações	<u>359.750.983</u>			

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: BB Institucional RF, Bradesco Premium DI, Caixa FI Brasil DI, HSBC DI LP e Itaú Institucional DI que permite a alocação em títulos privados de baixo risco de crédito.

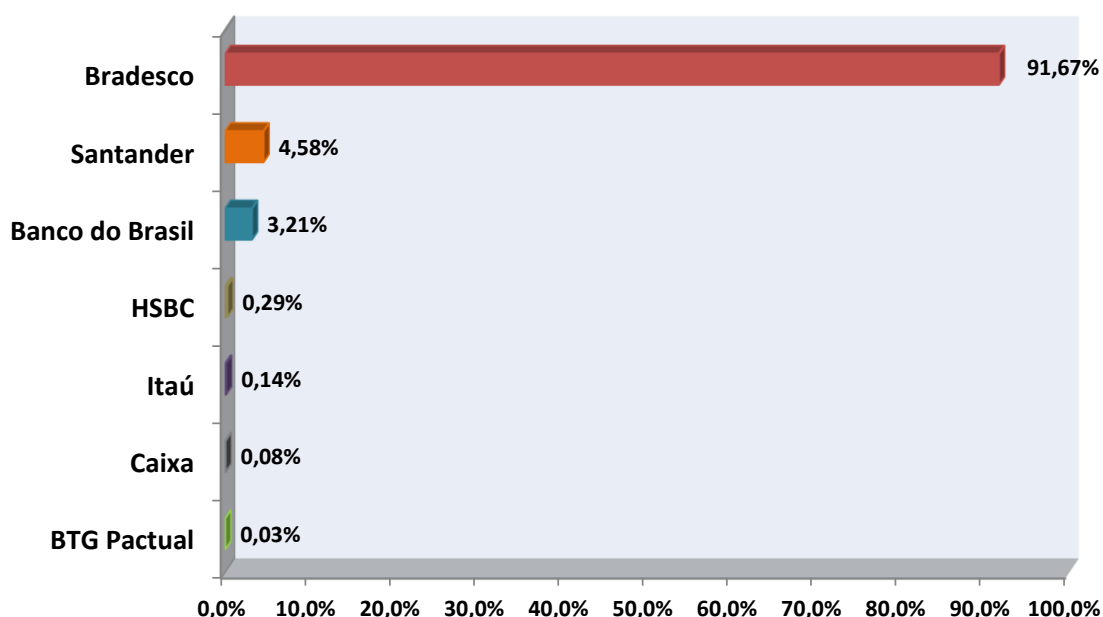
(II) Valor total do Ativo do Rioprevidência em 30/05/2016 (F. Financeiro + F. Previdenciário)

(III) Refere-se ao valor apurado em 30/05/2016.

(IV) Refere-se ao valor do ativo total apurado em 30/05/2016. (F. Financeiro + F. Previdenciário)

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

DISTRIBUIÇÃO DAS CARTEIRAS DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA



No encerramento do mês de junho, as aplicações financeiras do Fundo Financeiro em Fundos de Investimento totalizaram R\$ 3.926.683,14.

COMITÊ DE INVESTIMENTO – JUNHO 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 01 de junho de 2016, na Sede Administrativa, à Rua da Quitanda nº 106 – Centro - Rio de Janeiro, foi aprovada a seguinte proposta para o mês de junho:

Fundo Financeiro:

No cenário externo, a desaceleração da economia chinesa e o ritmo da alta de juros nos EUA continuam provocando volatilidade nos mercados. No Brasil o clima de incerteza permanece elevado, reflexo do conturbado momento econômico e político do país.

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	
CARTEIRA GLOBAL	
Segmento	Valor
Renda Fixa	353.725.090
Fundos de Investimentos	
Fundos Referenciados DI	9.084.174
Fundos de Renda Fixa RF IMA/IDkA	344.640.917
Imóveis	0
Carteira Própria	0
TOTAL	353.725.090

ALOCAÇÃO DOS RECURSOS Fundos de Investimentos

FUNDO PREVIDENCIÁRIO					JUNHO 2016			
Fundos de Investimento		Participação do RIOPREVIDÊNCIA			Rent. Acum. (%)			Tx. Adm.
Nome do Fundo	Gestor	Valor dos Fundos (R\$ MM)	Part. % no PL dos Fundos	PL dos Fundos	Mês	Ano	12 meses	(% a.a.)
BB Perfil FIC Renda Fixa Previdenciário	BB DTVM	1,54	0,03%	5.796,61	1,07	6,49	13,92	0,20
BB TP IPCA VI FI RF Previdenciário	BB DTVM	5,84	2,02%	289,15	0,61	13,39	16,50	0,20
BB TP X FI RF Previdenciário	BB DTVM	16,22	3,58%	453,33	0,65	13,26	-	0,20
BB TP XI FI RF PREVIDENCIÁRIO	BB DTVM	15,66	14,67%	106,71	0,55	-	-	0,20
Bradesco Federal Extra FI RF Ref. DI	BRAM-Asset	0,04	0,00%	4.278,23	1,14	6,55	13,83	0,15
Bradesco Premium FI Ref. DI	BRAM-Asset	6,94	0,11%	6.049,75	1,18	6,72	14,11	0,20
Caixa Brasil IMA B 5+ TP FI RF LP	Caixa	25,30	5,70%	444,11	2,58	20,49	16,21	0,20
Caixa Brasil FI Ref. DI LP	Caixa	0,56	0,01%	4.476,58	1,16	6,73	14,15	0,20
Caixa Brasil 2016 II TP FI RF	Caixa	11,15	1,32%	844,73	1,34	7,00	15,80	0,20
Caixa Brasil 2018 II TP FI RF	Caixa	44,22	5,87%	752,93	0,82	8,59	15,82	0,20
Caixa Brasil 2018 IV TP FI RF	Caixa	22,42	8,44%	265,50	0,82	8,62	15,86	0,20
Caixa Brasil 2020 III TP FI RF	Caixa	16,93	15,49%	109,30	0,68	10,98	16,17	0,20
Caixa Brasil 2020 IV TP FI RF	Caixa	21,91	3,93%	557,48	0,68	10,91	15,79	0,20
Caixa Brasil 2024 IV TP FI RF	Caixa	96,82	12,75%	759,16	0,74	15,13	15,86	0,20
Caixa Brasil 2024 VI TP FI RF	Caixa	25,95	15,94%	162,82	0,73	15,23	18,60	0,20
Caixa Brasil 2030 III TP FI RF	Caixa	40,81	20,84%	195,80	2,73	20,69	16,31	0,20
Itaú Institucional Alocação Dinâmica	Itaú	1,42	0,22%	653,61	2,01	13,01	18,35	0,40
TOTAL		353,73						

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

Em junho, 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.

COMPOSIÇÃO DAS APLICAÇÕES

FUNDO PREVIDENCIÁRIO

JUNHO 2016

Posição Consolidada da Carteira	(R\$)	(% do total)
1 - Títulos Públicos Federais	349.123.127	98,7%
1.1 - Prefixados	11.552	0,0%
1.2 - Pós-fixados	2.926.099	0,8%
1.3 - NTN-B (IPCA)	339.260.424	95,9%
1.4 - Operações Compromissadas	6.925.052	2,0%
2 - Títulos Privados de Baixo Risco de Crédito (I)	3.141.902	0,9%
2.1 - CDB	419.273	0,1%
2.2 - Let. Financeira	2.360.506	0,7%
2.3 - Debêntures	296.397	0,1%
2.4 - DPGE	52.313	0,0%
2.5 - Outros Títulos	13.413	0,0%
3 - Cotas de Fundos (II)	1.457.336	0,4%
4 - Tesouraria (III)	2.726	0,0%
5 - Imóveis	0	0,0%
Total da Carteira	353.725.090	100,0%

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

(I) Valor em Cotas dos Fundos BB Prev. Perfil, Bradesco Premium DI e Caixa FI Brasil DI que está alocado em títulos privados de baixo risco de crédito.

(II) Valor em Cotas dos Fundos BB Prev. Perfil, Bradesco Premium DI e Itaú Institucional Alocação Dinâmica investido em outros fundos de investimento.

(III) Recursos mantidos em Tesouraria nos fundos investidos.

LIMITES DE CONCENTRAÇÃO

FUNDO PREVIDENCIÁRIO

JUNHO 2016

Posição da Carteira em 30/06/2016, 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 100% títulos TN (Art. 7º,I,b)	<u>343.224.503</u>	<u>0,95%</u>	100,0%	Até 100,0%
Renda Fixa (II)	FII/FIC RF ou Referenciado (Art. 7º,IV)	<u>10.500.588</u>	<u>0,03%</u>	30,0%	Até 30,0%
Total Renda Fixa		<u>353.725.090</u>	<u>0,97%</u>		
Total do Ativo do Rioprevidência (III)		36.306.964.842			
Imóveis	Terrenos e Edificações	<u>0</u>			

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

Glossário:

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.

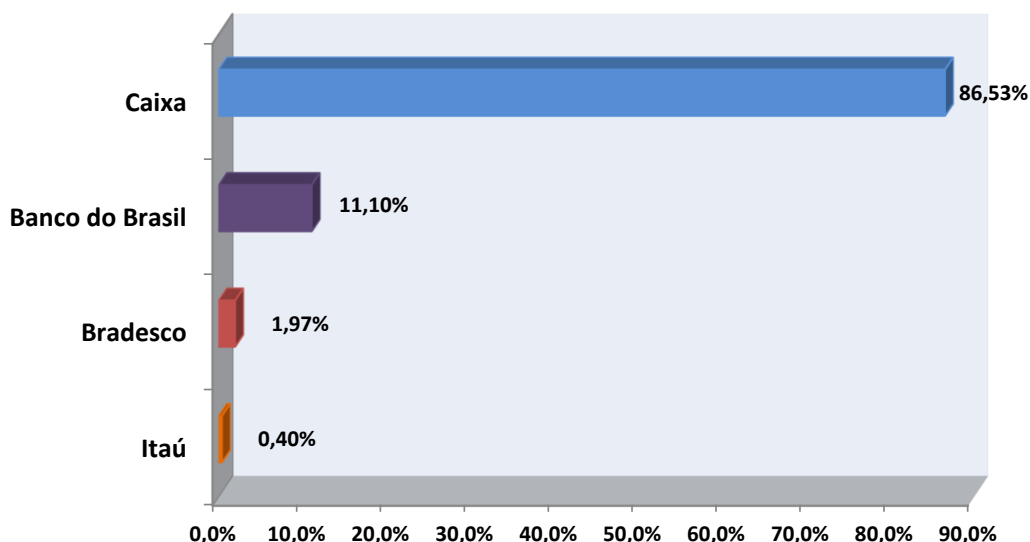
(II) Qualquer indicador de desempenho de Renda Fixa. Inclui valor em cotas dos Fundos Bradesco Premium DI e Caixa FI Brasil DI que permite a alocação em títulos privados de baixo risco de crédito.

(III) Valor total do Ativo total apurado em 30/05/2016. (F Financeiro + F. Previdenciário)

(IV) Refere-se ao ativo total apurado em 30/05/2016. (F Financeiro + F. Previdenciário)

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

DISTRIBUIÇÃO DAS CARTEIRAS DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA



No encerramento do mês de junho, as aplicações financeiras do Fundo Previdenciário em Fundos de Investimento totalizaram R\$ 353.725.090,44.

COMITÊ DE INVESTIMENTO – JUNHO 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 01 de junho de 2016, na Sede Administrativa, à Rua da Quitanda nº 106 – Centro - Rio de Janeiro, foi aprovada a seguinte proposta para o mês de junho:

Fundo Previdenciário:

Considerando a expectativa de queda da inflação e a possibilidade do início da redução dos juros (SELIC), propomos a alocação nos seguintes segmentos:

- Fundos Estratégia Mista (CDI, IRFM e IMA);
- Fundos Crédito Privado;
- Fundos DI;
- Fundos atrelados à NTN-B com benchmark igual ou superior a meta atuarial.