

2016



Relatório Mensal de Investimentos

Fundos Financeiro e Previdenciário

Agosto



Diretoria de Investimentos

Reges Moisés dos Santos

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

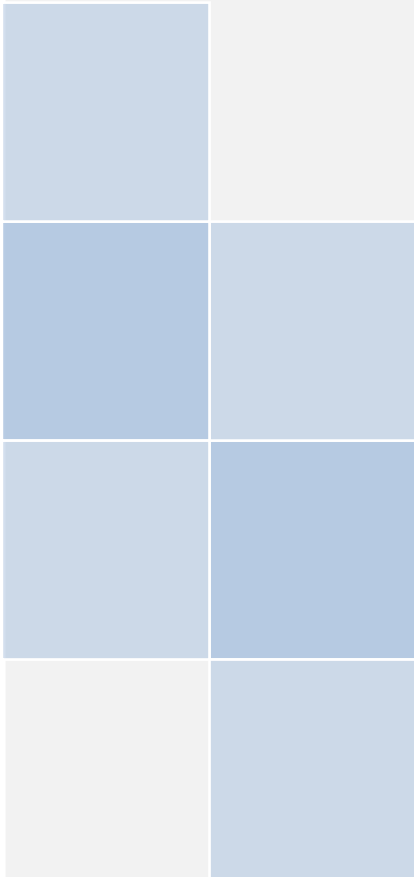
Rua da Quitanda nº 106

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	11.069.994
Fundos de Investimentos	
Fundos Referenciados DI	11.069.994
Imóveis	351.667.483
Carteira Própria	351.667.483
TOTAL	362.737.477

ALOCAÇÃO DOS RECURSOS **Fundos de Investimentos**

FUNDO FINANCEIRO					AGOSTO 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%	892,92	1,27	8,52	13,39	0,20
BB Perfil FIC Renda Fixa Previdenciário	BB DTVM	0,06	0,00%	5.385,86	1,25	9,04	14,01	0,20
BB Títulos Públicos FI Ref. DI LP	BB DTVM	0,00	0,00%	3.849,15	1,20	9,09	13,96	0,10
Bradesco Premium FI Ref. DI	BRAM-Asset	10,30	0,15%	6.828,34	1,22	9,24	14,18	0,20
BTG Pactual Tesouro Selic FI RF (*)	BTG P.- Asset	0,00	0,00%	693,16	1,18	8,99	13,82	0,20
Caixa Brasil FI Ref. DI LP	CAIXA	0,05	0,00%	5.039,44	1,21	9,21	14,14	0,20
HSBC FI Ref. DI LP	HSBC-Asset	0,01	0,00%	9.778,17	1,21	9,24	14,18	0,15
Itaú Institucional FI RF Ref. DI	Itaú	0,39	0,03%	1.308,31	1,22	9,27	14,23	0,18
Santander Corporate FIC Ref. DI (*)	Sant.-Asset	0,18	0,00%	5.609,40	1,22	9,22	14,16	0,20
TOTAL		11,07						

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

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

Em agosto, 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

AGOSTO 2016

Posição Consolidada da Carteira	(R\$)	(% do total)
1- Títulos Públicos Federais	8.190.025	2,3%
1.1 - Prefixados	190	0,0%
1.2 - Pós-fixados	3.644.483	1,0%
1.3 - Operações Compromissadas	4.545.352	1,3%
2- Títulos Privados de Baixo Risco de Crédito (I)	2.868.917	0,8%
3.1 - CDB	393.848	0,1%
3.2 - Let. Financeira	2.154.533	0,6%
3.3 - Debêntures	283.246	0,1%
3.4 - DPGE	33.120	0,0%
3.5 - Outros Títulos	4.169	0,0%
3- Cotas de Fundos (II)	11.047	0,0%
4- Tesouraria (III)	6	0,0%
5- Imóveis (IV)	351.667.483	96,9%
Total da Carteira	362.737.477	100,0%

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

(I) Valor em Cotas dos Fundos BB Institucional, BB Perfil FIC RF Prev., 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 Perfil FIC RF Prev., 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 31/07/2016.

LIMITES DE CONCENTRAÇÃO

FUNDO FINANCEIRO

AGOSTO 2016

Posição da Carteira em 31/08/2016, 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>11.069.994</u>	<u>0,03%</u>	8,0%	Até 30,0%
Total Renda Fixa		<u>11.069.994</u>	<u>0,03%</u>		
Total do Ativo do Rioprevidência (II)		36.849.747.610			
Imóveis (III)	Terrenos e Edificações	<u>351.667.483</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.

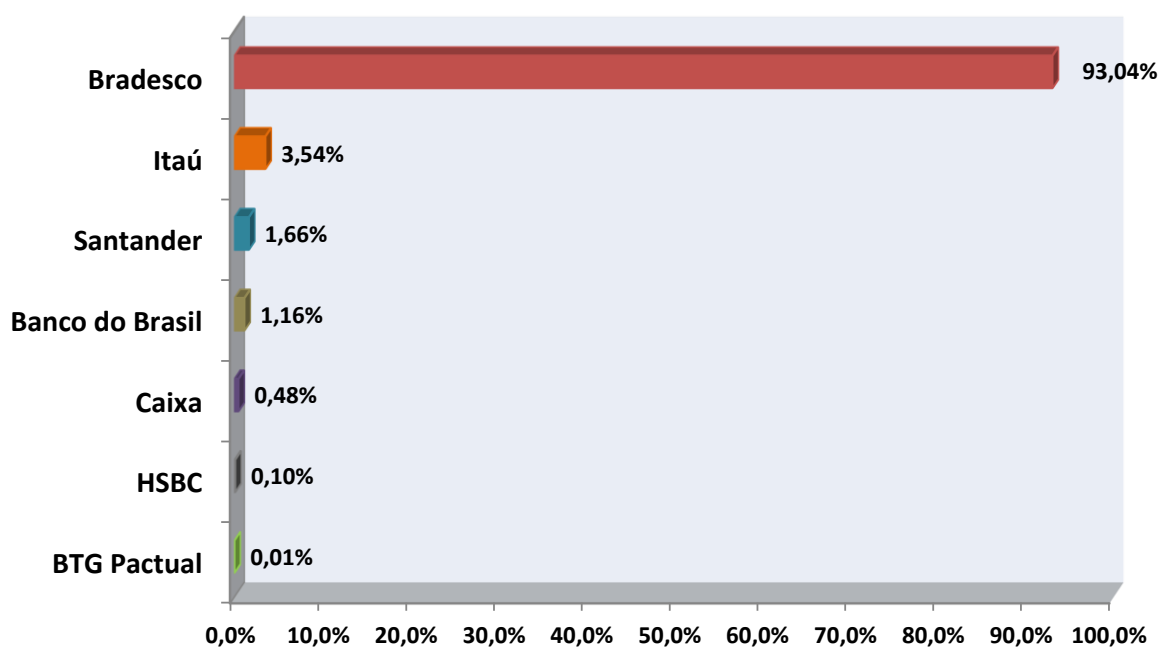
(II) Valor total do Ativo do Rioprevidência em 31/07/2016 (F. Financeiro + F. Previdenciário)

(III) Refere-se ao valor apurado em 31/07/2016.

(IV) Refere-se ao valor do ativo total apurado em 31/07/2016. (F. Financeiro + F. Previdenciário)

No mês de agosto, 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 agosto, as aplicações financeiras do Fundo Financeiro em Fundos de Investimento totalizaram R\$11.069.994,47.

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

Fundo Financeiro:

No cenário externo, a saída do Reino Unido da União Europeia causa certa apreensão em relação à recuperação da economia europeia. Nos EUA, indicadores favoráveis de emprego apontam para um provável aumento da taxa de juros do país até o fim do ano.

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	407.719.484
Fundos de Investimentos	
Fundos Referenciados DI	47.211.640
Fundos de Renda Fixa RF IMA/IDkA	360.507.844
Imóveis	0
Carteira Própria	0
TOTAL	407.719.484

ALOCAÇÃO DOS RECURSOS Fundos de Investimentos

FUNDO PREVIDENCIÁRIO					AGOSTO 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 IMA-B 5+ TP FI RF Previdenciário	BB DTVM	1,48	0,11%	1.355,84	0,89	25,80	29,82	0,20
BB Perfil FIC Renda Fixa Previdenciário	BB DTVM	1,15	0,02%	5.385,86	1,25	9,04	14,01	0,20
BB TP IPCA VI FI RF Previdenciário	BB DTVM	5,87	2,02%	290,61	1,22	17,16	22,90	0,20
BB TP X FI RF Previdenciário	BB DTVM	16,21	3,58%	453,16	1,24	16,95	-	0,20
BB TP XI FI RF PREVIDENCIÁRIO	BB DTVM	15,72	14,67%	107,16	1,16	-	-	0,20
Bradesco Federal Extra FI RF Ref. DI	BRAM-Asset	0,04	0,00%	4.148,20	1,19	9,00	13,86	0,15
Bradesco Premium FI Ref. DI	BRAM-Asset	45,22	0,66%	6.828,34	1,22	9,24	14,18	0,20
Caixa Brasil IMA B 5+ TP FI RF LP	Caixa	4,90	0,69%	710,44	0,82	25,55	29,43	0,20
Caixa Brasil FI Ref. DI LP	Caixa	0,80	0,02%	5.039,44	1,21	9,21	14,14	0,20
Caixa Brasil 2018 II TP FI RF	Caixa	71,94	3,71%	1.939,71	1,29	11,01	17,85	0,20
Caixa Brasil 2018 IV TP FI RF	Caixa	22,30	8,44%	264,11	1,28	11,04	17,90	0,20
Caixa Brasil 2020 III TP FI RF	Caixa	16,94	15,49%	109,30	1,21	14,02	20,16	0,20
Caixa Brasil 2020 IV TP FI RF	Caixa	21,86	3,70%	591,15	1,21	13,96	20,06	0,20
Caixa Brasil 2024 IV TP FI RF	Caixa	97,51	12,75%	764,57	1,38	19,20	24,38	0,20
Caixa Brasil 2024 VI TP FI RF	Caixa	26,17	15,94%	164,19	1,38	19,31	24,69	0,20
Caixa Brasil 2030 III TP FI RF	Caixa	41,25	20,84%	197,92	1,49	25,44	29,91	0,20
Itaú Institucional Alocção Dinâmica	Itaú	5,95	0,53%	1.118,93	0,92	15,95	20,17	0,40
Itaú Institucional TP Renda Fixa FI	Itaú	12,41	19,47%	63,75	1,13	9,24	-	0,20
TOTAL		407,72						

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

Em agosto, 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

AGOSTO 2016

Posição Consolidada da Carteira	(R\$)	(% do total)
1 - Títulos Públicos Federais	389.548.811	95,5%
1.1 - Prefixados	0	0,0%
1.2 - Pós-fixados	16.112.765	4,0%
1.3 - NTN-B (IPCA)	351.674.401	86,3%
1.4 - Operações Compromissadas	21.761.645	5,3%
2 - Títulos Privados de Baixo Risco de Crédito (I)	12.161.409	3,0%
2.1 - CDB	1.964.519	0,5%
2.2 - Let. Financeira	8.870.409	2,2%
2.3 - Debêntures	1.037.308	0,3%
2.4 - DPGE	239.058	0,1%
2.5 - Outros Títulos	50.115	0,0%
3 - Cotas de Fundos (II)	6.005.708	1,5%
4 - Tesouraria (III)	3.556	0,0%
5 - Imóveis	0	0,0%
Total da Carteira	407.719.484	100,0%

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

(I) Valor em Cotas dos Fundos BB Perfil FIC RF Prev., 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 Perfil FIC RF Prev., 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				AGOSTO 2016	
Posição da Carteira em 31/08/2016, 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>354.560.989</u>	<u>0,96%</u>	100,0%	Até 100,0%
Renda Fixa (II)	FI/FIC RF ou Referenciado (Art. 7º,IV)	<u>53.158.495</u>	<u>0,14%</u>	30,0%	Até 30,0%
Total Renda Fixa		<u>407.719.484</u>	<u>1,11%</u>		
Total do Ativo do Rioprevidência (III)		36.849.747.610			
Imóveis	Terrenos e Edificações	0			

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

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.

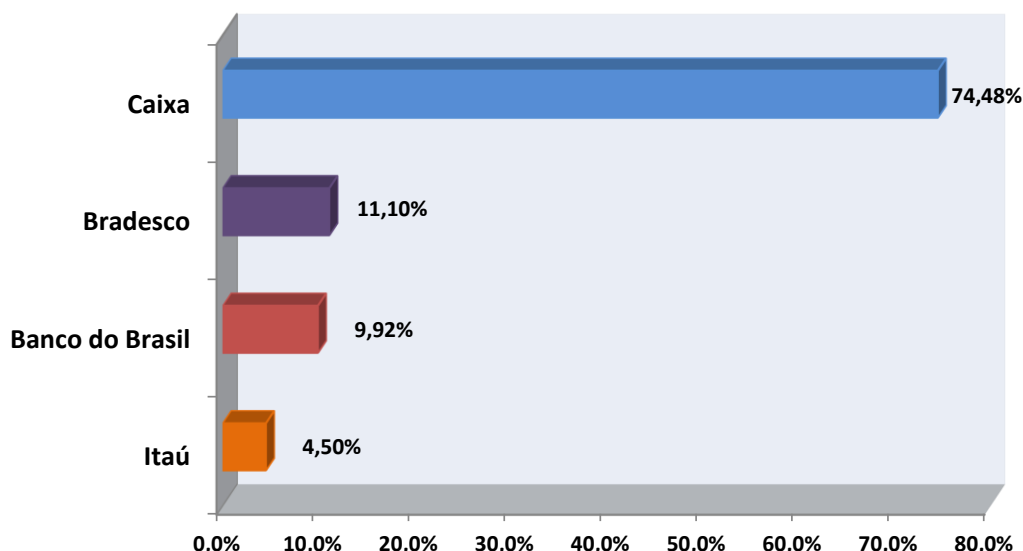
(II) Qualquer indicador de desempenho de Renda Fixa. Inclui valor em cotas dos Fundos Bradesco Premium DI e Caixa FI Brasil DI que permite a alocação em títulos privados de baixo risco de crédito.

(III) Valor total do Ativo total apurado em 31/07/2016. (F Financeiro + F. Previdenciário)

(IV) Refere-se ao ativo total apurado em 31/07/2016. (F Financeiro + F. Previdenciário)

No mês de agosto, 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 agosto, as aplicações financeiras do Fundo Previdenciário em Fundos de Investimento totalizaram R\$ 407.719.483,93.

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

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 atrelados à NTN-B com benchmark igual ou superior a meta atuarial;
- Fundos Estratégia Mista (CDI, IRFM e IMA);
- Fundos DI;
- Fundos IMA B5+;
- Fundos IRFM 1+.