

2016



Relatório Mensal de Investimentos

Fundos Financeiro e Previdenciário

Setembro



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:

Alisson José Ramos Batista

Angela Maria Monteiro Pandolfo

Bruno Luís Lacerda dos Santos

Geny Andrea Alves

Isadora Medeiros Frias

Kelli Manhães Pessanha

Pedro Daflon Fraiz

Ubirajara da Silva Coelho

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

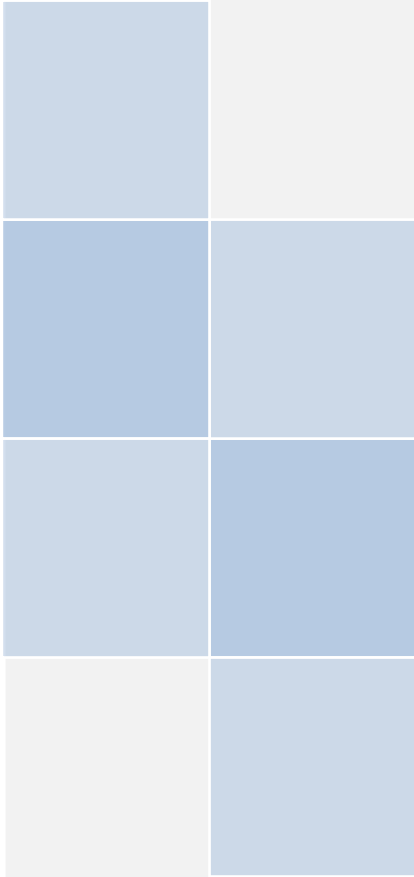
Rua da Quitanda nº 106

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	7.520.320
Fundos de Investimentos	
Fundos Referenciados DI	7.520.320
Imóveis	351.667.483
Carteira Própria	351.667.483
TOTAL	359.187.802

ALOCAÇÃO DOS RECURSOS **Fundos de Investimentos**

FUNDO FINANCEIRO					SETEMBRO 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%	856,83	1,08	9,69	13,33	0,20
BB Perfil FIC Renda Fixa Previdenciário	BB DTVM	0,06	0,00%	5.324,48	1,11	10,26	14,00	0,20
BB Títulos Públicos FI Ref. DI LP	BB DTVM	0,00	0,00%	3.936,13	1,09	10,28	13,95	0,10
Bradesco Premium FI Ref. DI	BRAM-Asset	6,66	0,10%	6.698,51	1,10	10,44	14,15	0,20
BTG Pactual Tesouro Selic FI RF (*)	BTG P.- Asset	0,00	0,00%	618,72	1,06	10,14	13,78	0,20
Caixa Brasil FI Ref. DI LP	CAIXA	0,13	0,00%	4.793,80	1,10	10,42	14,12	0,20
HSBC FI Ref. DI LP	HSBC-Asset	0,01	0,00%	9.675,65	1,10	10,44	14,16	0,15
Itaú Institucional FI RF Ref. DI	Itaú	0,40	0,03%	1.260,79	1,11	10,48	14,21	0,18
Santander Corporate FIC Ref. DI (*)	Sant.-Asset	0,19	0,00%	5.656,99	1,11	10,43	14,15	0,20
TOTAL		7,52						

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

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

Em setembro, 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

SETEMBRO 2016

Posição Consolidada da Carteira	(R\$)	(% do total)
1- Títulos Públicos Federais	5.545.994	1,5%
1.1 - Prefixados	3.215	0,0%
1.2 - Pós-fixados	2.440.510	0,7%
1.3 - Operações Compromissadas	3.102.269	0,9%
2- Títulos Privados de Baixo Risco de Crédito (I)	1.965.575	0,5%
3.1 - CDB	275.489	0,1%
3.2 - Let. Financeira	1.468.534	0,4%
3.3 - Debêntures	196.293	0,1%
3.4 - DPGE	22.357	0,0%
3.5 - Outros Títulos	2.902	0,0%
3- Cotas de Fundos (II)	8.748	0,0%
4- Tesouraria (III)	3	0,0%
5- Imóveis (IV)	351.667.483	97,9%
Total da Carteira	359.187.802	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 31/08/2016.

LIMITES DE CONCENTRAÇÃO

FUNDO FINANCEIRO

SETEMBRO 2016

Posição da Carteira em 30/09/2016, 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>7.520.320</u>	<u>0,02%</u>	8,0%	Até 30,0%
Total Renda Fixa		<u>7.520.320</u>	<u>0,02%</u>		
Total do Ativo do Rioprevidência (II)		36.749.357.666			
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.

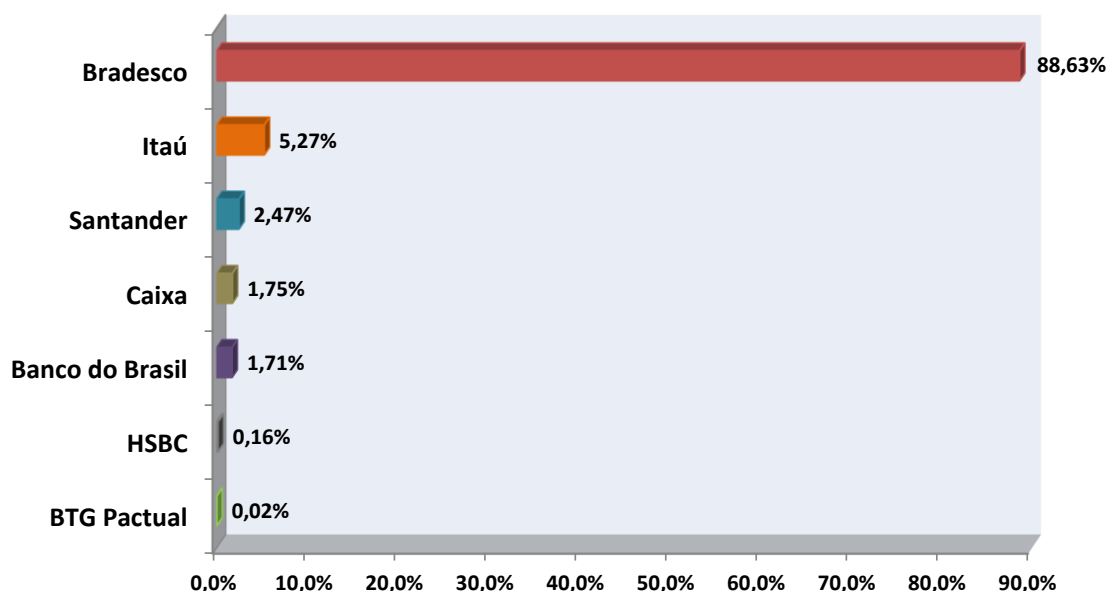
(II) Valor total do Ativo do Rioprevidência em 31/08/2016 (F. Financeiro + F. Previdenciário)

(III) Refere-se ao valor apurado em 31/08/2016.

(IV) Refere-se ao valor do ativo total apurado em 31/08/2016. (F. Financeiro + F. Previdenciário)

No mês de setembro, 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 setembro, as aplicações financeiras do Fundo Financeiro em Fundos de Investimento totalizaram R\$ 7.520.319,57.

COMITÊ DE INVESTIMENTO – SETEMBRO 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 31 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 setembro:

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 feitas pela 4.392/2014.



Fundo Previdenciário



FUNDO PREVIDENCIÁRIO CARTEIRA GLOBAL

Segmento	Valor
Renda Fixa	440.823.854
Fundos de Investimentos	
Fundos Referenciados DI	38.911.361
Fundos de Renda Fixa RF IMA/IDkA	401.912.494
Imóveis	0
Carteira Própria	0
TOTAL	440.823.854

ALOCAÇÃO DOS RECURSOS Fundos de Investimentos

FUNDO PREVIDENCIÁRIO					SETEMBRO 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	1,50	0,11%	1.350,20	1,64	27,87	34,39	0,20
BB Perfil FIC Renda Fixa Previdenciário	BB DTVM	6,36	0,12%	5.324,48	1,11	10,26	14,00	0,20
BB TP IPCA VI FI RF Previdenciário	BB DTVM	5,95	2,02%	294,49	1,34	18,72	24,95	0,20
BB TP X FI RF Previdenciário	BB DTVM	16,43	3,58%	459,17	1,33	18,51	24,48	0,20
BB TP XI FI RF PREVIDENCIÁRIO	BB DTVM	15,94	14,67%	108,66	1,40	-	-	0,20
Bradesco Federal Extra FI RF Ref. DI	BRAM-Asset	0,04	0,00%	3.622,77	1,08	10,18	13,84	0,15
Bradesco Premium FI Ref. DI	BRAM-Asset	28,57	0,43%	6.698,51	1,10	10,44	14,15	0,20
Caixa Brasil IMA B 5+ TP FI RF LP	Caixa	4,98	0,77%	649,08	1,66	27,64	33,84	0,20
Caixa Brasil FI Ref. DI LP	Caixa	0,84	0,02%	4.793,80	1,10	10,42	14,12	0,20
Caixa Brasil 2018 II TP FI RF	Caixa	85,01	3,95%	2.153,96	1,34	12,42	18,82	0,20
Caixa Brasil 2018 IV TP FI RF	Caixa	22,60	8,44%	267,65	1,34	12,45	18,86	0,20
Caixa Brasil 2020 III TP FI RF	Caixa	17,18	15,49%	110,90	1,46	15,60	21,89	0,20
Caixa Brasil 2020 IV TP FI RF	Caixa	32,27	5,29%	609,89	1,46	15,53	21,78	0,20
Caixa Brasil 2024 IV TP FI RF	Caixa	98,61	12,75%	773,17	1,13	20,46	26,54	0,20
Caixa Brasil 2024 VI TP FI RF	Caixa	26,47	15,94%	166,03	1,12	20,58	26,85	0,20
Caixa Brasil 2030 III TP FI RF	Caixa	46,63	22,82%	204,34	0,66	26,22	32,77	0,20
Itaú Institucional Alocação Dinâmica	Itaú	12,68	1,10%	1.151,54	1,81	18,05	21,56	0,40
Itaú Institucional FI RF Ref. DI	Itaú	3,11	0,25%	1.260,79	1,11	10,48	14,21	0,18
Itaú Institucional TP Renda Fixa FI	Itaú	15,66	23,07%	67,90	1,74	11,15	-	0,20
TOTAL		440,82						

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

Em setembro, 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 SETEMBRO 2016

Posição Consolidada da Carteira	(R\$)	(% do total)
1 - Títulos Públicos Federais	417.291.773	94,7%
1.1 - Prefixados	337.366	0,1%
1.2 - Pós-fixados	11.607.080	2,6%
1.3 - NTN-B (IPCA)	388.748.636	88,2%
1.4 - Operações Compromissadas	16.598.691	3,8%
2 - Títulos Privados de Baixo Risco de Crédito (I)	10.681.707	2,4%
2.1 - CDB	1.632.101	0,4%
2.2 - Let. Financeira	7.880.185	1,8%
2.3 - Debêntures	917.124	0,2%
2.4 - DPGE	207.605	0,0%
2.5 - Outros Títulos	44.692	0,0%
3 - Cotas de Fundos (II)	12.847.431	2,9%
4 - Tesouraria (III)	2.944	0,0%
5 - Imóveis	0	0,0%
Total da Carteira	440.823.854	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, Caixa FI Brasil DI e Itaú Institucional 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				SETEMBRO 2016	
Posição da Carteira em 30/09/2016, 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>389.233.173</u>	<u>1,06%</u>	100,0%	Até 100,0%
Renda Fixa (II)	FI/FIC RF ou Referenciado (Art. 7º,IV)	<u>51.590.681</u>	<u>0,14%</u>	30,0%	Até 30,0%
Total Renda Fixa		<u>440.823.854</u>	<u>1,20%</u>		
Total do Ativo do Rioprevidência (III)		36.749.357.666			
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.

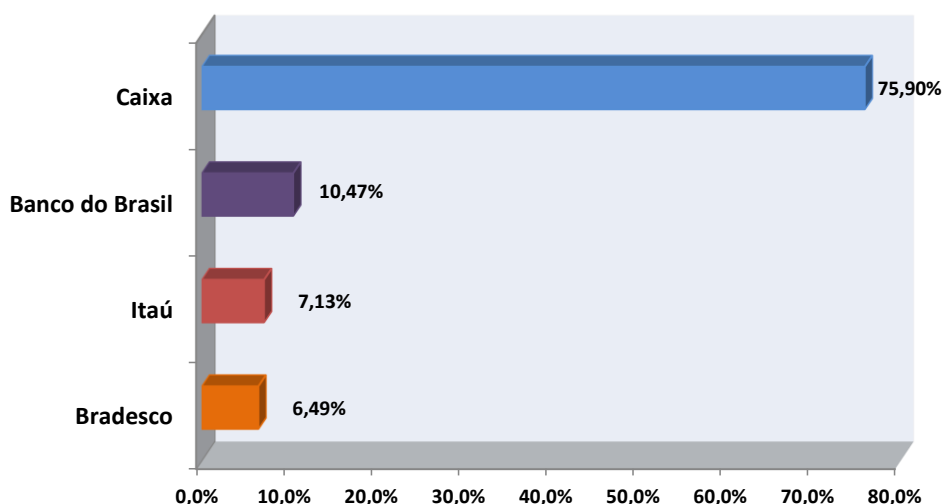
(II) Qualquer indicador de desempenho de Renda Fixa. Inclui valor em cotas dos Fundos Bradesco Premium DI e Caixa FI Brasil DI que permite a alocação em títulos privados de baixo risco de crédito.

(III) Valor total do Ativo total apurado em 31/08/2016. (F Financeiro + F. Previdenciário)

(IV) Refere-se ao ativo total apurado em 31/08/2016. (F Financeiro + F. Previdenciário)

No mês de setembro, 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 setembro, as aplicações financeiras do Fundo Previdenciário em Fundos de Investimento totalizaram R\$ 420.823.854,29.

COMITÊ DE INVESTIMENTO – SETEMBRO 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 31 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 setembro:

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 Inflação (IMA/IDKA);
- Fundos Pré-fixados (IRFM).