

2017



Relatório Mensal de Investimentos

Fundos Financeiro e Previdenciário

FEVEREIRO



Diretoria de Investimentos

Reges Moisés dos Santos

Diretor Presidente

Gerência de Operações e Planejamento

Luciana Pinto Venâncio

Gerente de Operações e Planejamento

Kelli Manhães Pessanha

Coordenadora de Operações e Planejamento

Equipe Técnica:

Alisson José Ramos Batista

Angela Maria Monteiro Pandolfo

Bruno Luís Lacerda dos Santos

Geny Andrea Alves

Rodrigo Santos Martins

Teresa Luiza da Silva Dias

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

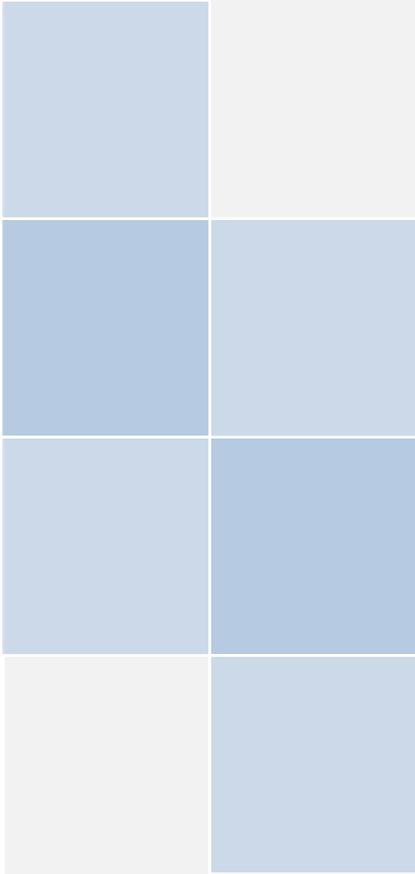
Rua da Quitanda nº 106

20.011-030 – Centro – Rio de Janeiro – RJ

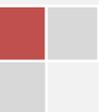
Telefone: (21) 2332-5757

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	6.493.162
Fundos de Investimentos	
Fundos Referenciados DI	6.493.162
Imóveis	347.664.553
Carteira Própria	347.664.553
TOTAL	354.157.715

ALOCAÇÃO DOS RECURSOS Fundos de Investimentos

FUNDO FINANCEIRO					FEVEREIRO 2017			
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	1,04	0,13%	791,14	0,90	2,02	13,40	0,20
BB Títulos Públicos FI Ref. DI LP	BB DTVM	0,00	0,00%	4.021,51	0,86	1,95	13,71	0,10
Bradesco Premium FI Ref. DI	BRAM-Asset	4,59	0,06%	7.584,32	0,87	1,98	14,17	0,20
Bradesco H FI RF Ref. DI LP (Antigo HSB)	BRAM-Asset	0,01	0,00%	5.978,95	0,88	1,97	13,90	0,20
BTG Pactual Tesouro Selic FI RF (*)	BTG P.- Asset	0,00	0,00%	6.313,65	0,86	1,94	13,54	0,20
Caixa Brasil FI Ref. DI LP	CAIXA	0,50	0,04%	1.284,91	0,88	1,96	13,90	0,20
Itaú Institucional FI RF Ref. DI	Itaú	0,15	0,03%	591,64	0,87	1,96	13,96	0,18
Santander Corporate FIC Ref. DI (*)	Sant.-Asset	0,20	0,00%	5.939,17	0,87	1,97	13,96	0,20
TOTAL		6,49						

Fonte: RIOPREVIDÊNCIA, Banco do Brasil, Bradesco, BTG Pactual, Caixa, Itaú e Santander.
(*) - Valores bloqueados, 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 2017

Posição Consolidada da Carteira	(R\$)	(% do total)
1- Títulos Públicos Federais	4.994.727	1,4%
1.1 - Prefixados	1.095	0,0%
1.2 - Pós-fixados	2.123.513	0,6%
1.3 - Operações Compromissadas	2.870.119	0,8%
2- Títulos Privados de Baixo Risco de Crédito (I)	1.490.142	0,4%
3.1 - CDB	194.698	0,1%
3.2 - Let. Financeira	1.038.869	0,3%
3.3 - Debêntures	235.725	0,1%
3.4 - DPGE	14.268	0,0%
3.5 - Outros Títulos	6.581	0,0%
3- Cotas de Fundos (II)	8.284	0,0%
4- Tesouraria (III)	9	0,0%
5- Imóveis (IV)	347.664.553	98,2%
Total da Carteira	354.157.715	100,0%

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

(I) Valor em Cotas dos Fundos BB Institucional, Bradesco Premium DI, Caixa FI Brasil DI, Bradesco H FI RF Ref 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, Bradesco Premium DI, Bradesco H FI RF Ref 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 28/02/2017.

LIMITES DE CONCENTRAÇÃO

FUNDO FINANCEIRO				FEVEREIRO 2017	
Posição da Carteira em 24/02/2017, 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>6.493.162</u>	<u>0,01%</u>	10,0%	Até 30,0%
Total Renda Fixa		<u>6.493.162</u>	<u>0,01%</u>		
Total do Ativo do Rioprevidência (II)		120.762.017.603			
Imóveis (III)	Terrenos e Edificações	347.664.553			

Fonte: RIOPREVIDÊNCIA, Banco do Brasil, Bradesco, BTG Pactual, Caixa, 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, Bradesco H FI RF Ref DI LP e Itaú Institucional DI que permite a alocação em títulos privados de baixo risco de crédito.

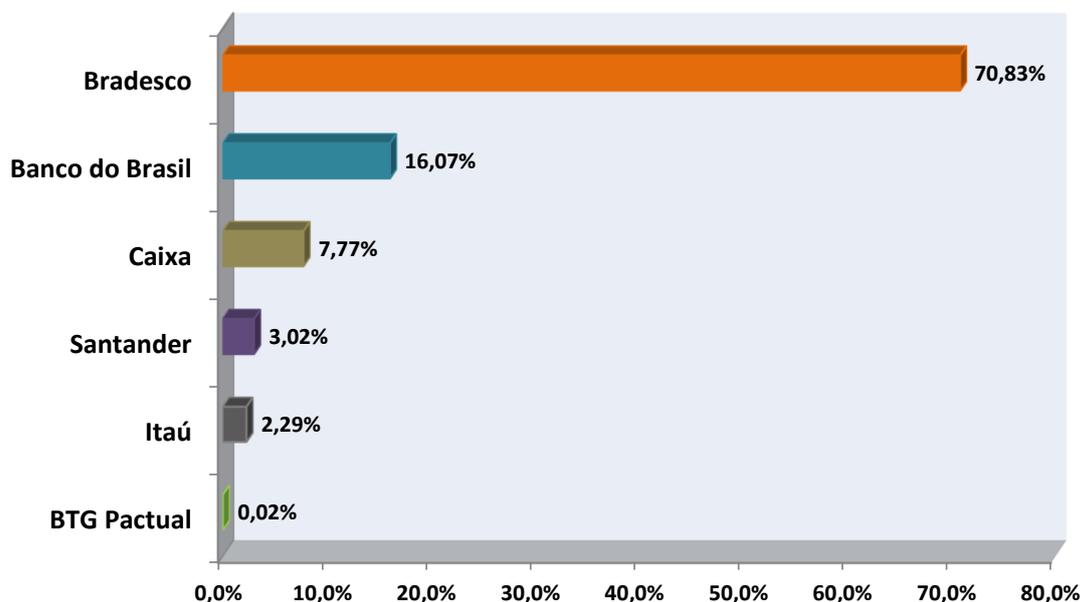
(II) Valor total do Ativo do Rioprevidência em 28/02/2017 (F. Financeiro + F. Previdenciário)

(III) Refere-se ao valor apurado em 28/02/2017.

(IV) Refere-se ao valor do ativo total apurado em 28/02/2017. (F. Financeiro + F. Previdenciário)

No mês de fevereiro, 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 fevereiro, as aplicações financeiras do Fundo Financeiro em Fundos de Investimento totalizaram R\$ 6.493.162,14.

COMITÊ DE INVESTIMENTO – FEVEREIRO 2017

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 08 de fevereiro de 2017, 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:

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	453.154.388
Fundos de Investimentos	
Fundos Referenciados DI	9.657.782
Fundos de Renda Fixa RF IMA/IDkA	443.496.607
Imóveis	0
Carteira Própria	0
TOTAL	453.154.388

ALOCAÇÃO DOS RECURSOS Fundos de Investimentos

FUNDO PREVIDENCIÁRIO					FEVEREIRO 2017			
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	7,82	0,42%	1.864,27	4,99	7,26	35,16	0,20
BB Perfil FIC Renda Fixa Previdenciário	BB DTVM	0,02	0,00%	4.816,40	0,89	2,00	13,85	0,20
BB Previdenciário RF Alocação Ativa	BB DTVM	11,12	1,03%	1.084,23	2,27	4,12	8,51	0,20
BB Previdenciário RF TP IPCA VI FI	BB DTVM	6,14	2,02%	304,15	2,60	3,98	19,73	0,20
BB TP X FI RF Previdenciário	BB DTVM	16,96	3,58%	474,15	2,56	3,99	19,14	0,20
BB TP XI FI RF Previdenciário	BB DTVM	16,41	9,80%	167,46	2,41	3,64	15,46	0,20
Bradesco Premium FI REF. DI	BRAM-Asset	1,49	0,02%	7.584,32	0,87	1,98	14,17	0,20
Caixa Brasil IMA B 5+ TP FI RF LP	Caixa	10,02	0,73%	1.371,67	4,97	7,26	34,89	0,20
Caixa Brasil FI Ref. DI LP	Caixa	1,27	0,02%	6.313,65	0,88	1,96	13,90	0,20
Caixa Brasil 2018 II TP FI RF	Caixa	86,12	2,80%	3.081,29	0,96	1,98	12,05	0,20
Caixa Brasil 2018 IV TP FI RF	Caixa	22,91	8,44%	271,31	0,96	1,98	12,10	0,20
Caixa Brasil 2020 III TP FI RF	Caixa	17,61	15,49%	113,65	1,88	3,13	14,63	0,20
Caixa Brasil 2020 IV TP FI RF	Caixa	33,03	3,69%	894,57	1,88	3,13	14,59	0,20
Caixa Brasil 2024 IV TP FI RF	Caixa	102,62	11,88%	864,12	3,22	5,05	22,58	0,20
Caixa Brasil 2024 VI TP FI RF	Caixa	27,56	15,94%	172,90	3,22	5,04	22,61	0,20
Caixa Brasil 2030 III TP FI RF	Caixa	49,65	20,47%	242,53	4,81	6,77	31,92	0,20
Itaú Institucional Alocação Dinâmica	Itaú	16,88	1,24%	1.361,59	2,55	4,73	23,39	0,40
Itaú Institucional Alocação Dinâmica II	Itaú	2,71	3,07%	88,27	2,54	4,70	-	0,40
Itaú Institucional FI RF REF. DI	Itaú	6,88	0,54%	1.284,91	0,87	1,96	13,96	0,18
Itaú Institucional TP Renda Fixa FI	Itaú	15,94	18,50%	86,15	1,49	2,65	6,95	0,20
TOTAL		453,15						

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

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.

COMPOSIÇÃO DAS APLICAÇÕES

FUNDO PREVIDENCIÁRIO

FEVEREIRO 2017

Posição Consolidada da Carteira	(R\$)	(% do total)
1 - Títulos Públicos Federais	419.628.348	92,6%
1.1 - Prefixados	0	0,0%
1.2 - Pós-fixados	951.385	0,2%
1.3 - NTN-B (IPCA)	410.805.417	90,7%
1.4 - Operações Compromissadas	7.871.545	1,7%
2 - Títulos Privados de Baixo Risco de Crédito (I)	2.821.782	0,6%
2.1 - CDB	378.389	0,1%
2.2 - Let. Financeira	2.092.114	0,5%
2.3 - Debêntures	278.009	0,1%
2.4 - DPGE	62.529	0,0%
2.5 - Outros Títulos	10.741	0,0%
3 - Cotas de Fundos (II)	30.701.262	6,8%
4 - Tesouraria (III)	2.996	0,0%
5 - Imóveis	0	0,0%
Total da Carteira	453.154.388	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., BB Prev. RF Alocação Ativa, Bradesco Premium DI, Itaú Institucional Alocação Dinâmica e Itaú Institucional Alocação Dinâmica II investido em outros fundos de investimento.

(III) Recursos mantidos em Tesouraria nos fundos investidos.

LIMITES DE CONCENTRAÇÃO

FUNDO PREVIDENCIÁRIO				FEVEREIRO 2017	
Posição da Carteira em 24/02/2017, 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>423.912.484</u>	<u>0,35%</u>	100,0%	Até 100,0%
Renda Fixa (II)	FI/FIC RF ou Referenciado (Art. 7º,IV)	<u>29.241.904</u>	<u>0,02%</u>	30,0%	Até 30,0%
Total Renda Fixa		<u>453.154.388</u>	<u>0,38%</u>		
Total do Ativo do Rioprevidência (III)		120.762.017.603			
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.

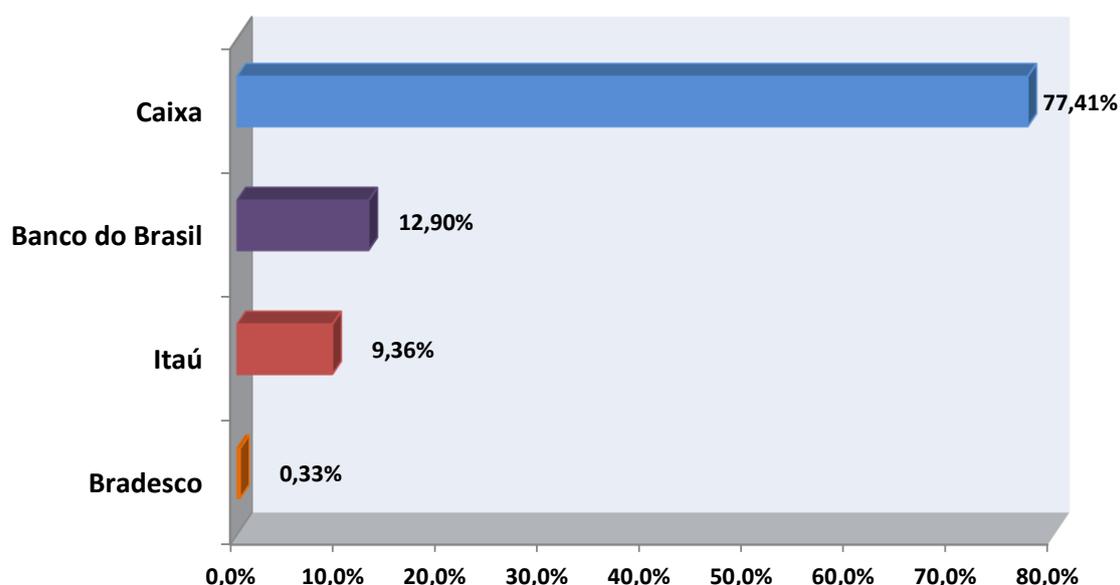
(II) Qualquer indicador de desempenho de Renda Fixa. Inclui valor em cotas dos Fundos Bradesco Premium DI, Caixa FI Brasil DI e Itaú Institucional DI que permite a alocação em títulos privados de baixo risco de crédito.

(III) Valor total do Ativo total apurado em 24/02/2017. (F Financeiro + F. Previdenciário)

(IV) Refere-se ao ativo total apurado em 24/02/2017. (F Financeiro + F. Previdenciário)

No mês de fevereiro, 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 fevereiro, as aplicações financeiras do Fundo Previdenciário em Fundos de Investimento totalizaram R\$ 453.154.388,10.

COMITÊ DE INVESTIMENTO – FEVEREIRO 2017

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 08 de fevereiro de 2017, 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 expectativa de continuidade da queda da inflação e 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).