

2017



Relatório Mensal de Investimentos

Fundos Financeiro e Previdenciário

Setembro



Diretoria de Investimentos

Reges Moisés dos Santos

Diretor Presidente

Gerência de Operações e Planejamento

Luciana Pinto Venâncio

Gerência de Operações e Planejamento

Kelli Manhães Pessanha

Coordenadoria de Operações e Planejamento

Bruno Luís Lacerda dos Santos

Assessoria de Planejamento e Orçamento

Equipe Técnica:

Alisson José Ramos Batista

Angela Maria Monteiro Pandolfo

Luana Abreu dos Santos Lourenço

Nicholas Ribeiro da Costa Cardoso

Rodrigo Santos Martins

Teresa Luiza da Silva Dias

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

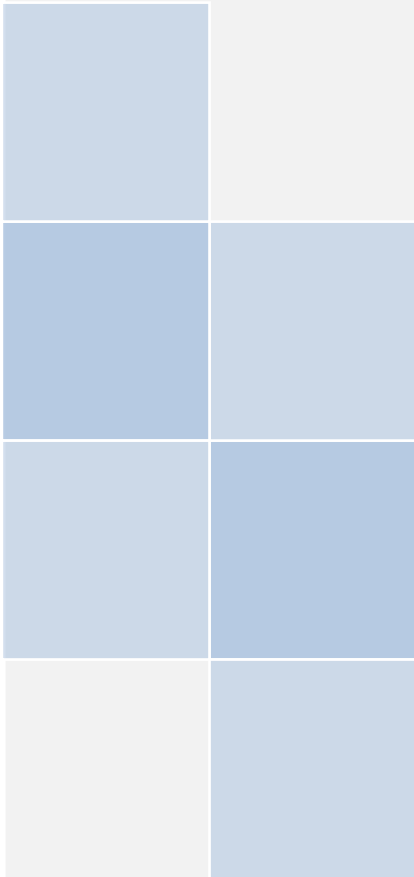
Rua da Quitanda nº 106

20091-005 – 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	10.241.298
Fundos de Investimentos	
Fundos Referenciados DI	10.241.298
Imóveis	278.532.482
Carteira Própria	278.532.482
TOTAL	288.773.780

ALOCAÇÃO DOS RECURSOS Fundos de Investimentos

FUNDO FINANCEIRO					SETEMBRO 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	1,97	0,21%	948,03	0,67	8,25	11,89	0,20
BB Títulos Públicos FI Ref. DI LP	BB DTVM	0,00	0,00%	4.784,10	0,64	8,04	11,50	0,10
Bradesco Premium FI Ref. DI	BRAM-Asset	1,32	0,01%	11.514,09	0,67	8,46	12,20	0,20
Bradesco H FI RF Ref. DI LP	BRAM-Asset	0,01	0,00%	5.888,76	0,64	8,09	11,59	0,15
BTG Pactual Tesouro Selic FI RF (*)	BTG P.- Asset	0,00	0,00%	645,81	0,63	8,07	11,50	0,20
Caixa Brasil FI Ref. DI LP	CAIXA	0,51	0,01%	5.872,21	0,63	8,06	11,56	0,20
Itaú Institucional FI RF Ref. DI	Itaú	6,21	0,44%	1.402,65	0,63	8,01	11,52	0,18
Santander Corporate FIC Ref. DI (*)	Sant.-Asset	0,21	0,00%	6.857,99	0,65	8,20	11,74	0,20
TOTAL		10,24						

Fonte: RIOPREVIDÊNCIA, Banco do Brasil, Bradesco, BTG Pactual, Caixa, 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 2017

Posição Consolidada da Carteira	(R\$)	(% do total)
1- Títulos Públicos Federais	7.201.317	2,5%
1.1 - Prefixados	1.707	0,0%
1.2 - Pós-fixados	1.506.959	0,5%
1.3 - Operações Compromissadas	5.692.651	2,0%
2- Títulos Privados de Baixo Risco de Crédito (I)	3.027.115	1,0%
3.1 - CDB	425.629	0,1%
3.2 - Let. Financeira	2.107.695	0,7%
3.3 - Debêntures	458.363	0,2%
3.4 - DPGE	32.456	0,0%
3.5 - Outros Títulos	2.972	0,0%
3- Cotas de Fundos (II)	12.774	0,0%
4- Tesouraria (III)	92	0,0%
5- Imóveis (IV)	278.532.482	96,5%
Total da Carteira	288.773.780	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 31/08/2017.

LIMITES DE CONCENTRAÇÃO

FUNDO FINANCEIRO				SETEMBRO 2017	
Posição da Carteira em 29/09/2017, por Limites do PAI e Resolução nº 3.922/10 e alterações					
Segmento	Tipo de Ativo/Enquadramento	Valores (R\$)	%	Limites PAI (% total)	Limite da Resolução nº 3.922/10
Renda Fixa	FI/FIC RF ou Referenciado (Art. 7º, IV, a)	<u>10.241.298</u>	<u>0,01%</u>	10,0%	Até 30,0%
Total Renda Fixa		<u>10.241.298</u>	<u>0,01%</u>		
Total do Ativo do Rioprevidência (I)		<u>117.949.572.542</u>			
Imóveis (II)	Terrenos e Edificações	<u>278.532.482</u>			

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

Glossário:

FI/FIC - Fundos de Investimento

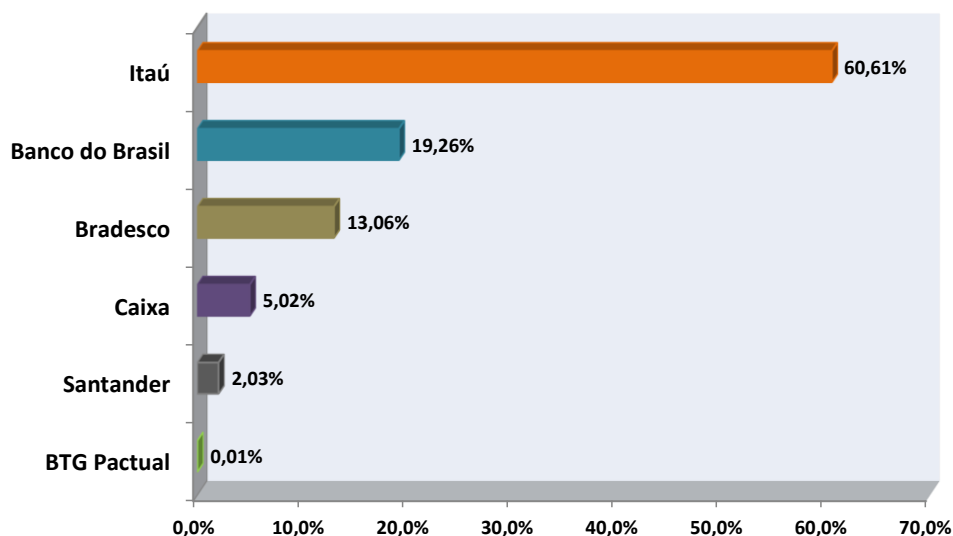
PAI - Plano Anual de Investimentos

(I) Valor total do Ativo do Rioprevidência em 31/08/2017 (F. Financeiro + F. Previdenciário)

(II) Refere-se ao valor apurado em 31/08/2017.

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\$ 10.241.297,86.

COMITÊ DE INVESTIMENTO – SETEMBRO 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 06 de setembro de 2017, 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	715.593.538
Fundos de Investimentos	
Fundos Referenciados DI	34.920.074
Fundos de Renda Fixa RF IMA	641.251.701
Fundos de Renda Fixa RF IDkA	39.421.762
Imóveis	0
Carteira Própria	0
TOTAL	715.593.538

ALOCAÇÃO DOS RECURSOS Fundos de Investimentos

FUNDO PREVIDENCIÁRIO					SETEMBRO 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	34,16	2,14%	1.599,60	2,32	14,08	16,64	0,20
BB Perfil FIC Renda Fixa Previdenciário	BB DTVM	11,81	0,28%	4.279,50	0,65	8,10	11,65	0,20
BB Previdenciário RF Alocação Ativa	BB DTVM	30,60	1,61%	1.898,09	1,32	11,39	14,30	0,30
BB Previdenciário RF TP IPCA VI FI	BB DTVM	6,50	2,02%	321,75	1,28	12,95	15,28	0,20
BB TP X FI RF Previdenciário	BB DTVM	17,92	3,58%	500,98	1,28	12,82	15,13	0,20
BB TP XI FI RF Previdenciário	BB DTVM	17,37	9,80%	177,24	1,22	12,68	15,04	0,20
BB Previdenciário RF IDKA 2 TP	BB DTVM	35,86	0,70%	5.133,99	0,86	10,29	12,73	0,20
Bradesco Premium FI Ref. DI	BRAM-Asset	21,63	0,19%	11.514,09	0,67	8,46	12,20	0,20
Bradesco FI RF IDKA PRÉ 2	BRAM-Asset	3,56	12,15%	29,34	1,51	13,54	17,76	0,20
Bradesco Institucional FIC de FI RF IMA-B	BRAM-Asset	26,35	8,70%	303,02	1,02	11,18	13,68	0,20
Caixa Brasil 2018 II TP FI RF	Caixa	89,15	2,80%	3.189,42	0,50	8,29	10,63	0,20
Caixa Brasil 2018 IV TP FI RF	Caixa	23,71	8,44%	280,84	0,50	8,28	10,68	0,20
Caixa Brasil 2020 III TP FI RF	Caixa	18,57	15,49%	119,87	1,12	11,42	13,81	0,20
Caixa Brasil 2020 IV TP FI RF	Caixa	34,83	3,69%	943,40	1,12	11,43	13,78	0,20
Caixa Brasil 2024 IV TP FI RF	Caixa	108,20	10,90%	992,67	1,46	13,42	15,48	0,20
Caixa Brasil 2024 VI TP FI RF	Caixa	29,06	15,94%	182,31	1,46	13,42	15,50	0,20
Caixa Brasil 2030 III TP FI RF	Caixa	51,22	20,47%	250,22	1,95	12,84	15,60	0,20
Caixa Brasil FI Ref. DI LP	Caixa	0,70	0,01%	5.872,21	0,63	8,06	11,56	0,20
Caixa Brasil IMA B 5+ TP FI RF LP	Caixa	44,98	3,43%	1.313,09	2,37	14,38	16,99	0,20
Itaú Institucional Alocação Dinâmica	Itaú	18,02	1,18%	1.524,89	1,51	11,79	15,04	0,40
Itaú Institucional Alocação Dinâmica II	Itaú	26,55	5,36%	494,91	1,51	11,77	-	0,40
Itaú Institucional TP Renda Fixa FI	Itaú	16,66	18,50%	90,05	0,73	7,29	6,38	0,20
Itaú Institucional FI RF Ref. DI	Itaú	0,78	0,06%	1.402,65	0,63	8,01	11,52	0,18
Itaú Institucional RF Inflação 5 FICFI	Itaú	5,27	0,28%	1.877,36	0,97	10,61	13,01	0,40
Safra Executive 2 FI RF	J. Safra Asset	42,13	12,74%	330,74	0,80	9,36	12,97	0,50
TOTAL		715,59						

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

Em setembro, a maior parcela das aplicações financeiras do FUNDO PREVIDENCIÁRIO se concentrou em cotas de Fundos de Renda Fixa – IMA e IDkA. Outra parte dos recursos está aplicada em cotas de Fundos de Investimento Referenciado DI.

COMPOSIÇÃO DAS APLICAÇÕES

FUNDO PREVIDENCIÁRIO

SETEMBRO 2017

Posição Consolidada da Carteira	(R\$)	(% do total)
1 - Títulos Públicos Federais	587.218.587	82,1%
1.1 - Prefixados	3.479.720	0,5%
1.2 - Pós-fixados	15.977.811	2,2%
1.3 - NTN-B (IPCA)	526.259.160	73,5%
1.4 - Operações Compromissadas	41.501.896	5,8%
2 - Títulos Privados de Baixo Risco de Crédito (I)	21.235.089	3,0%
2.1 - CDB	1.394.388	0,2%
2.2 - Let. Financeira	17.401.553	2,4%
2.3 - Debêntures	1.950.307	0,3%
2.4 - DPGE	377.362	0,1%
2.5 - Outros Títulos	111.480	0,0%
3 - Cotas de Fundos (II)	107.136.592	15,0%
4 - Tesouraria (III)	3.269	0,0%
5 - Imóveis	0	0,0%
Total da Carteira	715.593.538	100,0%

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

(I) Valor em Cotas dos Fundos BB Perfil FIC RF Prev., Bradesco Premium DI, Caixa FI Brasil DI, Itaú Institucional DI e Safra Executive 2 FI RF 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, Bradesco Institucional FIC de FI RF IMA-B 5, Itaú Institucional RF Referenciado DI, Itaú Institucional Alocação Dinâmica, Itaú Institucional Alocação Dinâmica II, Itaú Institucional RF Inflação 5 e Safra Executive 2 FI RF investido em outros fundos de investimento.

(III) Recursos mantidos em Tesouraria nos fundos investidos.

LIMITES DE CONCENTRAÇÃO

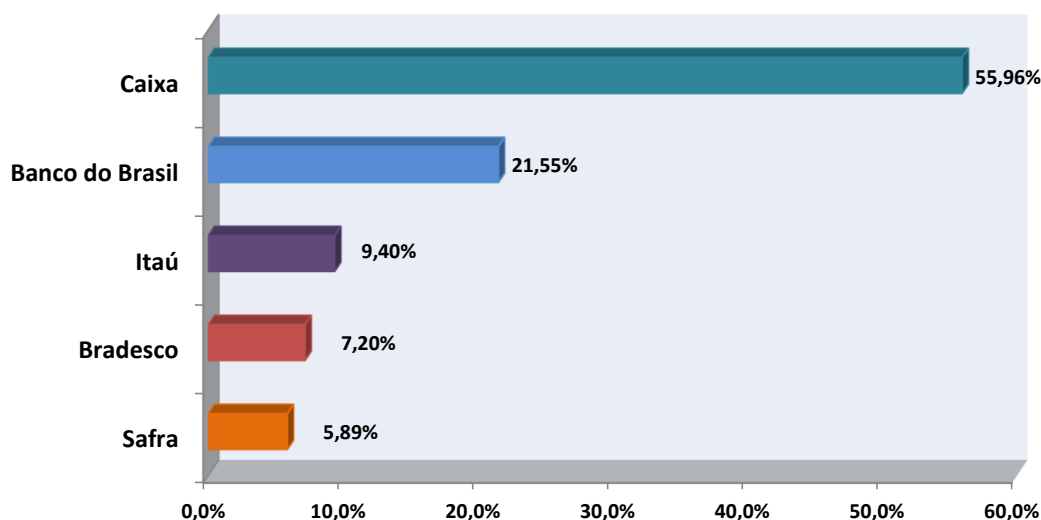
FUNDO PREVIDENCIÁRIO				SETEMBRO 2017	
Posição da Carteira em 29/09/2017, por Limites do PAI e Resolução nº 3.922/10 e alterações					
Segmento	Tipo de Ativo/Enquadramento	Valores (R\$)	%	Limites PAI (% total)	Limite da Resolução nº 3.922/10
Renda Fixa	FI 100% títulos TN (Art. 7º,I,b)	<u>564.059.999</u>	<u>0,48%</u>	100,0%	Até 100,0%
Renda Fixa	FI RF ou Referenciado (Art. 7º, III, a)	<u>72.046.548</u>	<u>0,06%</u>	80,0%	Até 80,0%
Renda Fixa	FI/FIC RF ou Referenciado (Art. 7º,IV,a)	<u>79.486.991</u>	<u>0,07%</u>	30,0%	Até 30,0%
Total Renda Fixa		<u>715.593.538</u>	<u>0,61%</u>		
Total do Ativo do Rioprevidência (I)		117.949.572.542			
Imóveis	Terrenos e Edificações	<u>0</u>			

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

(I) Valor total do Ativo total apurado em 31/08/2017. (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\$ 715.593.5370,63.

COMITÊ DE INVESTIMENTO – SETEMBRO 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 06 de setembro de 2017, 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 continuidade da queda da inflação e da redução dos juros (SELIC), propomos a alocação nos seguintes segmentos:

- Fundos Estratégia Mista (CDI, IRFM e IMA);
- Fundos Inflação (IMA/IDKA);
- Fundos Pré Fixados (IRFM);
- Fundos DI.