

2018



Relatório Mensal de Investimentos

Fundos Financeiro e Previdenciário

Janeiro



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

Flávio Carramanhos Werneck

Nícolás Ribeiro da Costa Cardoso

Rodrigo Santos Martins

Pedro Daflon Fraiz

Priscila Ramalho do Valle Gonçalves

Teresa Luiza da Silva Dias

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

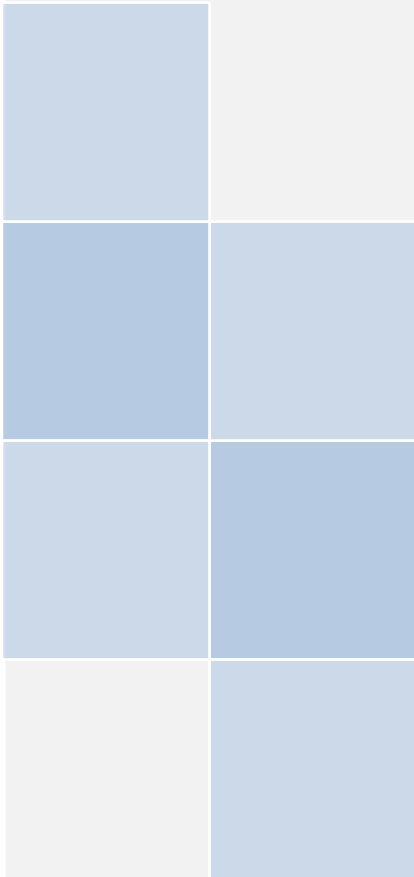
Rua da Quitanda nº 106

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	115.765.557
Fundos de Investimentos	
Fundos Referenciados DI	115.765.557
Imóveis*	288.507.118
Carteira Própria	288.507.118
TOTAL	404.272.675

* Mês de referência: Dezembro/2017

ALOCAÇÃO DOS RECURSOS Fundos de Investimentos

FUNDO FINANCEIRO					JANEIRO 2018			
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	10,74	1,00%	1.078,53	0,57	0,57	9,61	0,20
BB RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS FI REFERENCIADO DI LP	BB DTVM	0,00	0,00%	5.205,59	0,57	0,57	9,38	0,10
BRANCO FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	BRAM-Asset	4,95	0,09%	5.801,18	0,57	0,57	9,35	0,15
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	BRAM-Asset	4,14	0,04%	9.348,52	0,57	0,57	9,79	0,20
BRANCO H FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	BRAM-Asset	0,01	0,00%	5.786,75	0,57	0,57	9,39	0,15
BTG PACTUAL TESOUREIRO SELIC FUNDO DE INVESTIMENTO RF (*)	BTG P.- Asset	0,00	0,00%	1.218,02	0,56	0,56	9,38	0,20
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	CAIXA	0,47	0,01%	6.349,47	0,57	0,57	9,39	0,20
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	Itaú	95,24	6,89%	1.382,55	0,57	0,57	9,33	0,18
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI (*)	Sant.-Asset	0,21	0,00%	6.788,32	0,58	0,58	9,54	0,20
TOTAL		115,77						

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

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

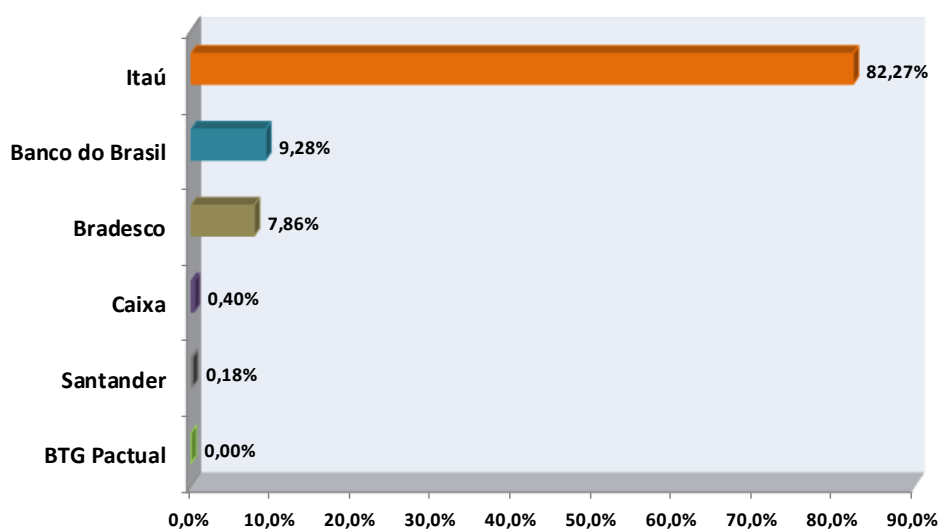
Em janeiro, as aplicações financeiras do FUNDO FINANCEIRO se concentraram em cotas de Fundos de Investimento Referenciado DI, cujos lastros são predominantemente títulos públicos federais.

COMPOSIÇÃO DAS APLICAÇÕES

Posição Consolidada da Carteira dos Fundos de Investimentos		
Renda Fixa	Valor em R\$ (mil)	% (do total)
Títulos Públicos Federais		
Prefixados	1.826	0,0%
Pós-fixados	12.009.818	10,4%
Operações Compromissadas	73.507.356	63,5%
Subtotal	85.519.000	73,9%
Títulos Privados		
CDB	6.119.211	5,3%
Letra Financeira	17.505.174	15,1%
Debênture	5.858.016	5,1%
DPGE	176.157	0,2%
Nota Comercial	374.653	0,3%
CRA	148.936	0,1%
Letra de Câmbio	10.541	
Subtotal	30.192.687	26,1%
Cotas de Fundos	53.785	0,0%
Tesouraria (Fundos)	85	0,0%
Total	115.765.557	100,0%

Base: Janeiro/2018

DISTRIBUIÇÃO DAS CARTEIRAS DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA



No encerramento do mês de janeiro, as aplicações financeiras do Fundo Financeiro em Fundos de Investimento totalizaram R\$ 115.765.556,83

COMITÊ DE INVESTIMENTO – JANEIRO 2018

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 25 de janeiro de 2018, na Sede Administrativa, à Rua da Quitanda nº 106 – Centro - Rio de Janeiro, foi aprovada a seguinte proposta para o mês de janeiro:

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 e 4.604/2017.



Fundo Previdenciário



FUNDO PREVIDENCIÁRIO**CARTEIRA GLOBAL**

Segmento	Valor
Renda Fixa	752.154.511
Fundos de Investimentos	
Fundos Referenciados DI	11.991.541
Fundos de Renda Fixa RF IMA	602.229.207
Fundos de Renda Fixa RF IDkA	137.933.763
Imóveis	0
Carteira Própria	0
TOTAL	752.154.511

ALOCAÇÃO DOS RECURSOS Fundos de Investimentos

FUNDO PREVIDENCIÁRIO						JANEIRO 2018		
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+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	BB DTVM	2,61	0,26%	998,55	0,57	0,57	15,19	0,20
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	BB DTVM	2,04	0,05%	4.091,38	0,57	0,57	9,51	0,20
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA	BB DTVM	31,37	1,45%	2.168,16	1,72	1,72	12,17	0,30
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	BB DTVM	6,67	2,02%	330,50	2,05	2,05	14,47	0,20
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	BB DTVM	18,40	3,58%	514,47	2,00	2,00	14,27	0,20
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	BB DTVM	17,84	9,80%	182,10	1,78	1,78	14,39	0,20
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS	BB DTVM	119,85	2,13%	5.633,82	0,96	0,96	12,27	0,20
BRADESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	BRAM-Asset	2,46	0,03%	9.348,52	0,57	0,57	9,79	0,20
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IDKA PRÉ 2	BRAM-Asset	18,08	13,41%	134,87	0,79	0,79	14,32	0,20
BRADESCO INSTITUCIONAL FICFI RENDA FIXA IMA-B 5	BRAM-Asset	27,06	6,93%	390,67	1,32	1,32	12,82	0,20
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Caixa	91,50	2,80%	3.273,58	1,05	1,05	9,90	0,20
CAIXA BRASIL 2018 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Caixa	24,34	8,44%	288,23	1,04	1,04	9,88	0,20
CAIXA BRASIL 2020 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Caixa	19,06	15,49%	123,02	1,01	1,01	12,83	0,20
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Caixa	35,75	3,69%	968,31	1,01	1,01	12,83	0,20
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Caixa	111,08	10,90%	1.019,09	3,05	3,05	14,27	0,20
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Caixa	29,83	15,94%	187,15	3,05	3,05	14,26	0,20
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Caixa	53,04	20,47%	259,11	4,46	4,46	14,51	0,20
CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	Caixa	4,76	0,08%	6.349,47	0,57	0,57	9,39	0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TITULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LP	Caixa	10,50	1,14%	918,92	4,91	4,91	15,45	0,20
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RENDA FIXA FICFI	Itaú	18,46	1,25%	1.473,93	1,49	1,49	12,18	0,40
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II RENDA FIXA FICFI	Itaú	34,43	3,82%	902,05	1,49	1,49	12,16	0,40
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Itaú	16,68	18,50%	90,17	0,78	0,78	6,22	0,20
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI - FI	Itaú	2,74	0,20%	1.382,55	0,57	0,57	9,33	0,18
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLAÇÃO 5 - FICFI	Itaú	5,41	0,31%	1.750,42	1,30	1,30	12,33	0,40
SAFRA EXECUTIVE 2 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	J. Safra Asset	48,19	13,57%	355,12	0,57	0,57	10,42	0,50
TOTAL		752,15						

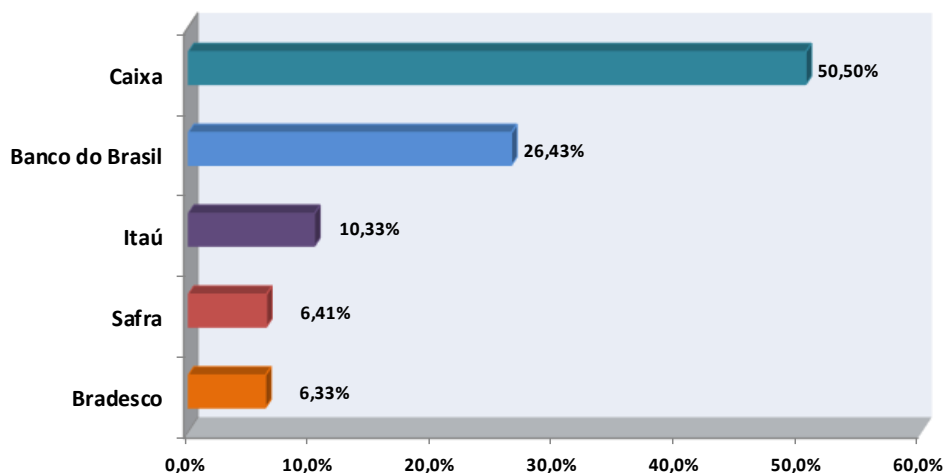
Fonte: RIOPREVIDÊNCIA, Bradesco, Banco do Brasil, Caixa, Itaú e Safra.

Em janeiro, 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

Posição Consolidada das Carteiras dos Fundos de Investimentos		
Renda Fixa	Valor em R\$ (mil)	% (do total)
Títulos Públicos Federais		
Prefixados	17.444.878	2,3%
Pós-fixados	12.656.800	1,7%
NTN-B (IPCA)	554.707.315	73,7%
Operações Compromissadas	33.616.463	4,5%
Subtotal	618.425.456	82,2%
Títulos Privados		
CDB	1.109.116	0,1%
Letra Financeira	13.741.698	1,8%
Debênture	1.625.125	0,2%
DPGE	190.166	0,0%
Nota Comercial	221.032	0,0%
Letra Hipotecária	43.613	0,0%
Letra de Câmbio	11.379	0,0%
Subtotal	16.942.129	2,3%
Cotas de Fundos	116.783.431	15,5%
Tesouraria (Fundos)	3.495	0,0%
Total	752.154.511	100,0%
<i>Base: Dezembro/2017</i>		

DISTRIBUIÇÃO DAS CARTEIRAS DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA



No encerramento do mês de janeiro, as aplicações financeiras do Fundo Previdenciário em Fundos de Investimento totalizaram R\$ 752.154.510,77.

COMITÊ DE INVESTIMENTO – JANEIRO 2018

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 25 de janeiro de 2018, na Sede Administrativa, à Rua da Quitanda nº 106 – Centro - Rio de Janeiro, foi aprovada a seguinte proposta para o mês de janeiro:

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.

NOTA SOBRE ALTERAÇÃO DA RESOLUÇÃO SOBRE APLICAÇÕES DOS REGIMES PRÓPRIOS DE PREVIDÊNCIA

No dia 19/10/2017, por meio da Resolução CMN 4.604, o Conselho Monetário Nacional alterou a Resolução CMN nº 3.922, de 25 de novembro de 2010, que dispõe sobre as aplicações dos recursos dos Regimes Próprios de Previdência Social - RPPS instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios.

Para fins de cômputo dos limites, de acordo com o artigo 6º da Resolução, foram excluídos:

- os ativos vinculados por lei ao regime próprio de previdência social;
- demais bens, direitos e ativos com finalidade previdenciária do regime próprio de previdência social.

Desta forma, os recursos referentes aos ativos: Royalties de Petróleo e FUNDES, que antes eram considerados para fins de cálculo de limites das aplicações, serão excluídos.

Os limites serão apurados da forma apresentada abaixo, somando-se as aplicações financeiras dos Fundos Financeiro e Previdenciário:

				Posição: 31/01/2018
Segmento	Enquadramento	%	Limites PAI (% total)	Limites da Resolução nº 3.922/10 e alterações
Renda Fixa	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b"	68,4%	100,0%	100,0%
Renda Fixa	FI RF Referenciado - Art. 7º, III, "a"	13,2%	60,0%	60,0%
Renda Fixa	FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV, "a"	18,3%	40,0%	40,0%
Total dos Recursos:				867.920.067,60

Observações:

- No dia 09 de janeiro de 2018, a Secretaria de Previdência do Ministério da Fazenda (Coordenação-Geral de Auditoria, Atuária, Contabilidade e Investimentos – CGACI) disponibilizou em seu site planilha de Enquadramento dos Fundos de Investimentos. Alguns fundos de investimentos tiveram a classificação alterada.