

2018



Relatório Mensal de Investimentos

Fundos Financeiro e Previdenciário

Abril



Diretoria de Investimentos

Reges Moisés dos Santos

Diretor Presidente

Gerência de Operações e Planejamento

Kelli Manhães Pessanha

Gerência de Operações e Planejamento

Rodrigo Santos Martins

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

Michelle Caldas Bouhid

Nícolas Ribeiro da Costa Cardoso

Pedro Daflon Fraiz

Priscila Ramalho do Valle Gonçalves

Teresa Luiza da Silva Dias

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

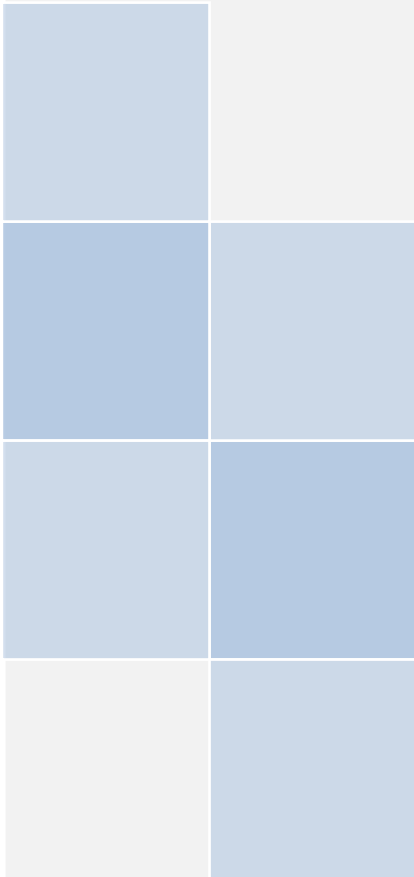
Rua da Quitanda nº 106

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	645.205.328
Fundos de Investimentos	
Fundos Referenciados DI	645.205.328
Imóveis*	289.262.866
Carteira Própria	289.262.866
TOTAL	934.468.195

* Mês de referência: Abril/2018

ALOCAÇÃO DOS RECURSOS **Fundos de Investimentos**

FUNDO FINANCEIRO					ABRIL 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	0,85	0,07%	1.225,47	0,51	2,12	8,27	0,20
BB RENDA FIXA TITULOS PUBLICOS FI REFERENCIADO DI LP	BB DTVM	0,00	0,00%	5.856,52	0,51	2,08	8,08	0,10
BRADESCO FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	BRAM-Asset	176,67	2,61%	6.772,40	0,50	2,05	8,04	0,15
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	BRAM-Asset	208,40	2,35%	8.876,38	0,51	2,11	8,36	0,20
BRADESCO H FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	BRAM-Asset	0,01	0,00%	5.670,67	0,50	2,05	8,05	0,15
BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FUNDO DE INVESTIMENTO RF (*)	BTG P.- Asset	0,00	0,00%	995,32	0,50	2,03	8,05	0,20
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	CAIXA	105,35	1,72%	6.126,34	0,51	2,05	8,01	0,20
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	Itaú	153,71	11,60%	1.324,56	0,50	2,06	7,99	0,18
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI (*)	Sant.-Asset	0,22	0,00%	6.915,76	0,51	2,10	8,20	0,20
TOTAL		645,21						

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

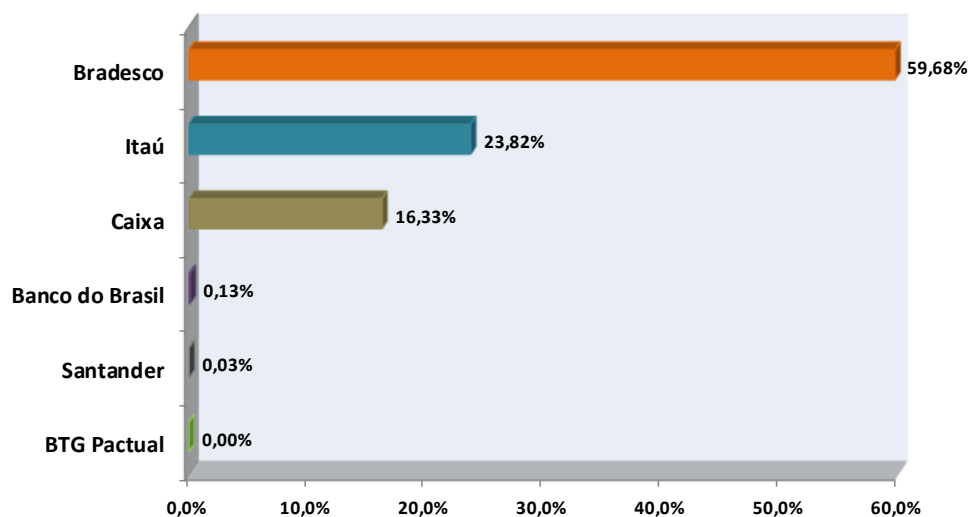
(*) - Valores bloqueados, em verificação pelo Rioprevidência.

Em abril, 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\$	% (do total)
Títulos Públicos Federais		
Prefixados	2.252	0,0%
Pós-fixados	254.500.667	39,4%
Operações Compromissadas	249.282.761	38,6%
Subtotal	503.785.679	78,1%
Títulos Privados		
CDB	36.785.915	5,7%
Letra Financeira	78.137.231	12,1%
Debênture	23.143.753	3,6%
DPGE	485.480	0,1%
Nota Comercial	1.561.969	0,2%
CRA	620.786	0,1%
Letra de Câmbio	43.916	0,0%
Subtotal	140.779.049	21,8%
Cotas de Fundos	640.409	0,1%
Tesouraria (Fundos)	191	0,0%
Total	645.205.328	100,0%
<i>Base: Abril/2018</i>		

DISTRIBUIÇÃO DAS CARTEIRAS DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA



No encerramento do mês de abril, as aplicações financeiras do Fundo Financeiro em Fundos de Investimento totalizaram R\$ 645.205.328,36.

COMITÊ DE INVESTIMENTO – ABRIL 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 04 de abril de 2018, na Sede Administrativa, à Rua da Quitanda nº 106 – Centro - Rio de Janeiro, foi aprovada a seguinte proposta para o mês de abril:

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	876.300.657
Fundos de Investimentos	
Fundos Referenciados DI	115.843.177
Fundos de Renda Fixa RF IMA	632.646.806
Fundos de Renda Fixa RF IDkA	127.810.674
Imóveis	0
Carteira Própria	0
TOTAL	876.300.657

ALOCAÇÃO DOS RECURSOS Fundos de Investimentos

FUNDO PREVIDENCIÁRIO						ABRIL 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 PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	BB DTVM	5,26	0,13%	3.983,42	0,52	2,11	8,19	0,20
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA	BB DTVM	37,65	1,28%	2.942,43	0,22	3,75	10,15	0,30
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	BB DTVM	6,68	2,02%	330,78	0,14	4,86	12,58	0,20
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	BB DTVM	18,43	3,58%	515,11	0,23	4,85	12,46	0,20
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	BB DTVM	17,86	9,80%	182,24	0,19	4,62	12,59	0,20
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS	BB DTVM	125,30	1,96%	6.381,52	0,69	3,75	11,42	0,20
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LP FIC DE FI	BB DTVM	18,06	0,78%	2.311,19	0,40	3,89	11,47	0,20
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS	BB DTVM	18,07	0,30%	6.009,70	0,43	4,18	12,49	0,20
BB RENDA FIXA TITULOS PUBLICOS FI REFERENCIADO DI LP	BB DTVM	50,04	0,85%	5.856,52	0,51	2,08	8,08	0,10
BRANCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	BRAM-Asset	4,16	0,05%	8.876,38	0,51	2,11	8,36	0,20
BRANCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IDKA PRÉ 2	BRAM-Asset	2,51	1,41%	177,84	0,70	4,53	14,14	0,20
BRANCO INSTITUCIONAL FICFI RENDA FIXA IMA-B 5	BRAM-Asset	2,77	0,49%	563,08	0,39	3,98	11,59	0,20
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Caixa	90,16	2,80%	3.225,73	0,42	2,26	8,08	0,20
CAIXA BRASIL 2018 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Caixa	23,98	8,44%	284,03	0,41	2,26	8,07	0,20
CAIXA BRASIL 2020 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Caixa	19,18	15,49%	123,78	0,93	4,22	11,86	0,20
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Caixa	35,97	3,69%	974,16	0,93	4,22	11,88	0,20
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Caixa	110,87	10,90%	1.017,14	-0,29	5,44	12,09	0,20
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Caixa	29,78	15,94%	186,81	-0,29	5,44	12,08	0,20
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Caixa	52,11	20,47%	254,57	-0,33	5,18	10,78	0,20
CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	Caixa	39,74	0,65%	6.126,34	0,51	2,05	8,01	0,20
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RENDA FIXA FICFI	Itaú	18,85	1,26%	1.496,21	0,33	3,62	10,00	0,40
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II RENDA FIXA FICFI	Itaú	60,60	4,42%	1.370,02	0,33	3,64	10,01	0,40
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Itaú	16,97	18,50%	91,73	0,39	2,53	4,06	0,20
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI - FI	Itaú	16,64	1,26%	1.324,56	0,50	2,06	7,99	0,18
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLAÇÃO 5 - FICFI	Itaú	5,54	0,34%	1.629,75	0,39	3,83	11,20	0,40
SAFRA EXECUTIVE 2 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	J. Safra Asset	49,11	11,06%	443,89	0,53	2,50	9,20	0,50
TOTAL		876,30						

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

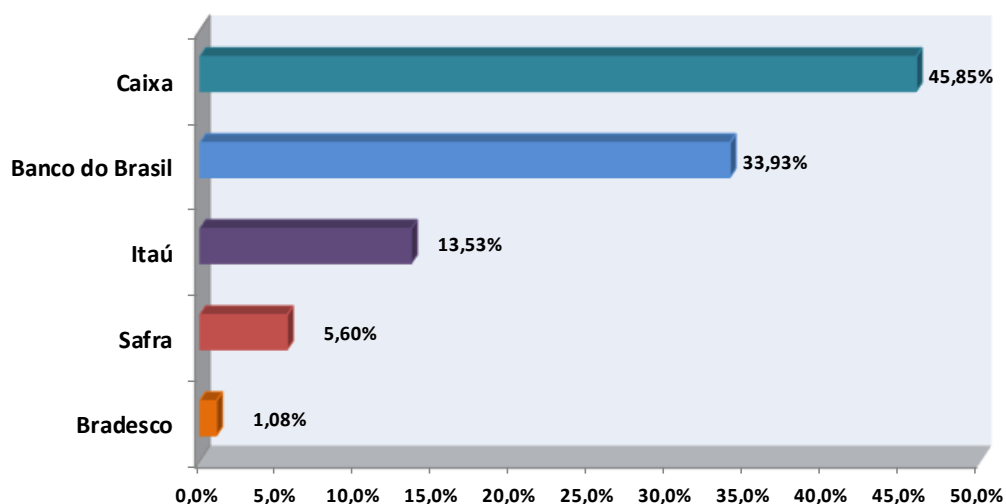
Em abril, a maior parcela das aplicações financeiras do FUNDO PREVIDENCIÁRIO se concentrou em cotas de Fundos de Renda Fixa – IMA e IDkA. Outra parte dos recursos está aplicada em cotas de Fundos de Investimento Referenciado DI.

COMPOSIÇÃO DAS APLICAÇÕES

Posição Consolidada das Carteiras dos Fundos de Investimentos		
Renda Fixa	Valor em R\$	% (do total)
Títulos Públicos Federais		
Prefixados	12.155.373	1,4%
Pós-fixados	52.038.400	5,9%
NTN-B (IPCA)	562.701.791	64,2%
Operações Compromissadas	94.043.243	10,7%
Subtotal	720.938.807	82,3%
Títulos Privados		
CDB	2.077.009	0,2%
Letra Financeira	24.206.351	2,8%
Debênture	2.785.480	0,3%
DPGE	230.246	0,0%
Nota Comercial	403.117	0,0%
Letra Hipotecária	73.588	0,0%
Letra de Câmbio	20.828	0,0%
Subtotal	29.796.618	3,4%
Cotas de Fundos	125.562.253	14,3%
Tesouraria (Fundos)	2.979	0,0%
Total	876.300.657	100,0%

Base: Abril/2018

DISTRIBUIÇÃO DAS CARTEIRAS DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA



No encerramento do mês de abril, as aplicações financeiras do Fundo Previdenciário em Fundos de Investimento totalizaram R\$ 876.300.656,73.

COMITÊ DE INVESTIMENTO – ABRIL 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 04 de abril de 2018, na Sede Administrativa, à Rua da Quitanda nº 106 – Centro - Rio de Janeiro, foi aprovada a seguinte proposta para o mês de abril:

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.

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.

				Posição: 30/04/2018
Segmento	Enquadramento	%	Limites PAI (% total)	Limites da Resolução nº 3.922/10 e alterações
Renda Fixa	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b"	43,3%	100,0%	100,0%
Renda Fixa	FI RF Referenciado - Art. 7º, III, "a"	46,3%	60,0%	60,0%
Renda Fixa	FI Renda Fixa Geral - Art. 7º, IV, "a"	10,4%	40,0%	40,0%
Total dos Recursos:				1.521.505.985,09

- No dia 02 de maio de 2018 (data-base: 30/04/2018), a Secretaria de Previdência do Ministério da Fazenda (Coordenação-Geral de Auditoria, Atuária, Contabilidade e Investimentos – CGACI) disponibilizou em seu site nova planilha de Enquadramento dos Fundos de Investimentos. A maior parte dos fundos de investimentos tiveram a classificação alterada, ocasionando desenquadramento de limites. A Gerência de Operações e Planejamento (GOP), tão logo, providenciou o enquadramento, realocando os recursos aplicados nos fundos no mês de maio.

				Posição: 30/04/2018
Segmento	Enquadramento	%	Limites PAI (% total)	Limites da Resolução nº 3.922/10 e alterações
Renda Fixa	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b"	44,5%	100,0%	100,0%
Renda Fixa	FI RF Referenciado - Art. 7º, III, "a"	0,0%	60,0%	60,0%
Renda Fixa	FI Renda Fixa Geral - Art. 7º, IV, "a"	55,5%	40,0%	40,0%
Total dos Recursos:				1.521.505.985,09