

2018



Relatório Mensal de Investimentos

Fundos Financeiro e Previdenciário

Maio



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

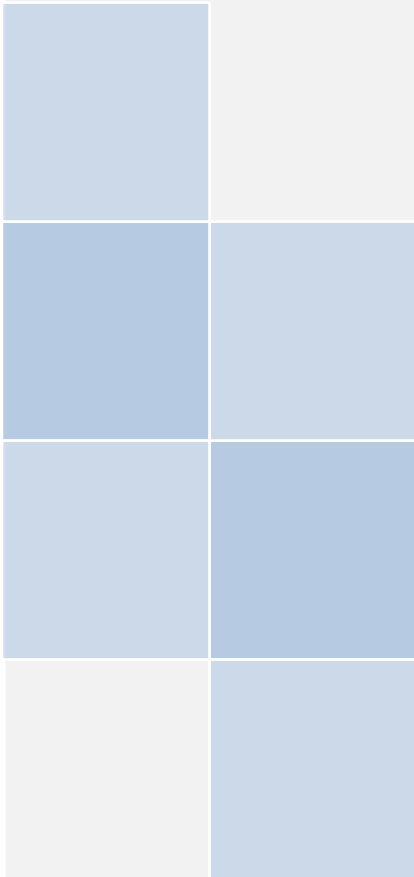
Rua da Quitanda nº 106

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	1.114.941.878
Fundos de Investimentos	
Fundos Referenciados DI	1.114.941.878
Imóveis*	334.564.644
Carteira Própria	334.564.644
TOTAL	1.449.506.522

* Mês de referência: Maio/2018

ALOCAÇÃO DOS RECURSOS Fundos de Investimentos

FUNDO FINANCEIRO					MAIO 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	0,73	0,06%	1.227,14	0,51	2,64	7,79	0,20
BB RENDA FIXA TITULOS PUBLICOS FI REFERENCIADO DI LP	BB DTVM	848,72	12,66%	6.703,73	0,50	2,59	7,63	0,10
BRANCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA REFERENCIADO DI FEDERAL	BRAM-Asset	2,74	0,04%	6.704,36	0,49	2,55	7,59	0,15
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	BRAM-Asset	88,49	1,00%	8.865,67	0,50	2,62	7,90	0,20
BRANCO H FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	BRAM-Asset	0,01	0,00%	5.608,45	0,50	2,56	7,59	0,15
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FUNDO DE INVESTIMENTO RF (*)	BTG P.- Asset	0,00	0,00%	1.075,11	0,47	2,51	7,56	0,20
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	CAIXA	41,69	0,65%	6.383,51	0,50	2,56	7,55	0,20
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	Itaú	132,33	10,62%	1.245,70	0,51	2,58	7,54	0,18
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI (*)	Sant.-Asset	0,22	0,00%	6.823,04	0,50	2,61	7,73	0,20
TOTAL		1.114,94						

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

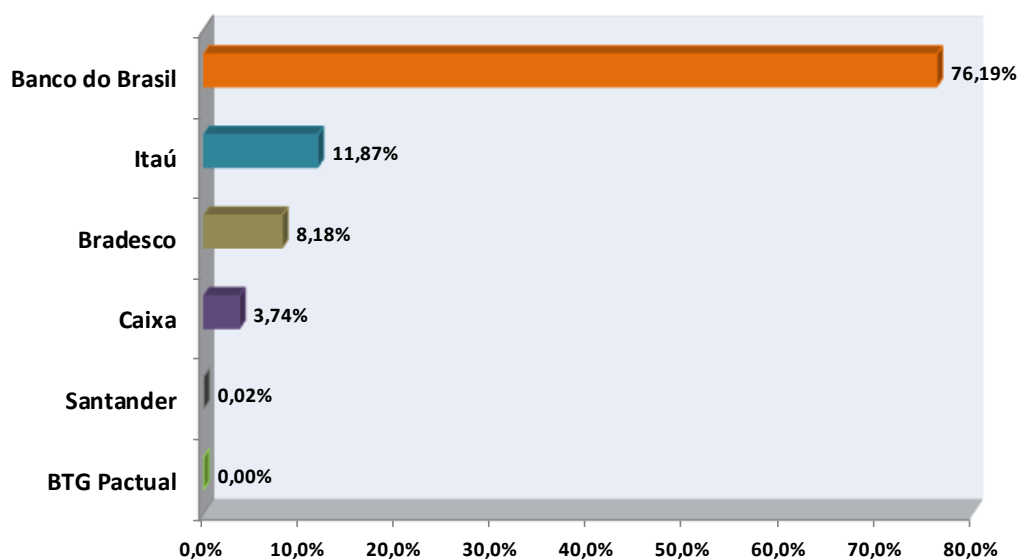
Em maio, as aplicações financeiras do FUNDO FINANCEIRO se concentraram em cotas de Fundos de Investimento Referenciado DI, cujos lastros são predominantemente títulos públicos federais.

COMPOSIÇÃO DAS APLICAÇÕES

Posição Consolidada da Carteira dos Fundos de Investimentos		
Renda Fixa	Valor em R\$	% (do total)
Títulos Públicos Federais		
Prefixados	2.810	0,0%
Pós-fixados	449.162.525	40,3%
Operações Compromissadas	584.364.613	52,4%
Subtotal	<u>1.033.529.948</u>	<u>92,7%</u>
Títulos Privados		
CDB	21.893.649	2,0%
Letra Financeira	42.411.685	3,8%
Debênture	15.375.797	1,4%
DPGE	238.586	0,0%
Nota Comercial	857.072	0,1%
CRA	340.635	0,0%
Letra de Câmbio	24.094	0,0%
Subtotal	<u>81.141.518</u>	<u>7,3%</u>
Cotas de Fundos	<u>268.807</u>	<u>0,0%</u>
Tesouraria (Fundos)	<u>1.604</u>	<u>0,0%</u>
Total	<u>1.114.941.878</u>	<u>100,0%</u>

Base: Maio/2018

DISTRIBUIÇÃO DAS CARTEIRAS DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA



No encerramento do mês de maio, as aplicações financeiras do Fundo Financeiro em Fundos de Investimento totalizaram R\$ 1.114.941.878,08.

COMITÊ DE INVESTIMENTO – MAIO 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 09 de maio de 2018, na Sede Administrativa, à Rua da Quitanda nº 106 – Centro - Rio de Janeiro, foi aprovada a seguinte proposta para o mês de maio:

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	881.328.484
Fundos de Investimentos	
Fundos Referenciados DI	276.127.163
Fundos de Renda Fixa RF IMA	528.590.426
IMA-B 5	193.244.643
IMA-B 5+	186.056.274
IMA-Geral	98.282.347
IRF-M 1	49.168.125
IRF-M	1.839.036
Fundos de Renda Fixa RF IDkA	76.610.895
IDKA PRÉ 2	2.486.014
IDKA IPCA 2A	74.124.881
Imóveis	0
Carteira Própria	0
TOTAL	881.328.484

ALOCAÇÃO DOS RECURSOS Fundos de Investimentos

FUNDO PREVIDENCIÁRIO					MAIO 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	5,29	0,13%	4.020,02	0,51	2,63	7,75	0,20
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA	BB DTVM	7,31	0,23%	3.133,79	-1,34	2,36	9,07	0,30
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	BB DTVM	6,49	2,02%	321,60	-2,78	1,95	9,82	0,20
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	BB DTVM	17,98	3,58%	502,50	-2,45	2,28	9,99	0,20
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	BB DTVM	17,36	9,80%	177,16	-2,78	1,71	9,82	0,20
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS	BB DTVM	74,12	1,15%	6.458,77	-0,84	2,87	10,05	0,20
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LP FIC DE FI	BB DTVM	1,81	0,08%	2.288,65	-1,57	2,26	9,62	0,20
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS	BB DTVM	1,84	0,03%	5.820,26	-1,86	2,25	10,13	0,20
BB RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS FI REFERENCIADO DI LP	BB DTVM	81,52	1,22%	6.703,73	0,50	2,59	7,63	0,10
BRADESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	BRAM-Asset	132,59	1,50%	8.865,67	0,50	2,62	7,90	0,20
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IDKA PRÉ 2	BRAM-Asset	2,49	0,94%	265,32	-0,91	3,57	12,41	0,20
BRADESCO INSTITUCIONAL FICFI RENDA FIXA IMA-B 5	BRAM-Asset	2,73	0,49%	559,14	-1,72	2,20	9,63	0,20
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Caixa	90,88	2,80%	3.251,53	0,80	3,06	8,13	0,20
CAIXA BRASIL 2018 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Caixa	24,18	8,44%	286,30	0,80	3,06	8,12	0,20
CAIXA BRASIL 2020 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Caixa	19,02	15,49%	122,77	-0,81	3,39	10,96	0,20
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Caixa	35,67	3,69%	966,26	-0,81	3,40	10,97	0,20
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Caixa	107,19	10,90%	983,40	-3,32	2,03	8,98	0,20
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Caixa	28,79	15,94%	180,61	-3,32	2,03	8,96	0,20
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Caixa	50,07	20,47%	244,60	-3,91	1,16	8,09	0,20
CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	Caixa	39,94	0,63%	6.383,51	0,50	2,56	7,55	0,20
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RENDA FIXA FICFI	Itaú	18,78	1,26%	1.490,37	-0,35	3,26	10,86	0,40
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II RENDA FIXA FICFI	Itaú	30,36	1,84%	1.646,46	-0,34	3,28	10,87	0,40
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Itaú	16,50	18,50%	89,18	-2,78	-0,32	3,65	0,20
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI - FI	Itaú	16,78	1,35%	1.245,70	0,51	2,58	7,54	0,18
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLAÇÃO 5 - FICFI	Itaú	2,46	0,16%	1.549,18	-1,59	2,18	9,40	0,40
SAFRA EXECUTIVE 2 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	J. Safra Asset	49,17	11,08%	443,94	0,11	2,61	8,51	0,50
TOTAL		881,33						

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

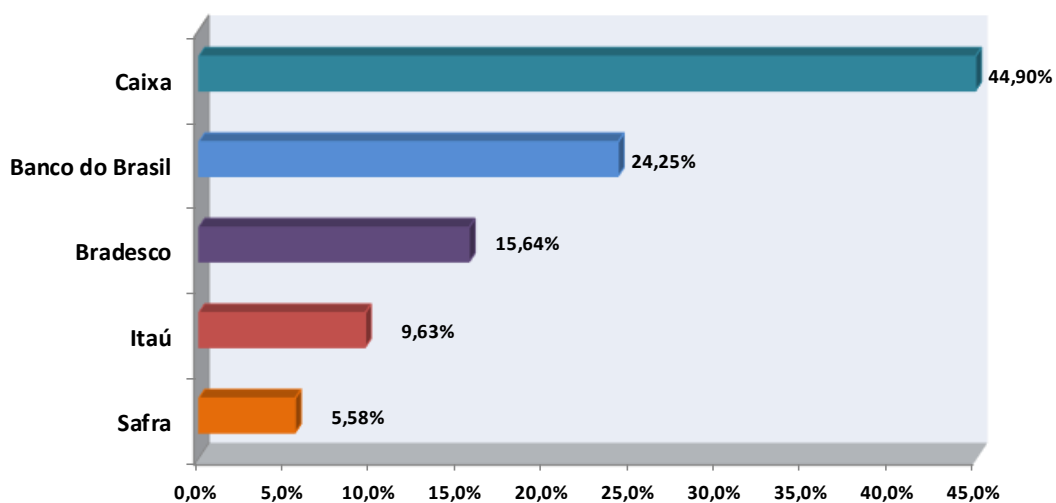
Em maio, a maior parcela das aplicações financeiras do FUNDO PREVIDENCIÁRIO se concentrou em cotas de Fundos de Renda Fixa – IMA e IDkA. Outra parte dos recursos está aplicada em cotas de Fundos de Investimento Referenciado DI.

COMPOSIÇÃO DAS APLICAÇÕES

Posição Consolidada das Carteiras dos Fundos de Investimentos		
Renda Fixa	Valor em R\$	% (do total)
Títulos Públicos Federais		
Prefixados	2.444.856	0,3%
Pós-fixados	106.710.787	12,1%
NTN-B (IPCA)	486.931.068	55,2%
Operações Compromissadas	155.051.507	17,6%
Subtotal	751.138.218	85,2%
Títulos Privados		
CDB	4.466.834	0,5%
Letra Financeira	53.416.041	6,1%
Debênture	6.804.875	0,8%
DPGE	445.291	0,1%
Nota Comercial	870.839	0,1%
Letra Hipotecária	159.526	0,0%
Letra de Câmbio	44.968	0,0%
Subtotal	66.208.374	7,5%
Cotas de Fundos	63.979.159	7,3%
Tesouraria (Fundos)	2.733	0,0%
Total	881.328.484	100,0%

Base: Maio/2018

DISTRIBUIÇÃO DAS CARTEIRAS DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA



No encerramento do mês de maio, as aplicações financeiras do Fundo Previdenciário em Fundos de Investimento totalizaram R\$ 881.328.483,64.

COMITÊ DE INVESTIMENTO – MAIO 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 09 de maio de 2018, na Sede Administrativa, à Rua da Quitanda nº 106 – Centro - Rio de Janeiro, foi aprovada a seguinte proposta para o mês de maio:

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 20 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: 30/05/2018
Segmento	Enquadramento	%	Limites PAI (% total)	Limites da Resolução nº 3.922/10 e alterações
Renda Fixa	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b"	71,7%	100,0%	100,0%
Renda Fixa	FI Renda Fixa Geral - Art. 7º, IV, "a"	28,3%	40,0%	40,0%
Total dos Recursos:				1.996.270.361,72

RELAÇÃO DE FUNDOS DE INVESTIMENTOS:

FUNDO PREVIDENCIÁRIO

Enquadramento	30/mai
FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	583.199.520,40
BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC DE FI	1.807.610,29
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA	7.308.160,69
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS	74.124.880,62
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TP	1.839.035,89
BB RENDA FIXA TITULOS PUBLICOS FI REFERENCIADO DI LP	81.524.896,96
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.492.252,99
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	17.975.330,43
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	17.359.427,93
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	90.882.563,00
CAIXA BRASIL 2018 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	24.175.820,00
CAIXA BRASIL 2020 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	19.022.280,00
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	35.674.025,72
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	107.192.660,68
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	28.790.411,24
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	50.073.202,28
ITAÚ INFLATION 5 RENDA FIXA FICFI	2.457.340,37
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	16.499.621,31
FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	298.128.963,24
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.290.682,25
BRABESCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IDKA PRÉ 2	2.486.014,47
BRABESCO INSTITUCIONAL FIC DE FI RENDA FIXA IMA-B 5	2.725.382,30
BRABESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	132.592.189,15
CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	39.942.118,47
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA	18.783.820,46
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA II	30.363.354,97
ITAÚ INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI FI	16.777.276,14
SAFRA EXECUTIVE 2 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	49.168.125,03
Total	881.328.483,64

FUNDO FINANCEIRO

Enquadramento	30/mai
FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	848.723.515,10
BB RENDA FIXA TITULOS PUBLICOS FI REFERENCIADO DI LP	848.723.515,10
FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	266.218.362,98
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	729.697,78
BRABESCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	2.741.994,18
BRABESCO H FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	13.265,85
BRABESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	88.488.548,67
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FUNDO DE INVESTIMENTO RF	1.573,18
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	41.693.768,78
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	132.332.519,65
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	216.994,89
Total	1.114.941.878,08