

2018



Relatório Mensal de Investimentos

Fundos Financeiro e Previdenciário

Junho



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

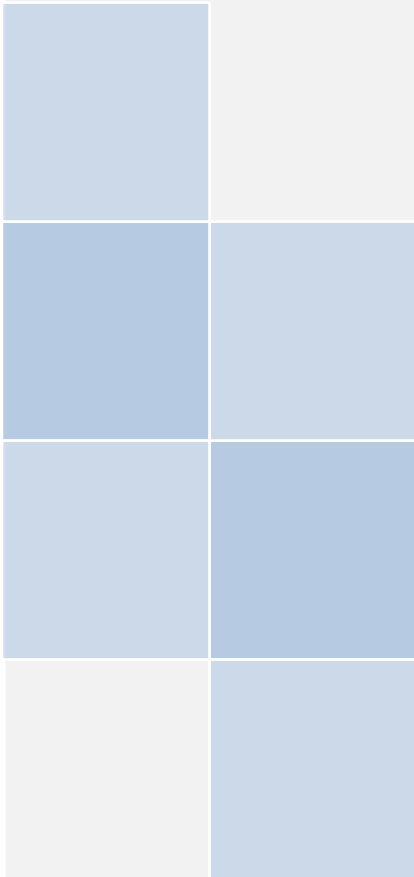
Rua da Quitanda nº 106

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	220.895.293
Fundos de Investimentos	
Fundos Referenciados DI	220.895.293
Imóveis*	334.503.582
Carteira Própria	334.503.582
TOTAL	555.398.875

* Mês de referência: Junho/2018

ALOCAÇÃO DOS RECURSOS Fundos de Investimentos

FUNDO FINANCEIRO					JUNHO 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%	1.165,84	0,50	3,15	7,42	0,20
BB RENDA FIXA TITULOS PUBLICOS FI REFERENCIADO DI LP	BB DTVM	169,56	2,79%	6.073,46	0,51	3,11	7,27	0,10
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA REFERENCIADO DI FEDERAL	BRAM-Asset	2,04	0,03%	6.928,64	0,50	3,07	7,21	0,15
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	BRAM-Asset	7,68	0,09%	9.019,94	0,51	3,14	7,55	0,20
BRADESCO H FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	BRAM-Asset	0,01	0,00%	5.579,64	0,51	3,08	7,22	0,15
BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FUNDO DE INVESTIMENTO RF (*)	BTG P.- Asset	0,00	0,00%	923,51	0,50	3,03	7,14	0,20
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	CAIXA	33,83	0,43%	7.788,52	0,50	3,07	7,21	0,20
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	Itaú	5,00	0,47%	1.062,30	0,51	3,10	7,22	0,18
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA SIMPLES LONGO PRAZO FIC DE FI	Itaú	1,82	0,02%	10.845,93	0,51	3,09	7,23	0,15
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI (*)	Sant.-Asset	0,22	0,00%	6.681,68	0,51	3,13	7,36	0,20
TOTAL		220,90						

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

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

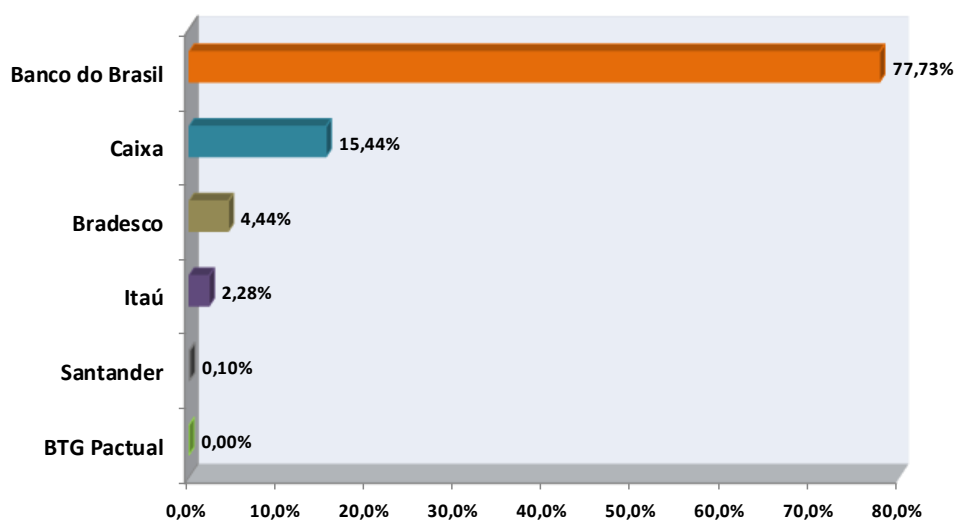
Em junho, as aplicações financeiras do FUNDO FINANCEIRO se concentraram em cotas de Fundos de Investimento Referenciado DI, cujos lastros são predominantemente títulos públicos federais.

COMPOSIÇÃO DAS APLICAÇÕES

Posição Consolidada da Carteira dos Fundos de Investimentos		
Renda Fixa	Valor em R\$	% (do total)
Títulos Públicos Federais		
Prefixados	730	0,0%
Pós-fixados	103.761.141	47,0%
Operações Compromissadas	101.869.771	46,1%
Subtotal	<u>205.631.642</u>	<u>93,1%</u>
Títulos Privados		
CDB	3.823.703	1,7%
Letra Financeira	6.268.068	2,8%
Debênture	2.990.873	1,4%
DPGE	27.264	0,0%
Nota Comercial	272.650	0,1%
CRA	27.416	0,0%
Letra de Câmbio	2.726	0,0%
Subtotal	<u>13.412.699</u>	<u>6,1%</u>
Cotas de Fundos	<u>1.850.745</u>	<u>0,8%</u>
Tesouraria (Fundos)	<u>207</u>	<u>0,0%</u>
Total	<u>220.895.293</u>	<u>100,0%</u>

Base: Junho/2018

DISTRIBUIÇÃO DAS CARTEIRAS DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA



No encerramento do mês de junho, as aplicações financeiras do Fundo Financeiro em Fundos de Investimento totalizaram R\$ 220.895.293,11.

COMITÊ DE INVESTIMENTO – JUNHO 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 06 de junho de 2018, na Sede Administrativa, à Rua da Quitanda nº 106 – Centro - Rio de Janeiro, foi aprovada a seguinte proposta para o mês de junho:

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	890.231.512
Fundos de Investimentos	
Fundos Referenciados DI	231.668.476
Fundos de Renda Fixa RF IMA	657.168.735
IMA-B 5	188.755.625
IMA-B 5+	221.931.173
IMA-Geral	196.879.134
IRF-M 1	49.292.944
IRF-M	309.860
Fundos de Renda Fixa RF IDkA	1.394.301
IDKA PRÉ 2	347.470
IDKA IPCA 2A	1.046.830
Imóveis	0
Carteira Própria	0
TOTAL	890.231.512

ALOCAÇÃO DOS RECURSOS
Fundos de Investimentos

FUNDO PREVIDENCIÁRIO						JUNHO 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	3,33	0,07%	4.659,95	0,50	3,15	7,41	0,20
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA	BB DTVM	0,37	0,01%	2.829,19	0,19	2,55	8,41	0,30
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	BB DTVM	6,50	2,63%	246,77	0,15	2,11	9,64	0,20
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	BB DTVM	18,00	3,67%	491,06	0,14	2,43	9,77	0,20
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	BB DTVM	25,51	14,75%	172,94	0,31	2,03	9,78	0,20
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	BB DTVM	39,40	13,56%	290,48	0,27	1,78	9,31	0,15
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI	BB DTVM	57,67	13,09%	440,40	0,31	2,03	9,92	0,15
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS	BB DTVM	1,05	0,02%	6.108,97	0,29	3,16	9,69	0,20
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LP FIC DE FI	BB DTVM	0,39	0,02%	2.255,26	0,43	2,70	9,53	0,20
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS	BB DTVM	0,31	0,01%	5.450,23	0,01	2,26	8,71	0,20
BB RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS FI REFERENCIADO DI LP	BB DTVM	98,79	1,63%	6.073,46	0,51	3,11	7,27	0,10
BRANCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	BRAM-Asset	101,84	1,13%	9.019,94	0,51	3,14	7,55	0,20
BRANCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IDKA PRÉ 2	BRAM-Asset	0,35	0,19%	182,75	-0,26	3,30	10,53	0,20
BRANCO INSTITUCIONAL FICFI RENDA FIXA IMA-B 5	BRAM-Asset	0,29	0,05%	536,16	0,38	2,59	9,52	0,20
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Caixa	91,91	2,80%	3.288,22	1,13	4,19	8,68	0,20
CAIXA BRASIL 2018 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Caixa	24,45	8,44%	289,53	1,13	4,19	8,67	0,20
CAIXA BRASIL 2020 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Caixa	19,04	15,49%	122,89	0,10	3,49	10,43	0,20
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Caixa	35,71	3,69%	967,23	0,10	3,50	10,45	0,20
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Caixa	143,56	14,08%	1.019,70	-0,01	2,02	8,08	0,20
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Caixa	28,79	15,94%	180,59	-0,01	2,02	8,78	0,20
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Caixa	49,59	17,59%	281,84	-0,97	0,20	6,77	0,20
CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	Caixa	26,21	0,34%	7.788,52	0,50	3,07	7,21	0,20
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RENDA FIXA FICFI	Itaú	18,89	1,26%	1.494,48	0,59	3,87	10,43	0,40
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II RENDA FIXA FICFI	Itaú	30,54	1,82%	1.674,15	0,59	3,89	10,45	0,40
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Itaú	16,63	18,50%	89,90	0,80	0,48	3,77	0,20
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI - FI	Itaú	1,51	0,14%	1.062,30	0,51	3,10	7,22	0,18
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLAÇÃO 5 - FICFI	Itaú	0,34	0,03%	1.315,43	0,41	2,60	9,28	0,40
SAFRA EXECUTIVE 2 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	J. Safra Asset	49,29	10,79%	456,85	0,25	2,87	7,74	0,50
TOTAL		890,23						

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

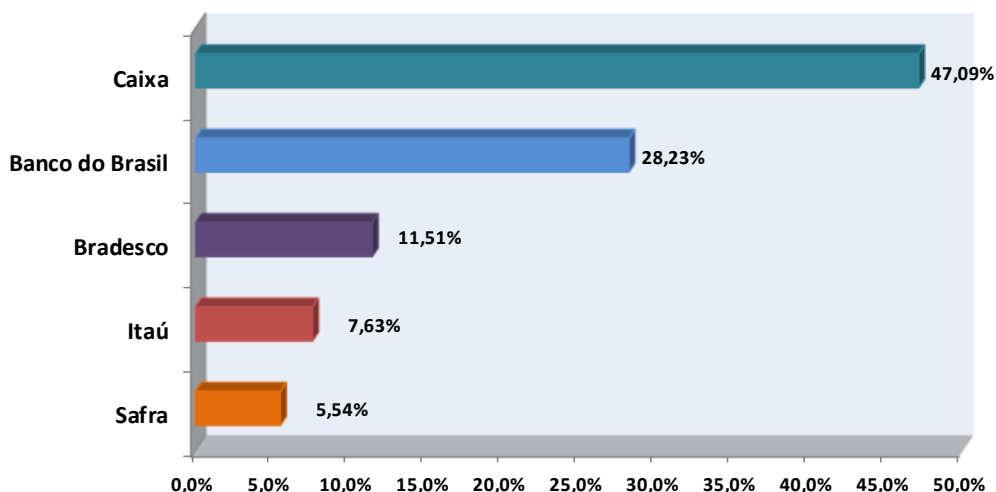
Em junho, a maior parcela das aplicações financeiras do FUNDO PREVIDENCIÁRIO se concentrou em cotas de Fundos de Renda Fixa – IMA e IDkA. Outra parte dos recursos está aplicada em cotas de Fundos de Investimento Referenciado DI.

COMPOSIÇÃO DAS APLICAÇÕES

Posição Consolidada das Carteiras dos Fundos de Investimentos		
Renda Fixa	Valor em R\$	% (do total)
Títulos Públicos Federais		
Prefixados	384.370	0,0%
Pós-fixados	101.185.079	11,4%
NTN-B (IPCA)	557.170.835	62,6%
Operações Compromissadas	133.204.572	15,0%
Subtotal	791.944.856	89,0%
Títulos Privados		
CDB	4.330.690	0,5%
Letra Financeira	36.466.741	4,1%
Debênture	5.128.700	0,6%
DPGE	304.165	0,0%
Nota Comercial	594.018	0,1%
Letra Hipotecária	118.633	0,0%
Letra de Câmbio	30.407	0,0%
Subtotal	46.973.355	5,3%
Cotas de Fundos	51.308.554	5,8%
Tesouraria (Fundos)	4.746	0,0%
Total	890.231.512	100,0%

Base: Junho/2018

DISTRIBUIÇÃO DAS CARTEIRAS DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA



No encerramento do mês de junho, as aplicações financeiras do Fundo Previdenciário em Fundos de Investimento totalizaram R\$ 890.231.511,61.

COMITÊ DE INVESTIMENTO – JUNHO 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 06 de junho de 2018, na Sede Administrativa, à Rua da Quitanda nº 106 – Centro - Rio de Janeiro, foi aprovada a seguinte proposta para o mês de junho:

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 04 de julho de 2018 (data-base: 29/06/2018), 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. O fundo Bradesco Fundo de Investimento Renda Fixa IDKA Pré 2 foi incluído na planilha com classificação no artigo 7º, I, b.

				Posição: 29/06/2018
Segmento	Enquadramento	%	Limites PAI (% total)	Limites da Resolução nº 3.922/10 e alterações
Renda Fixa	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b"	74,5%	100,0%	100,0%

Renda Fixa	FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV, "a"	25,5%	40,0%	40,0%
------------	-------------------------------------	-------	-------	-------

Total dos Recursos: 1.111.126.804,72

RELAÇÃO DE FUNDOS DE INVESTIMENTOS:

FUNDO PREVIDENCIÁRIO

Enquadramento	29/jun
FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	658.341.832,14
BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC DE FI	387.901,97
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA	365.510,43
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS	1.046.830,25
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TP	309.860,34
BB RENDA FIXA TITULOS PUBLICOS FI REFERENCIADO DI LP	98.793.689,72
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.502.170,76
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	18.001.348,47
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	25.505.975,51
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI	39.400.990,02
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TITULOS PUBLICOS IPCA I FI	57.667.989,28
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IDKA PRÉ 2	347.470,33
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	91.908.257,78
CAIXA BRASIL 2018 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	24.448.420,00
CAIXA BRASIL 2020 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	19.041.150,00
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	35.709.881,82
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	143.557.291,03
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	28.788.183,49
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	49.585.698,35
ITAÚ INFLATION 5 RENDA FIXA FICFI	341.313,35
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	16.631.899,24
FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	231.889.679,47
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.327.002,88
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC DE FI RENDA FIXA IMA-B 5	286.800,43
BRADESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	101.835.654,27
CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	26.206.739,29
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA	18.893.812,12
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA II	30.541.336,99
ITAÚ INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI FI	1.505.389,84
SAFRA EXECUTIVE 2 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	49.292.943,65
Total	890.231.511,61

FUNDO FINANCEIRO

Enquadramento	29/jun
FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b	169.562.762,47
BB RENDA FIXA TITULOS PUBLICOS FI REFERENCIADO DI LP	169.562.762,47
FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a	51.332.530,64
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	733.368,17
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	2.036.456,07
BRADESCO H FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	13.333,23
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	7.684.397,92
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FUNDO DE INVESTIMENTO RF	1.581,12
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	33.831.586,47
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	4.997.299,84
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA SIMPLES LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM C	1.816.406,84
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	218.100,98
Total	220.895.293,11