

2018



Relatório Mensal de Investimentos

Fundos Financeiro e Previdenciário

Agosto



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

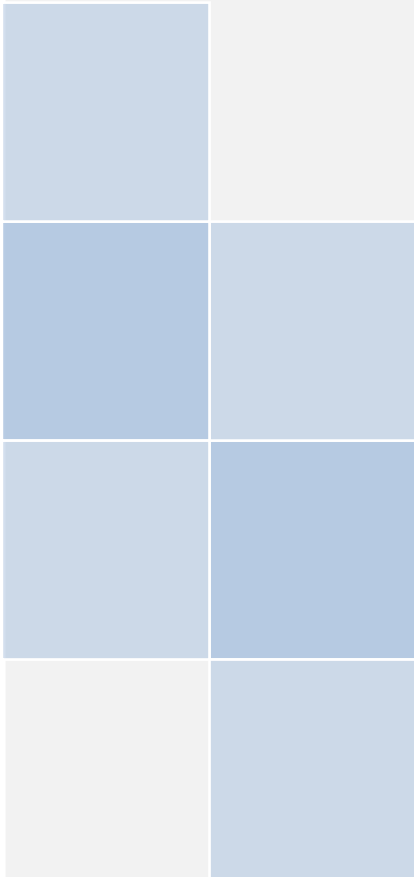
Rua da Quitanda nº 106

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	1.311.563.255
Fundos de Investimentos	
Fundos Referenciados DI	1.311.563.255
Imóveis*	334.381.456
Carteira Própria	334.381.456
TOTAL	1.645.944.710

* Mês de referência: Agosto/2018

ALOCAÇÃO DOS RECURSOS Fundos de Investimentos

FUNDO FINANCEIRO				AGOSTO 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	0,74	0,06%	1.176,53	0,56	4,27	6,86	0,20
BB RENDA FIXA TITULOS PUBLICOS FI REFERENCIADO DI LP	BB DTVM	775,06	11,72%	6.615,91	0,56	4,24	6,74	0,10
BRADERCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA REFERENCIADO DI FEDERAL	BRAM-Asset	162,36	2,03%	7.982,23	0,55	4,18	6,66	0,15
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	BRAM-Asset	256,06	2,83%	9.040,36	0,55	4,26	6,79	0,20
BRADERCO H FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	BRAM-Asset	0,01	0,00%	886,94	0,55	4,19	6,67	0,15
BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FUNDO DE INVESTIMENTO RF (*)	BTG P.- Asset	0,00	0,00%	1.232,33	0,56	4,15	6,60	0,20
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	CAIXA	1,36	0,02%	8.386,41	0,56	4,19	6,68	0,20
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	Itaú	6,10	0,58%	1.055,82	0,56	4,23	6,70	0,18
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA SIMPLES LONGO PRAZO FIC DE FI	Itaú	109,66	0,97%	11.346,86	0,55	4,21	6,69	0,15
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI (*)	Sant.-Asset	0,22	0,00%	6.977,55	0,55	4,26	6,78	0,20
TOTAL		1.311,56						

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

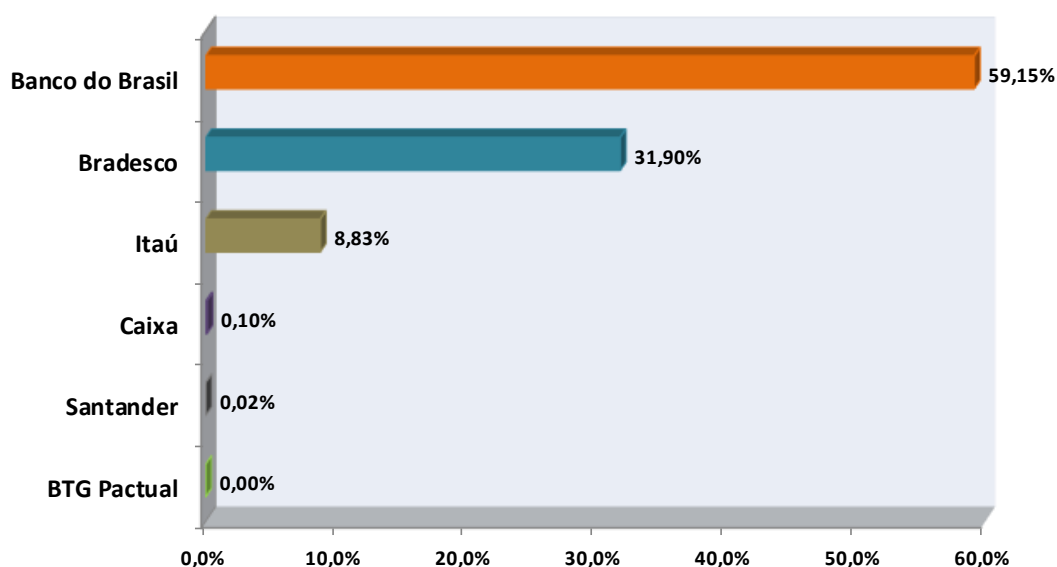
Em agosto, as aplicações financeiras do FUNDO FINANCEIRO se concentraram em cotas de Fundos de Investimento Referenciado DI, cujos lastros são predominantemente títulos públicos federais.

COMPOSIÇÃO DAS APLICAÇÕES

Posição Consolidada da Carteira dos Fundos de Investimentos		
Renda Fixa	Valor em R\$	% (do total)
Títulos Públicos Federais		
Prefixados	0	0,0%
Pós-fixados	583.440.762	44,5%
Operações Compromissadas	540.352.526	41,2%
Subtotal	1.123.793.287	85,7%
Títulos Privados		
CDB	18.575.343	1,4%
Letra Financeira	39.258.740	3,0%
Debênture	17.619.080	1,3%
DPGE	193.031	0,0%
Nota Comercial	1.487.744	0,1%
CRA	0	0,0%
Letra de Câmbio	0	0,0%
Subtotal	77.133.938	5,9%
Cotas de Fundos	110.635.870	8,4%
Tesouraria (Fundos)	233	0,0%
Total	1.311.563.328	100,0%

Base: Agosto/2018

DISTRIBUIÇÃO DAS CARTEIRAS DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA



No encerramento do mês de agosto, as aplicações financeiras do Fundo Financeiro em Fundos de Investimento totalizaram R\$ 1.311.563.328,42.

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

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	1.027.882.306
Fundos de Investimentos	
Fundos Referenciados DI	488.222.823
Fundos de Renda Fixa RF IMA	538.251.123
IMA-B 5	71.749.800
IMA-B 5+	219.916.259
IMA-Geral	196.493.512
IRF-M 1	49.780.103
IRF-M	311.450
Fundos de Renda Fixa RF IDkA	1.408.360
IDKA PRÉ 2	349.429
IDKA IPCA 2A	1.058.930
Imóveis	0
Carteira Própria	0
TOTAL	1.027.882.306

ALOCAÇÃO DOS RECURSOS
Fundos de Investimentos

FUNDO PREVIDENCIÁRIO					AGOSTO 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	3,36	0,06%	5.700,49	0,55	4,26	6,86	0,20
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA	BB DTVM	0,37	0,01%	3.270,78	-0,39	3,55	5,73	0,30
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	BB DTVM	6,41	2,63%	243,45	-0,66	3,52	5,54	0,20
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	BB DTVM	17,76	3,67%	484,52	-0,44	3,84	5,89	0,20
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	BB DTVM	25,14	14,75%	170,44	-0,67	3,35	5,60	0,20
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	BB DTVM	40,07	13,56%	295,40	-0,40	3,51	5,34	0,15
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI	BB DTVM	56,84	13,09%	434,08	-0,67	3,35	5,62	0,15
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS	BB DTVM	1,06	0,02%	6.422,22	-0,08	4,36	7,27	0,20
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LP FIC DE FI	BB DTVM	0,39	0,02%	2.431,73	-0,26	3,93	6,45	0,20
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS	BB DTVM	0,31	0,01%	5.061,06	-0,96	2,79	5,71	0,20
BB RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS FI REFERENCIADO DI LP	BB DTVM	22,56	0,34%	6.615,91	0,56	4,24	6,74	0,10
BRANCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	BRAM-Asset	131,24	1,45%	9.040,36	0,55	4,26	6,79	0,20
BRANCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IDKA PRÉ 2	BRAM-Asset	0,35	0,16%	223,84	-0,82	3,88	7,56	0,20
BRANCO INSTITUCIONAL FICFI RENDA FIXA IMA-B 5	BRAM-Asset	0,29	0,05%	536,40	-0,34	3,78	6,22	0,20
CAIXA BRASIL 2020 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Caixa	18,75	15,49%	121,02	0,16	4,76	7,64	0,20
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Caixa	35,17	3,69%	952,56	0,16	4,77	7,66	0,20
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Caixa	141,97	13,64%	1.040,86	-0,60	3,63	4,74	0,20
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Caixa	28,45	15,94%	178,44	-0,60	3,62	4,73	0,20
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Caixa	49,51	17,59%	281,38	0,09	2,83	3,93	0,20
CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	Caixa	86,64	1,03%	8.386,41	0,56	4,19	6,68	0,20
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	Caixa	178,14	6,20%	2.871,30	0,52	4,12	6,64	0,20
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RENDA FIXA FICFI	Itaú	19,07	1,25%	1.520,63	0,37	4,85	7,46	0,40
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II RENDA FIXA FICFI	Itaú	30,83	1,42%	2.165,45	0,37	4,87	7,48	0,40
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Itaú	16,80	18,50%	90,82	0,37	1,51	1,59	0,20
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI - FI	Itaú	66,28	6,28%	1.055,82	0,56	4,23	6,70	0,18
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLAÇÃO 5 - FICFI	Itaú	0,35	0,03%	1.203,10	-0,29	3,77	6,23	0,40
SAFRA EXECUTIVE 2 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	J. Safra Asset	49,78	12,30%	404,60	0,19	3,89	6,61	0,50
TOTAL		1.027,88						

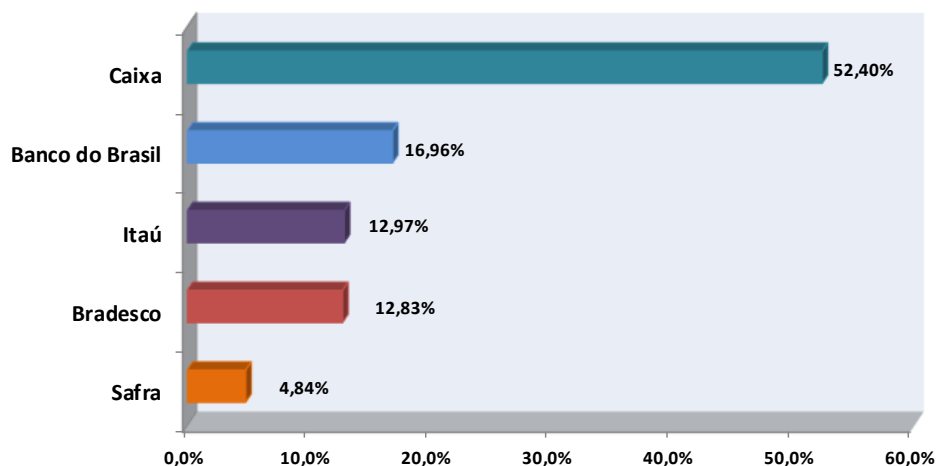
Fonte: RIOPREVIDÊNCIA, Bradesco, Banco do Brasil, Caixa, Itaú e Safra.

Em agosto, 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	376.132	0,0%
Pós-fixados	202.583.943	19,7%
NTN-B (IPCA)	437.253.529	42,5%
Operações Compromissadas	243.748.242	23,7%
Subtotal	883.961.846	86,0%
Títulos Privados		
CDB	6.506.332	0,6%
Letra Financeira	73.815.626	7,2%
Debênture	10.382.510	1,0%
DPGE	514.000	0,1%
Nota Comercial	525.466	0,1%
Letra Hipotecária	278.282	0,0%
Letra de Câmbio	0	0,0%
Subtotal	92.022.216	9,0%
Cotas de Fundos	51.892.806	5,0%
Tesouraria (Fundos)	5.438	0,0%
Total	1.027.882.306	100,0%
<i>Base: Agosto/2018</i>		

DISTRIBUIÇÃO DAS CARTEIRAS DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA



No encerramento do mês de agosto, as aplicações financeiras do Fundo Previdenciário em Fundos de Investimento totalizaram R\$ 1.027.882.305,64.

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

Fundo Previdenciário:

Considerando o cenário econômico de curto e longo prazo apresentado no Comitê, propomos a alocação nos seguintes segmentos:

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

Para alocação de recursos adicionais ou realocações, propomos a aplicação nos seguintes segmentos:

- Fundos DI.

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

No dia 19/10/2017, por meio da Resolução CMN nº 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 12 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.

				Posição: 31/08/2018
Segmento	Enquadramento	%	Limites PAI (% total)	Limites da Resolução nº 3.922/10 e alterações
Renda Fixa	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b"	60,5%	100,0%	100,0%
Renda Fixa	FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV, "a"	39,5%	40,0%	40,0%
Total dos Recursos:				2.339.445.634,06

RELAÇÃO DE FUNDOS DE INVESTIMENTOS:

FUNDO PREVIDENCIÁRIO

Enquadramento

FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b

BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC DE FI
 BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA
 BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS
 BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TP
 BB RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS FI REFERENCIADO DI LP
 BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO
 BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO
 BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO
 BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI
 BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI
 BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IDKA PRÉ 2
 CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO
 CAIXA BRASIL 2020 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA
 CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA
 CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA
 CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA
 CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA
 ITAÚ INFLATION 5 RENDA FIXA FICFI
 ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA

FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a

BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO
 BRADESCO INSTITUCIONAL FIC DE FI RENDA FIXA IMA-B 5
 BRADESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI
 CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP
 ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA
 ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA II
 ITAÚ INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI FI
 SAFRA EXECUTIVE 2 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA

FUNDO FINANCEIRO

Enquadramento

FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b

BB RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS FI REFERENCIADO DI LP
FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a
 BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA
 BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA
 BRADESCO H FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP
 BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI
 BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FUNDO DE INVESTIMENTO RF
 CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP
 ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI
 ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA SIMPLES LONGO PRAZO FIC DE FUNDOS DE INVEST
 SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI