

2018



Relatório Mensal de Investimentos

Fundos Financeiro e Previdenciário

SETEMBRO



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

Nícolás Ribeiro da Costa Cardoso

Pedro Daflon Fraiz

Teresa Luiza da Silva Dias

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

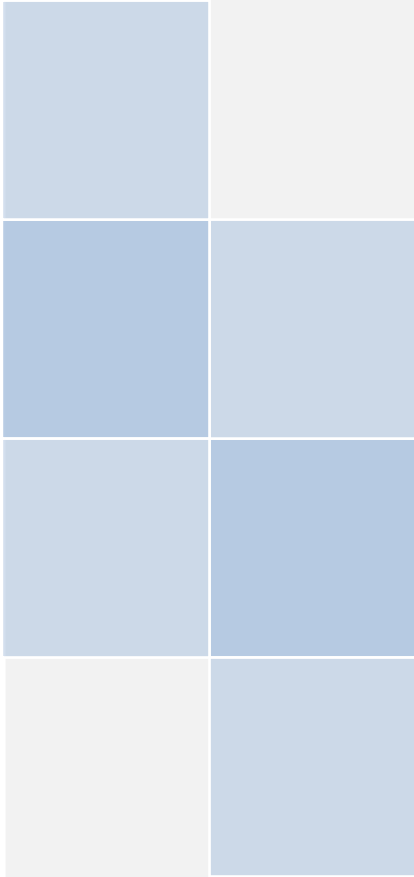
Rua da Quitanda nº 106

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	984.387.336
Fundos de Investimentos	
Fundos Referenciados DI	984.387.336
TOTAL	984.387.336

ALOCAÇÃO DOS RECURSOS Fundos de Investimentos

FUNDO FINANCEIRO					SETEMBRO 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	25,84	2,16%	1.197,75	0,76	5,06	6,96	0,20
BB RENDA FIXA TITULOS PUBLICOS FI REFERENCIADO DI LP	BB DTVM	626,17	9,69%	6.462,80	0,46	4,73	6,55	0,10
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA REFERENCIADO DI FEDERAL	BRAM-Asset	0,50	0,01%	7.806,94	0,46	4,66	6,48	0,15
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	BRAM-Asset	219,63	2,64%	8.306,20	0,47	4,74	6,58	0,20
BRADESCO H FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	BRAM-Asset	0,01	0,00%	846,73	0,46	4,67	6,48	0,15
BTG PACTUAL TESOUREO SELIC FUNDO DE INVESTIMENTO RF (*)	BTG P.- Asset	0,00	0,00%	1.324,31	0,46	4,62	6,42	0,20
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	CAIXA	1,36	0,02%	8.348,47	0,44	4,65	6,48	0,20
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	Itaú	13,99	1,25%	1.123,04	0,46	4,70	6,52	0,18
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA SIMPLES LONGO PRAZO FIC DE FI	Itaú	46,61	0,42%	11.140,79	0,46	4,69	6,51	0,15
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI	Sant.-Asset	50,07	1,07%	4.677,54	0,47	4,73	6,56	0,20
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI (*)	Sant.-Asset	0,20	0,00%	7.079,87	0,46	4,74	6,58	0,20
TOTAL		984,39						

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

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

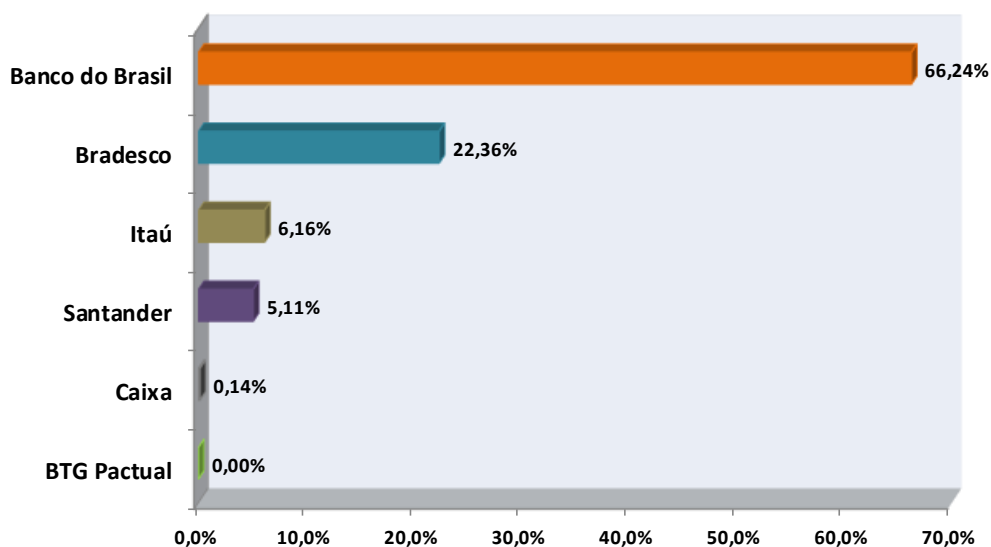
Em setembro, as aplicações financeiras do FUNDO FINANCEIRO se concentraram em cotas de Fundos de Investimento Referenciado DI, cujos lastros são predominantemente títulos públicos federais.

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	395.406.528	40,2%
Operações Compromissadas	488.316.085	49,6%
Subtotal	883.722.613	89,8%
Títulos Privados		
CDB	24.268.857	2,5%
Letra Financeira	50.277.992	5,1%
Debênture	22.632.018	2,3%
DPGE	209.075	0,0%
Nota Comercial	1.787.053	0,2%
CRA	0	0,0%
Letra de Câmbio	0	0,0%
Subtotal	99.174.996	10,1%
Cotas de Fundos	1.488.354	0,2%
Tesouraria (Fundos)	1.374	0,0%
Total	984.387.336	100,0%

Base: Setembro/2018

DISTRIBUIÇÃO DAS CARTEIRAS DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA



No encerramento do mês de setembro, as aplicações financeiras do Fundo Financeiro em Fundos de Investimento totalizaram R\$ 984.387.336,33.

COMITÊ DE INVESTIMENTO – SETEMBRO 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 05 de setembro de 2018, na Sede Administrativa, à Rua da Quitanda nº 106 – Centro - Rio de Janeiro, foi aprovada a seguinte proposta para o mês de setembro:

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	1.063.965.577
Fundos de Investimentos	
Fundos Referenciados DI	522.887.039
Fundos de Renda Fixa RF IMA	539.653.803
IMA-B 5	72.567.249
IMA-B 5+	219.001.579
IMA-Geral	197.660.785
IRF-M 1	50.108.750
IRF-M	315.440
Fundos de Renda Fixa RF IDkA	1.424.735
IDKA PRÉ 2	353.402
IDKA IPCA 2A	1.071.333
Imóveis	0
Carteira Própria	0
TOTAL	1.063.965.577

ALOCAÇÃO DOS RECURSOS
Fundos de Investimentos

FUNDO PREVIDENCIÁRIO					SETEMBRO 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	3,38	0,06%	5.706,17	0,49	4,77	6,69	0,20
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA	BB DTVM	0,37	0,01%	3.381,63	0,60	4,17	4,99	0,30
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	BB DTVM	6,44	2,63%	244,58	0,47	4,00	4,69	0,20
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	BB DTVM	17,86	3,67%	487,25	0,56	4,43	5,14	0,20
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	BB DTVM	25,35	14,75%	171,86	0,83	4,21	5,19	0,20
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI	BB DTVM	40,21	13,56%	296,44	0,35	3,88	4,36	0,15
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI	BB DTVM	57,32	13,09%	437,72	0,84	4,22	5,20	0,15
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS	BB DTVM	1,07	0,02%	6.551,96	1,17	5,58	7,60	0,20
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LP FIC DE FI	BB DTVM	0,40	0,02%	2.433,48	0,87	4,83	6,32	0,20
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS	BB DTVM	0,32	0,01%	4.903,98	1,28	4,10	5,53	0,20
BB RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS FI REFERENCIADO DI LP	BB DTVM	26,20	0,41%	6.462,80	0,46	4,73	6,55	0,10
BRANCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	BRAM-Asset	132,21	1,59%	8.306,20	0,47	4,74	6,58	0,20
BRANCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IDKA PRÉ 2	BRAM-Asset	0,35	0,15%	233,53	1,14	5,06	7,17	0,20
BRANCO INSTITUCIONAL FICFI RENDA FIXA IMA-B 5	BRAM-Asset	0,29	0,05%	532,14	0,86	4,67	6,06	0,20
CAIXA BRASIL 2020 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Caixa	18,98	15,49%	122,49	1,22	5,97	7,68	0,20
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Caixa	35,60	3,69%	964,18	1,22	5,99	7,69	0,20
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Caixa	141,59	12,14%	1.166,11	-0,26	3,37	2,98	0,20
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Caixa	28,37	15,94%	177,96	-0,27	3,35	2,96	0,20
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Caixa	49,04	17,59%	278,74	-0,94	1,91	1,03	0,20
CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	Caixa	87,02	1,04%	8.348,47	0,44	4,65	6,48	0,20
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	Caixa	207,62	6,86%	3.024,98	0,47	4,61	6,44	0,20
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RENDA FIXA FICFI	Itaú	19,15	1,25%	1.526,59	0,42	5,29	6,30	0,40
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II RENDA FIXA FICFI	Itaú	30,96	1,35%	2.286,04	0,42	5,31	6,32	0,40
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Itaú	16,95	18,50%	91,64	0,90	2,43	1,76	0,20
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI - FI	Itaú	66,45	5,92%	1.123,04	0,46	4,70	6,52	0,18
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLAÇÃO 5 - FICFI	Itaú	0,35	0,03%	1.199,03	0,85	4,66	6,10	0,40
SAFRA EXECUTIVE 2 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	J. Safra Asset	50,11	12,29%	407,62	0,66	4,58	6,47	0,50
TOTAL		1.063,97						

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

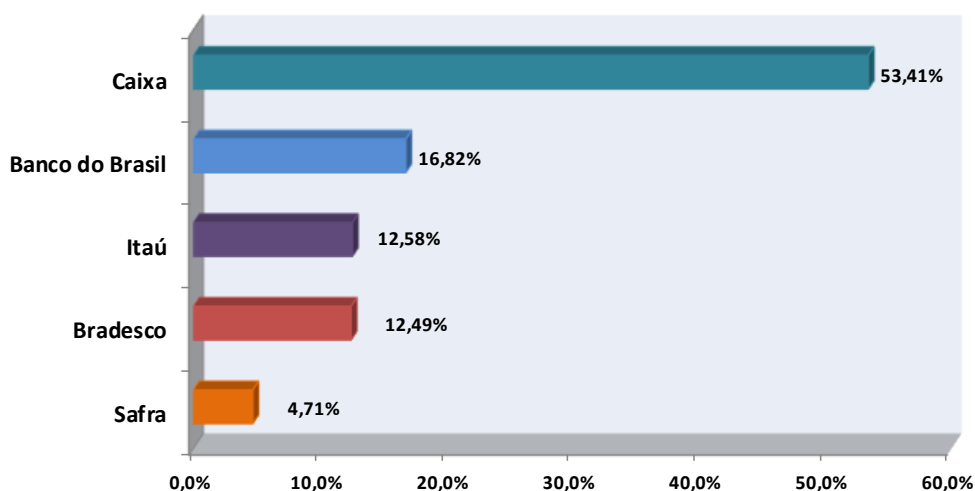
Em setembro, a maior parcela das aplicações financeiras do FUNDO PREVIDENCIÁRIO se concentrou em cotas de Fundos de Renda Fixa – IMA e IDkA. Outra parte dos recursos está aplicada em cotas de Fundos de Investimento Referenciado DI.

COMPOSIÇÃO DAS APLICAÇÕES

Posição Consolidada das Carteiras dos Fundos de Investimentos		
Renda Fixa	Valor em R\$	% (do total)
Títulos Públicos Federais		
Prefixados	34.787.732	3,3%
Pós-fixados	182.266.241	17,1%
NTN-B (IPCA)	442.624.629	41,6%
Operações Compromissadas	259.535.651	24,4%
Subtotal	919.214.252	86,4%
Títulos Privados		
CDB	5.079.640	0,5%
Letra Financeira	75.240.547	7,1%
Debênture	10.963.251	1,0%
DPGE	504.787	0,0%
Nota Comercial	527.665	0,0%
Letra Hipotecária	281.510	0,0%
Letra de Câmbio	0	0,0%
Subtotal	92.597.400	8,7%
Cotas de Fundos	52.147.158	4,9%
Tesouraria (Fundos)	6.768	0,0%
Total	1.063.965.577	100,0%

Base: Setembro/2018

DISTRIBUIÇÃO DAS CARTEIRAS DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA



No encerramento do mês de setembro, as aplicações financeiras do Fundo Previdenciário em Fundos de Investimento totalizaram R\$ 1.063.965.577,43.

COMITÊ DE INVESTIMENTO – SETEMBRO 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 05 de setembro de 2018, na Sede Administrativa, à Rua da Quitanda nº 106 – Centro - Rio de Janeiro, foi aprovada a seguinte proposta para o mês de setembro:

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;
- Fundos Vértices NTN-B.

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: 28/09/2018
Segmento	Enquadramento	%	Limites PAI (% total)	Limites da Resolução nº 3.922/10 e alterações
Renda Fixa	FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b"	63,5%	100,0%	100,0%
Renda Fixa	FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV, "a"	36,5%	40,0%	40,0%
Total dos Recursos:				2.048.352.913,76

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 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
 SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI