

2019



# Relatório Mensal de Investimentos

Fundos Financeiro e Previdenciário

JANEIRO



## **Diretoria de Investimentos**

**Aloisio Villeth Lemos**  
Diretor de Investimentos

## **Gerência de Operações e Planejamento**

**Kelli Manhães Pessanha**  
Gerência de Operações e Planejamento

**Rodrigo Santos Martins**  
Coordenadoria de Operações Financeiras

**Bruno Luís Lacerda dos Santos**  
Coordenadoria de Planejamento e Orçamento

### **Equipe Técnica:**

**Alisson José Ramos Batista**  
**Angela Maria Monteiro Pandolfo**  
**Flávio Carramanhos Werneck**  
**Luiz Claudio Nogueira da Silva**  
**Michelle Caldas Bouhid**  
**Nícolás Ribeiro da Costa Cardoso**  
**Pedro Daflon Fraiz**

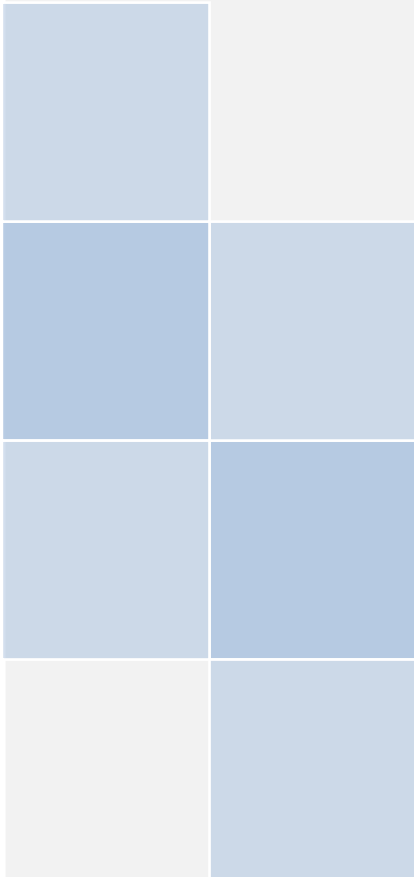
**Fundo Único de Previdência do Estado do Rio de Janeiro – RIOPREVIDÊNCIA**

**Rua da Quitanda nº 106**

**20091-005 – Centro – Rio de Janeiro – RJ**

**Telefone: (21) 2332-5151**

**Home page: [www.rioprevidencia.rj.gov.br](http://www.rioprevidencia.rj.gov.br)**



# Fundo Financeiro



## ALOCAÇÃO DOS RECURSOS Fundos de Investimentos

R\$ Milhões		Fundo Financeiro				
Instituição	CNPJ	Saldo em	Rent.	Rent.	Rent.	Tx
		31/01/2019	Mês	Ano	12 meses	Adm
Bradesco - Premium DI	03.399.411/0001-90	154,26	0,53%	0,53%	6,29%	0,20
Santander FIC REF DI	02.224.354/0001-45	97,17	0,55%	0,55%	6,31%	0,20
BB Referenciado	11.046.645/0001-81	89,76	0,53%	0,53%	6,27%	0,10
Itaú Soberano	06.175.696/0001-73	63,46	0,53%	0,53%	6,22%	0,15
Itaú Institucional	00.832.435/0001-00	55,14	0,53%	0,53%	6,24%	0,20
Bradesco - Federal Extra	03.256.793/0001-00	6,26	0,53%	0,53%	6,18%	0,20
Caixa - FI Brasil TP RF LP	05.164.356/0001-84	5,73	0,53%	0,53%	6,13%	0,15
BB Institucional	02.296.928/0001-90	2,22	0,54%	0,54%	6,61%	0,18
Caixa - FI Brasil DI	03.737.206/0001-97	1,35	0,53%	0,53%	6,19%	0,18
Santander Corporate	03.069.104/0001-40	0,20	0,55%	0,55%	6,31%	0,20
Bradesco RF REF DI LP	00.975.480/0001-06	0,01	0,53%	0,53%	6,19%	0,20
BTG Master Cash	09.215.250/0001-13	0,00	0,53%	0,53%	6,15%	0,20
<b>Total</b>		<b>475,57</b>				

## COMPOSIÇÃO DAS APLICAÇÕES POR BENCHMARK

Fundos	Participação	R\$ (milhões)
DI	100,00%	475,57
IMA B	0,00%	-
IMA B 5	0,00%	-
IMA B 5+	0,00%	-
IRFM	0,00%	-
IDKA 2 Pré	0,00%	-
<b>TOTAL</b>	<b>100,00%</b>	<b>475,57</b>

## DISTRIBUIÇÃO DAS CARTEIRAS DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição	Participação	R\$ (milhões)
Bradesco	33,76%	160,53
Caixa	1,49%	7,09
BB	19,34%	91,98
Itaú	24,94%	118,60
Santander	20,47%	97,37
<b>TOTAL</b>	<b>100,00%</b>	<b>475,57</b>

## **COMITÊ DE INVESTIMENTO – JANEIRO 2019**

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 janeiro de 2019, na Sede Administrativa, à Rua da Quitanda nº 106 – Centro - Rio de Janeiro, foi aprovada a seguinte proposta para o mês de janeiro:

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 posteriores.



# Fundo Previdenciário



## ALOCAÇÃO DOS RECURSOS Fundos de Investimentos

Fundo de Investimento	CNPJ	Fundo Previdenciário				
		Saldo em	Rent.	Rent.	Rent.	Taxa
		31/01/2019	Mês	Ano	12 Meses	Adm
			%	%	%	% a.a
Caixa Brasil TP RF LP	05.164.356/0001-84	164,44	0,53%	0,53%	6,13%	0,20
Caixa Brasil 2024 IV	20.139.595/0001-78	156,90	2,42%	2,42%	11,11%	0,20
Santander FIC FI	02.224.354/0001-45	115,06	0,55%	0,55%	6,31%	0,20
Santander FIC IMA B	14.504.578/0001-90	94,03	4,33%	4,33%	13,83%	0,20
Itaú Instucional DI	00.832.435/0001-00	70,43	0,53%	0,53%	6,24%	0,18
BB Prev TP RF IPCA I	19.303.793/0001-46	62,01	1,94%	1,94%	10,73%	0,15
Bradesco - Premium DI	03.399.411/0001-90	61,91	0,53%	0,53%	6,29%	0,20
Caixa Brasil 2030 III	20.139.534/0001-00	57,51	5,00%	5,00%	14,25%	0,20
BB Prev TP RF IPCA	15.486.093/0001-83	42,83	2,14%	2,14%	11,23%	0,15
Caixa - FI Brasil DI	03.737.206/0001-97	38,11	0,53%	0,53%	6,19%	0,20
Caixa Brasil 2020 IV	21.919.953/0001-28	36,97	1,05%	1,05%	9,12%	0,20
Itaú Aloc Dinâmica II	25.306.703/0001-73	32,57	2,37%	2,37%	9,18%	0,40
Caixa Brasil 2024 VI	22.791.074/0001-26	31,43	2,42%	2,42%	11,09%	0,20
BB IMAB 5	03.543.447/0001-03	31,36	1,52%	1,52%	9,88%	0,20
BB Prev TP RF IPCA XI	24.117.278/0001-01	27,41	1,93%	1,93%	10,73%	0,20
BB IRF-M	07.111.384/0001-69	26,33	1,37%	1,37%	10,62%	0,20
BB Ref DI TP	11.046.645/0001-81	24,41	0,53%	0,53%	6,27%	0,10
Bradesco IDKA	24.022.566/0001-82	21,12	1,28%	1,28%	11,84%	0,20
Itaú Aloc Dinâmica	21.838.150/0001-49	20,15	2,37%	2,37%	9,16%	0,40
Caixa Brasil 2020 III	20.139.342/0001-02	19,71	1,05%	1,05%	9,10%	0,20
BB Prev TP RF IPCA X	20.734.931/0001-20	19,27	1,87%	1,87%	10,47%	0,20
Itaú Inst. Tit. P. Renda Fixa	18.687.230/0001-36	16,74	0,62%	0,62%	6,18%	0,20
BB Perfil	13.077.418/0001-49	16,68	0,53%	0,53%	6,29%	0,20
Itaú Inflação 5	09.093.819/0001-15	15,84	1,50%	1,50%	9,63%	0,18
Bradesco IMAB 5	20.216.216/0001-04	12,98	1,58%	1,58%	9,90%	0,20
BB Prev TP RF IPCA VI	19.523.306/0001-50	7,03	2,09%	2,09%	11,11%	0,20
BB IDKA 2	13.322.205/0001-35	0,61	1,22%	1,22%	9,50%	0,20
BB Aloc Ativa	25.078.994/0001-90	0,40	2,01%	2,01%	10,21%	0,30
Safra Executive 2	10.787.647/0001-69	0,08	0,60%	0,60%	7,20%	0,50
<b>Total</b>		<b>1.224,32</b>				

## COMPOSIÇÃO DAS APLICAÇÕES POR BENCHMARK

Fundos	Participação	R\$ (milhões)
DI	40,11%	491,04
IMA Geral	4,34%	53,13
IMA B	7,68%	94,03
IMA B 5	23,86%	292,15
IMA B 5+	20,08%	245,84
IRFM1	0,01%	0,08
IRFM	2,15%	26,33
IDKA 2 IPCA	0,05%	0,61
IDKA 2 Pré	1,73%	21,12
<b>TOTAL</b>	<b>100,00%</b>	<b>1.224,32</b>

## DISTRIBUIÇÃO DAS CARTEIRAS DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

<b>Instuição</b>	<b>Participação</b>	<b>R\$ (milhões)</b>
<b>Bradesco</b>	<b>7,84%</b>	<b>96,01</b>
<b>Caixa</b>	<b>41,25%</b>	<b>505,06</b>
<b>BB</b>	<b>21,10%</b>	<b>258,34</b>
<b>Itaú</b>	<b>12,72%</b>	<b>155,74</b>
<b>Safra</b>	<b>0,01%</b>	<b>0,08</b>
<b>Santander</b>	<b>17,08%</b>	<b>209,09</b>
<b>TOTAL</b>	<b>100,00%</b>	<b>1.224,32</b>

### COMITÊ DE INVESTIMENTO – JANEIRO 2019

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 janeiro de 2019, na Sede Administrativa, à Rua da Quitanda nº 106 – Centro - Rio de Janeiro, foi aprovada a seguinte proposta para o mês de janeiro:

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 (IRFM1, IRFM, IRFM1+);
- Fundos DI.

Em caso de entrada de novos recursos ou realocação, após verificação de que o cenário econômico apresenta efetiva oportunidade, sugere-se que até 18% do total alocado nos Fundo Previdenciário seja redirecionado para aplicações em Fundos atrelados à Inflação (IMA/IDKA), Fundos Pré Fixados (IRFM1, IRFM, IFM1+) e Fundos Estratégia Mista (CDI, IRFM e IMA) conforme possibilidades dadas pela conjuntura.