

2019



Relatório Mensal de Investimentos

Fundos Financeiro e Previdenciário

FEVEREIRO



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
Níckolas Ribeiro da Costa Cardoso
Pedro Daflon Fraiz

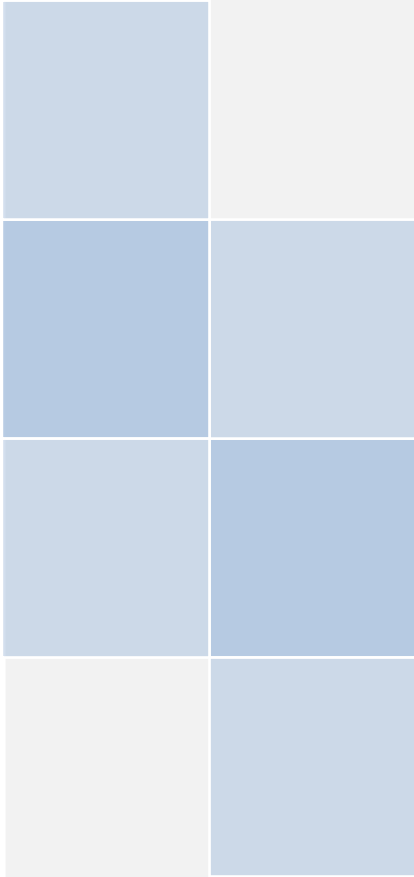
Fundo Único de Previdência do Estado do Rio de Janeiro – RIOPREVIDÊNCIA

Rua da Quitanda nº 106

20091-005 – Centro – Rio de Janeiro – RJ

Telefone: (21) 2332-5757

Home page: 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
		28/02/2019	Mês	Ano	12 meses	Adm
BB Referenciado	11.046.645/000	83,75	0,48%	1,02%	6,30%	0,10
Itaú Soberano	06.175.696/000	6,61	0,48%	1,01%	6,25%	0,15
Bradesco - Federal Extra	03.256.793/000	4,85	0,48%	1,01%	6,22%	0,15
Caixa - FI Brasil TP RF LF	05.164.356/000	0,68	0,47%	1,00%	6,16%	0,20
Bradesco - Premium DI	03.399.411/000	0,38	0,48%	1,02%	6,28%	0,20
Caixa - FI Brasil DI	03.737.206/000	0,36	0,48%	1,01%	6,23%	0,20
Itaú Institucional	00.832.435/000	0,25	0,49%	1,02%	6,27%	0,18
BB Institucional	02.296.928/000	0,23	0,50%	1,04%	6,64%	0,20
Santander Corporate	03.069.104/000	0,22	0,50%	1,05%	6,36%	0,20
Santander FIC REF DI	02.224.354/000	0,22	0,52%	1,07%	6,38%	0,20
Bradesco RF REF DI LP	00.975.480/000	0,01	0,48%	1,01%	6,22%	0,15
BTG Master Cash	09.215.250/000	0,00	0,48%	1,01%	6,18%	0,20
Total		97,57				

COMPOSIÇÃO DAS APLICAÇÕES POR BENCHMARK

Fundos	Participação	R\$ (milhões)
DI	100,00%	97,57
IMAB	0,00%	-
IMAB 5	0,00%	-
IMAB 5+	0,00%	-
IRFM	0,00%	-
IDKA 2 Pré	0,00%	-
TOTAL	100,00%	97,57

DISTRIBUIÇÃO DAS CARTEIRAS DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instuição	Participação	R\$ (milhões)
Bradesco	5,38%	5,25
Caixa	1,07%	1,04
BB	86,07%	83,98
Itaú	7,03%	6,86
Santander	0,45%	0,44
TOTAL	100,00%	97,57

COMITÊ DE INVESTIMENTO – FEVEREIRO 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 06 de fevereiro de 2019, na Sede Administrativa, à Rua da Quitanda nº 106 – Centro - Rio de Janeiro, foi aprovada a seguinte proposta para o mês de dezembro:

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
		28/02/2019	Mês	Ano	12 Meses	Adm
			%	%	%	% a.a
Caixa Brasil 2024 IV	20.139.595/0001-78	153,97	0,36%	2,79%	10,98%	0,20
Caixa IMAB TP RF	10.740.658/0001-93	127,02	0,52%	4,93%	13,92%	0,20
BB PREV IMAB TP	07.442.078/0001-05	111,28	0,50%	4,87%	13,78%	0,20
Santander FIC IMA B	14.504.578/0001-90	94,55	0,53%	4,89%	13,82%	0,20
Itaú Instucional DI	00.832.435/0001-00	84,76	0,49%	1,02%	6,27%	0,18
Caixa Brasil TP RF LP	05.164.356/0001-84	74,95	0,47%	1,00%	6,16%	0,20
Bradesco - Premium DI	03.399.411/0001-90	63,24	0,48%	1,02%	6,28%	0,20
BB Prev TP RF IPCA I	19.303.793/0001-46	60,70	0,49%	2,44%	10,68%	0,15
Caixa Brasil 2030 III	20.139.534/0001-00	56,47	0,65%	5,69%	14,64%	0,20
BB Prev TP RF IPCA	15.486.093/0001-83	42,98	0,33%	2,47%	10,96%	0,15
Caixa Brasil 2020 IV	21.919.953/0001-28	36,17	0,54%	1,60%	8,99%	0,20
Santander FIC FI	02.224.354/0001-45	34,38	0,52%	1,07%	6,38%	0,20
Itaú Aloc Dinâmica II	25.306.703/0001-73	32,68	0,34%	2,72%	8,73%	0,40
BB IMAB 5	03.543.447/0001-03	31,53	0,52%	2,05%	9,88%	0,20
Caixa Brasil 2024 VI	22.791.074/0001-26	30,73	0,36%	2,78%	10,96%	0,20
BB Prev TP RF IPCA XI	24.117.278/0001-01	26,84	0,49%	2,43%	10,67%	0,20
BB IRF-M	07.111.384/0001-69	26,40	0,28%	1,64%	9,71%	0,20
Bradesco IDKA	24.022.566/0001-82	21,17	0,25%	1,54%	10,61%	0,20
BB Ref DI TP	11.046.645/0001-81	21,00	0,48%	1,02%	6,30%	0,10
Itaú Aloc Dinâmica	21.838.150/0001-49	20,22	0,34%	2,72%	8,73%	0,40
Caixa Brasil 2020 III	20.139.342/0001-02	19,28	0,54%	1,59%	8,97%	0,20
BB Prev TP RF IPCA X	20.734.931/0001-20	18,86	0,45%	2,33%	10,36%	0,20
Itaú Inst. Tit. P. Renda Fixa	18.687.230/0001-36	16,86	0,72%	1,35%	6,59%	0,20
Itaú Inflação 5	09.093.819/0001-15	15,93	0,51%	2,02%	9,64%	0,18
Bradesco IMAB 5	20.216.216/0001-04	13,04	0,49%	2,07%	9,81%	0,20
BB Prev TP RF IPCA VI	19.523.306/0001-50	6,88	0,44%	2,54%	11,01%	0,20
BB Perfil	13.077.418/0001-49	6,73	0,48%	1,02%	6,31%	0,20
Caixa - FI Brasil DI	03.737.206/0001-97	3,18	0,48%	1,01%	6,23%	0,20
BB IDKA 2	13.322.205/0001-35	0,61	0,61%	1,83%	9,55%	0,20
BB Aloc Ativa	25.078.994/0001-90	0,40	0,39%	2,40%	9,81%	0,30
Safra Executive 2	10.787.647/0001-69	0,08	0,41%	1,01%	6,94%	0,50
Total		1.252,91				

COMPOSIÇÃO DAS APLICAÇÕES POR BENCHMARK

Fundos	Participação	R\$ (milhões)
DI	23,01%	288,25
IMA Geral	4,25%	53,31
IMA B	26,57%	332,85
IMA B 5	23,07%	289,07
IMA B 5+	19,25%	241,17
IRFM1	0,01%	0,08
IRFM	2,11%	26,40
IDKA 2 IPCA	0,05%	0,61
IDKA 2 Pré	1,69%	21,17
TOTAL	100,00%	1.252,91

DISTRIBUIÇÃO DAS CARTEIRAS DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instuição	Participação	R\$ (milhões)
Bradesco	7,78%	97,46
Caixa	40,05%	501,77
BB	28,27%	354,22
Itaú	13,60%	170,45
Safra	0,01%	0,08
Santander	10,29%	128,93
TOTAL	100,00%	1.252,91

COMITÊ DE INVESTIMENTO – FEVEREIRO 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 06 de fevereiro de 2019, na Sede Administrativa, à Rua da Quitanda nº 106 – Centro - Rio de Janeiro, foi aprovada a seguinte proposta para o mês de dezembro:

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 20% do total alocado nos Fundos DI 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.