

2019



Relatório Mensal de Investimentos

Fundos Financeiro e Previdenciário

ABRIL



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
Eduardo Alfradique de Oliveira
Flávio Carramanhos Werneck
Michelle Caldas Bouhid
Níckolas Ribeiro da Costa Cardoso
Pedro Daflon Fraiz

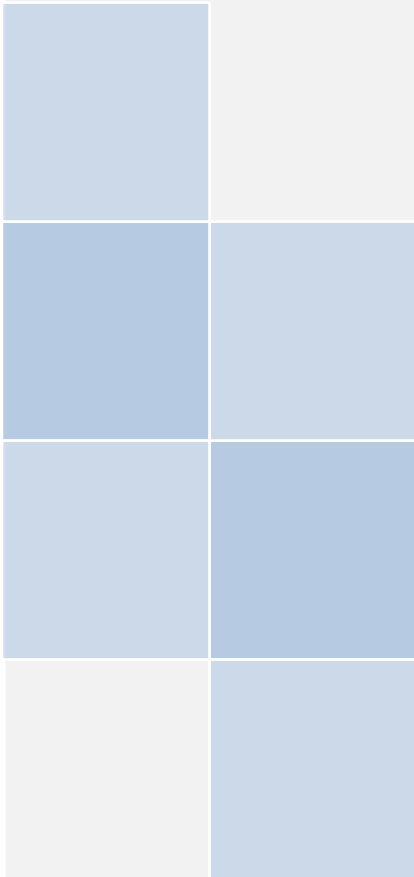
Fundo Único de Previdência do Estado do Rio de Janeiro – RIOPREVIDÊNCIA

Rua da Quitanda nº 106

20091-005 – Centro – Rio de Janeiro – RJ

Telefone: (21) 2332-5151

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. | Taxa |
| | | 30/04/2019 | Mês | Ano | 12 meses | Adm. |
| | | | (%) | (%) | (%) | (% a.a.) |
| Santander FIC REF DI | 02.224.354/0001-45 | 305,15 | 0,51% | 2,06% | 6,32% | 0,20 |
| Itaú Soberano | 06.175.696/0001-73 | 138,03 | 0,51% | 1,99% | 6,19% | 0,15 |
| BB Institucional | 02.296.928/0001-90 | 124,43 | 0,51% | 2,03% | 6,56% | 0,20 |
| BB Referenciado | 11.046.645/0001-81 | 91,65 | 0,51% | 2,00% | 6,23% | 0,10 |
| Bradesco - Federal Extra | 03.256.793/0001-00 | 4,15 | 0,50% | 1,98% | 6,15% | 0,15 |
| Caixa - FI Brasil TP RF LP | 05.164.356/0001-84 | 0,85 | 0,52% | 1,99% | 6,12% | 0,20 |
| Bradesco - Premium DI | 03.399.411/0001-90 | 0,39 | 0,51% | 2,01% | 6,23% | 0,20 |
| Caixa - FI Brasil DI | 03.737.206/0001-97 | 0,36 | 0,51% | 2,00% | 6,18% | 0,20 |
| Itaú Institucional | 00.832.435/0001-00 | 0,25 | 0,51% | 2,00% | 6,21% | 0,18 |
| Santander Corporate | 03.069.104/0001-40 | 0,23 | 0,51% | 2,04% | 6,30% | 0,20 |
| Bradesco RF REF DI LP | 00.975.480/0001-06 | 0,01 | 0,50% | 1,97% | 6,15% | 0,15 |
| BTG Master Cash | 09.215.250/0001-13 | 0,00 | 0,50% | 1,98% | 6,13% | 0,20 |
| Total | | 665,49 | | | | |

COMPOSIÇÃO DAS APLICAÇÕES POR BENCHMARK

| Fundos | Participação | R\$ (milhões) |
|--------------|----------------|---------------|
| DI | 100,00% | 665,49 |
| IMA B | 0,00% | - |
| IMA B 5 | 0,00% | - |
| IMA B 5+ | 0,00% | - |
| IRFM | 0,00% | - |
| IDKA 2 Pré | 0,00% | - |
| TOTAL | 100,00% | 665,49 |

DISTRIBUIÇÃO DAS CARTEIRAS DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

| Instituição | Participação | R\$ (milhões) |
|--------------|----------------|---------------|
| Bradesco | 0,68% | 4,54 |
| Caixa | 0,18% | 1,22 |
| BB | 32,47% | 216,07 |
| Itaú | 20,78% | 138,28 |
| BTG | 0,00% | 0,00 |
| Santander | 45,89% | 305,37 |
| TOTAL | 100,00% | 665,49 |

COMITÊ DE INVESTIMENTO – ABRIL 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 17 de abril de 2019, na Sede Administrativa, à Rua da Quitanda nº 106 – Centro - Rio de Janeiro, foi aprovada a seguinte proposta para o período que compreende de 18/04 a 14/05 de 2019:

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

| Em R\$ milhões | | Fundo Previdenciário | | | | |
|-------------------------------|--------------------|------------------------|--------------|--------------|-------------------|--------------|
| Fundo de Investimento | CNPJ | Saldo em 30/04/2019 | Rent. Mês | Rent. Ano | Rent. 12 meses | Taxa Adm. |
| | | | % | % | % | % a.a. |
| Caixa Brasil 2024 IV | 20.139.595/0001-78 | 157,21 | 1,18% | 4,95% | 11,21% | 0,20 |
| Caixa IMAB TP RF | 10.740.658/0001-93 | 129,64 | 1,49% | 7,09% | 15,40% | 0,20 |
| BB PREV IMAB TP | 07.442.078/0001-05 | 113,57 | 1,50% | 7,04% | 15,27% | 0,20 |
| Itaú Instucional DI | 00.832.435/0001-00 | 109,44 | 0,51% | 2,00% | 6,21% | 0,18 |
| Santander FIC IMA B | 14.504.578/0001-90 | 96,49 | 1,49% | 7,04% | 15,30% | 0,20 |
| Caixa Brasil TP RF LP | 05.164.356/0001-84 | 75,68 | 0,52% | 1,99% | 6,12% | 0,20 |
| BB Prev TP RF IPCA I | 19.303.793/0001-46 | 61,95 | 1,26% | 4,55% | 10,43% | 0,15 |
| Caixa Brasil 2030 III | 20.139.534/0001-00 | 57,55 | 1,32% | 7,71% | 16,39% | 0,20 |
| Santander FIC FI | 02.224.354/0001-45 | 55,84 | 0,51% | 2,06% | 6,32% | 0,20 |
| BB Prev TP RF IPCA | 15.486.093/0001-83 | 43,89 | 1,12% | 4,66% | 11,13% | 0,15 |
| Bradesco - Premium DI | 03.399.411/0001-90 | 43,52 | 0,51% | 2,01% | 6,23% | 0,20 |
| Itaú Inflação 5 | 09.093.819/0001-15 | 37,69 | 1,09% | 3,92% | 9,51% | 0,18 |
| Caixa Brasil 2020 IV | 21.919.953/0001-28 | 36,73 | 0,94% | 3,16% | 7,88% | 0,20 |
| Itaú Aloc Dinâmica II | 25.306.703/0001-73 | 33,03 | 0,66% | 3,81% | 8,41% | 0,40 |
| BB IMAB 5 | 03.543.447/0001-03 | 32,11 | 1,09% | 3,94% | 9,71% | 0,20 |
| Caixa Brasil 2024 VI | 22.791.074/0001-26 | 31,38 | 1,18% | 4,95% | 11,20% | 0,20 |
| BB Prev TP RF IPCA XI | 24.117.278/0001-01 | 27,39 | 1,25% | 4,53% | 10,47% | 0,20 |
| BB IRF-M | 07.111.384/0001-69 | 26,71 | 0,59% | 2,82% | 9,10% | 0,20 |
| Bradesco IDKA | 24.022.566/0001-82 | 21,41 | 0,58% | 2,68% | 9,32% | 0,20 |
| BB Ref DI TP | 11.046.645/0001-81 | 21,21 | 0,51% | 2,00% | 6,23% | 0,10 |
| Itaú Aloc Dinâmica | 21.838.150/0001-49 | 20,43 | 0,66% | 3,80% | 8,41% | 0,40 |
| Caixa Brasil 2020 III | 20.139.342/0001-02 | 19,58 | 0,94% | 3,15% | 7,86% | 0,20 |
| BB Prev TP RF IPCA X | 20.734.931/0001-20 | 19,23 | 1,15% | 4,32% | 10,04% | 0,20 |
| Itaú Inst. Tit. P. Renda Fixa | 18.687.230/0001-36 | 17,11 | 0,85% | 2,90% | 6,73% | 0,20 |
| Bradesco IMAB 5 | 20.216.216/0001-04 | 13,28 | 1,07% | 3,92% | 9,56% | 0,20 |
| BB Prev TP RF IPCA VI | 19.523.306/0001-50 | 7,02 | 1,23% | 4,67% | 10,85% | 0,20 |
| BB Perfil | 13.077.418/0001-49 | 6,80 | 0,51% | 2,00% | 6,22% | 0,20 |
| Caixa - FI Brasil DI | 03.737.206/0001-97 | 3,21 | 0,51% | 2,00% | 6,18% | 0,20 |
| BB IDKA 2 | 13.322.205/0001-35 | 0,62 | 1,10% | 3,62% | 9,10% | 0,20 |
| BB Aloc Ativa | 25.078.994/0001-90 | 0,41 | 0,87% | 3,83% | 10,00% | 0,30 |
| Safra Executive 2 | 10.787.647/0001-69 | 0,08 | 0,49% | 1,93% | 6,57% | 0,50 |
| Total | | 1.320,24 | | | | |

COMPOSIÇÃO DAS APLICAÇÕES POR BENCHMARK

| Fundos | Participação | R\$ (milhões) |
|-------------|--------------|---------------|
| DI | 23,91% | 315,70 |
| IMA Geral | 4,08% | 53,87 |
| IMA B | 25,73% | 339,70 |
| IMA B 5 | 23,93% | 315,99 |
| IMA B 5+ | 18,64% | 246,14 |
| IRFM1 | 0,01% | 0,08 |
| IRFM | 2,02% | 26,71 |
| IDKA 2 IPCA | 0,05% | 0,62 |
| IDKA 2 Pré | 1,62% | 21,41 |
| TOTAL | 100,00% | 1.320,24 |

DISTRIBUIÇÃO DAS CARTEIRAS DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

| Instituição | Participação | R\$ (milhões) |
|-------------|--------------|---------------|
| Bradesco | 5,92% | 78,21 |
| Caixa | 38,70% | 510,97 |
| BB | 27,34% | 360,92 |
| Itaú | 16,49% | 217,72 |
| Safra | 0,01% | 0,08 |
| Santander | 11,54% | 152,33 |
| TOTAL | 100,00% | 1.320,24 |

COMITÊ DE INVESTIMENTO – ABRIL 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 17 de abril de 2019, na Sede Administrativa, à Rua da Quitanda nº 106 – Centro - Rio de Janeiro, foi aprovada a seguinte proposta para o período que compreende 18/04 a 14/05 de 2019:

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 a seguinte estratégia: alocação de novos ingressos de recursos em Fundos IMA-B5 e realocação dos recursos dos fundos IMA-B para fundos IMA-B5 ou IDKA 2 IPCA limitados a 15% do valor da Carteira.