

2019



# Relatório Mensal de Investimentos

Fundos Financeiro e Previdenciário

OUTUBRO



## **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**  
**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 Administrativo



## ALOCAÇÃO DOS RECURSOS Fundos de Investimentos

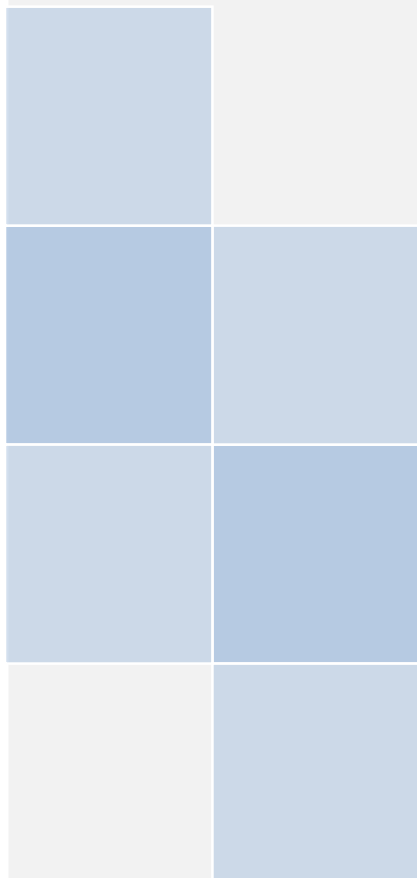
Em R\$ milhões		Fundo Administrativo				
Fundo de Investimento	CNPJ	Saldo em 31/10/2019	Rent. Mês %	Rent. Ano %	Rent. 12 meses %	Taxa Adm. % a.a.
Bradesco - Federal Extra	03.256.793/0001-00	30,40	0,47%	5,02%	6,02%	0,15
<b>Total</b>		<b>30,40</b>				

### COMITÊ DE INVESTIMENTO – OUTUBRO/2019

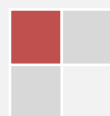
Conforme a Ata da Reunião do Comitê de Investimento do Fundo Único de Previdência Social do Estado do Rio de Janeiro – Rioprevidência, realizado no dia 15 de outubro de 2019, na Sede Administrativa, à Rua da Quitanda nº 106 – Centro - Rio de Janeiro, foi aprovada a seguinte proposta para o período que compreende de 16/10 a 18/11 de 2019:

Fundo Administrativo:

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 Financeiro



## ALOCAÇÃO DOS RECURSOS Fundos de Investimentos

Em R\$ milhões		Fundo Financeiro				
Fundo de Investimento	CNPJ	Saldo em	Rent.	Rent.	Rent.	Taxa
		31/10/2019	Mês	Ano	12 meses	Adm.
			%	%	%	% a.a.
BB Referenciado	11.046.645/0001-81	79,03	0,47%	5,08%	6,10%	0,10
Caixa - FI Brasil TP RF LP	05.164.356/0001-84	73,56	0,50%	5,17%	6,18%	0,20
Bradesco - Federal Extra	03.256.793/0001-00	4,93	0,47%	5,02%	6,02%	0,15
Itaú Soberano	06.175.696/0001-73	3,40	0,47%	5,04%	6,05%	0,15
Bradesco - Premium DI	03.399.411/0001-90	3,34	0,46%	5,09%	6,12%	0,20
Itaú Institucional	00.832.435/0001-00	3,24	0,46%	5,05%	6,06%	0,18
Santander FIC REF DI	02.224.354/0001-45	1,50	0,42%	5,09%	6,15%	0,20
Caixa - FI Brasil DI	03.737.206/0001-97	0,81	0,45%	5,02%	6,04%	0,20
BB Institucional	02.296.928/0001-90	0,22	0,43%	5,09%	6,10%	0,20
Santander Corporate	03.069.104/0001-40	0,18	0,42%	5,07%	6,12%	0,20
Bradesco RF REF DI LP	00.975.480/0001-06	0,01	0,46%	5,00%	6,00%	0,15
BTG Master Cash	09.215.250/0001-13	0,00	0,46%	5,01%	6,01%	0,20
<b>Total</b>		<b>170,22</b>				

### COMPOSIÇÃO DAS APLICAÇÕES POR BENCHMARK

Fundos	Participação	R\$ (milhões)
DI	100,00%	170,22
IMA Geral	0,00%	-
IMA B	0,00%	-
IMA B 5	0,00%	-
IMA B 5+	0,00%	-
IRFM1	0,00%	-
IRFM	0,00%	-
IDKA 2 IPCA	0,00%	-
IDKA 2 Pré	0,00%	-
<b>TOTAL</b>	<b>100,00%</b>	<b>170,22</b>

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

Instituição	Participação	R\$ (milhões)
Bradesco	4,86%	8,27
Caixa	43,69%	74,37
BB	46,56%	79,25
Itaú	3,90%	6,64
BTG	0,00%	0,00
Santander	0,99%	1,69
<b>TOTAL</b>	<b>100,00%</b>	<b>170,22</b>

## **COMITÊ DE INVESTIMENTO – OUTUBRO/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 15 de outubro 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 16/10 a 18/11 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 31/10/2019	Rent. Mês	Rent. Ano	Rent. 12 meses	Taxa Adm.
			%	%	%	% a.a.
Itaú Inflação 5	09.093.819/0001-15	233,84	1,63%	11,84%	13,46%	0,18
Caixa Brasil 2024 IV	20.139.595/0001-78	170,39	2,39%	16,92%	19,17%	0,20
Santander FIC FI	02.224.354/0001-45	123,96	0,42%	5,09%	6,15%	0,20
Santander FIC IMA B	14.504.578/0001-90	111,11	3,34%	23,26%	26,43%	0,20
Santander FIC IMA B-5	13.455.117/0001-01	93,08	1,63%	11,88%	13,53%	0,20
Itaú Instucional DI	00.832.435/0001-00	82,60	0,46%	5,05%	6,06%	0,18
Bradesco IDKA	24.022.566/0001-82	79,33	1,61%	11,45%	14,35%	0,20
Caixa IDKA IPCA 2	14.386.926/0001-71	69,92	1,28%	9,97%	11,39%	0,20
Caixa Brasil 2030 III	20.139.534/0001-00	65,43	3,35%	25,17%	28,12%	0,20
BB Prev TP RF IPCA I	19.303.793/0001-46	65,41	1,64%	13,25%	15,44%	0,15
BB IDKA 2	13.322.205/0001-35	53,36	1,24%	9,71%	11,17%	0,20
BB Prev TP RF IPCA	15.486.093/0001-83	46,96	1,98%	14,92%	17,27%	0,15
Caixa IMAB TP RF	10.740.658/0001-93	39,86	3,33%	23,33%	26,47%	0,20
Caixa Brasil 2020 IV	21.919.953/0001-28	37,05	0,74%	6,89%	8,00%	0,20
BB IMAB 5	03.543.447/0001-03	34,57	1,64%	11,90%	13,56%	0,20
Caixa Brasil 2024 VI	22.791.074/0001-26	34,13	2,39%	16,94%	19,18%	0,20
BB IRF-M	07.111.384/0001-69	29,00	1,68%	11,65%	14,44%	0,20
BB Prev TP RF IPCA XI	24.117.278/0001-01	28,92	1,63%	13,18%	15,36%	0,20
Caixa Brasil TP RF LP	05.164.356/0001-84	26,69	0,50%	5,17%	6,18%	0,20
Bradesco - Premium DI	03.399.411/0001-90	22,75	0,46%	5,09%	6,12%	0,20
BB Ref DI TP	11.046.645/0001-81	21,84	0,47%	5,08%	6,10%	0,10
BB PREV IMAB TP	07.442.078/0001-05	21,77	3,35%	23,33%	26,46%	0,20
BB Prev TP RF IPCA X	20.734.931/0001-20	20,28	1,68%	12,85%	14,76%	0,20
Caixa Brasil 2020 III	20.139.342/0001-02	19,75	0,74%	6,88%	7,98%	0,20
Bradesco IMAB 5	20.216.216/0001-04	14,31	1,69%	11,99%	13,68%	0,20
BB Prev TP RF IPCA VI	19.523.306/0001-50	7,49	1,89%	14,43%	16,63%	0,20
BB Perfil	13.077.418/0001-49	7,00	0,44%	5,01%	6,02%	0,20
Caixa - FI Brasil DI	03.737.206/0001-97	3,31	0,45%	5,02%	6,04%	0,20
BB Aloc Ativa	25.078.994/0001-90	0,44	1,80%	13,06%	15,25%	0,30
Safra Executive 2	10.787.647/0001-69	0,09	0,59%	5,80%	7,20%	0,50
Itaú Aloc Dinâmica	21.838.150/0001-49	0,02	0,50%	11,14%	13,66%	0,40
<b>Total</b>		<b>1564,65</b>				

## COMPOSIÇÃO DAS APLICAÇÕES POR BENCHMARK

Fundos	Participação	R\$ (milhões)
DI	18,42%	288,16
IMA Geral	0,03%	0,46
IMA B	11,04%	172,73
IMA B 5	38,45%	601,66
IMA B 5+	17,25%	269,95
IRFM1	0,01%	0,09
IRFM	1,85%	29,00
IDKA 2 IPCA	7,88%	123,28
IDKA 2 Pré	5,07%	79,33
TOTAL	100,00%	1.564,65

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

Instituição	Participação	R\$ (milhões)
Bradesco	7,44%	116,39
Caixa	29,82%	466,51
BB	21,54%	337,05
Itaú	20,23%	316,46
Safra	0,01%	0,09
Santander	20,97%	328,15
TOTAL	100,00%	1.564,65

## COMITÊ DE INVESTIMENTO – OUTUBRO 2019

Ao décimo quinto dia do mês de outubro de dois mil e dezenove, às quinze horas, reuniu-se o Comitê de Investimentos do Fundo Único de Previdência Social do Estado do Rio de Janeiro - Rioprevidência – na sua sede, à Rua da Quitanda número cento e seis, terceiro andar, Centro, Rio de Janeiro. Presentes os senhores Aloisio Villeth Lemos (Diretor de Investimentos e Presidente do Comitê), Kelli Manhães Pessanha, Eduardo Alfradique de Oliveira, Leonardo Monteiro Magalhães e Jairo Monteiro de Freitas, todos membros designados pelo Diretor de Investimentos. A reunião transcorreu com a seguinte pauta: **Item Um. Análise da proposta vigente durante o período de 13 de setembro de 2019 a 15 de outubro de 2019. Item Dois. Fluxo de Caixa do Fundo Previdenciário. Item Três. Apresentação da Carteira de Investimentos Consolidada. Item Quatro. Panorama Econômico. Item Cinco. Proposta Mensal de Investimentos (período entre 16 de outubro a 18 de novembro).** Diante da ausência dos demais membros votantes do Comitê (respectivos representantes da Secretária de Estado de Fazenda e da Secretaria de Planejamento e Gestão, atualmente pertencente à Casa Civil), estava presente apenas, como membro votante, o Sr. Aloisio Villeth Lemos, Diretor de Investimentos do Rioprevidência. O diretor declarou a impossibilidade de realizar a deliberação, tomando por base o Parecer/RIOPREV/CCN nº 118/2019 – TSFC, que, em seu item 3. *Conclusão*, dispõe que “*tendo em vista a ausência de previsão legal para o voto de um único membro, bem como a necessidade de submissão da Administração à legalidade, conclui-se, s.m.j., pela impossibilidade de decisão monocrática no âmbito do Comitê de Investimentos*”. Sendo assim, foram mantidos os critérios de alocação de recursos definidos na última deliberação do comitê em que houve quórum entre os membros votantes. Não havendo mais nada a tratar, o senhor Aloisio Villeth Lemos, em comum acordo com o corpo técnico da Gerência de Operações e Planejamento, encerrou a reunião, e eu, Kelli Manhães Pessanha, Gerente de Operações e Planejamento, lavrei a presente ata que será assinada por mim e pelos demais membros participantes da reunião.