

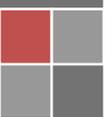
2019



Relatório Mensal de Investimentos

Fundos Financeiro e Previdenciário

NOVEMBRO



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

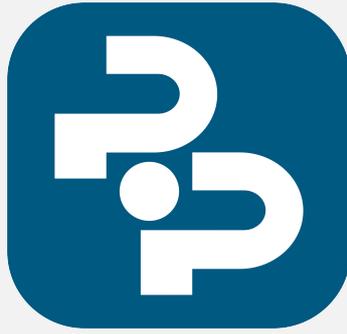
Fundo Único de Previdência do Estado do Rio de Janeiro – RIOPREVIDÊNCIA

Rua da Quitanda nº 106

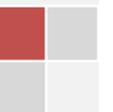
20091-005 – Centro – Rio de Janeiro – RJ

Telefone: (21) 2332-5151

Home page: www.rioprevidencia.rj.gov.br



Fundo Administrativo



ALOCAÇÃO DOS RECURSOS Fundos de Investimentos

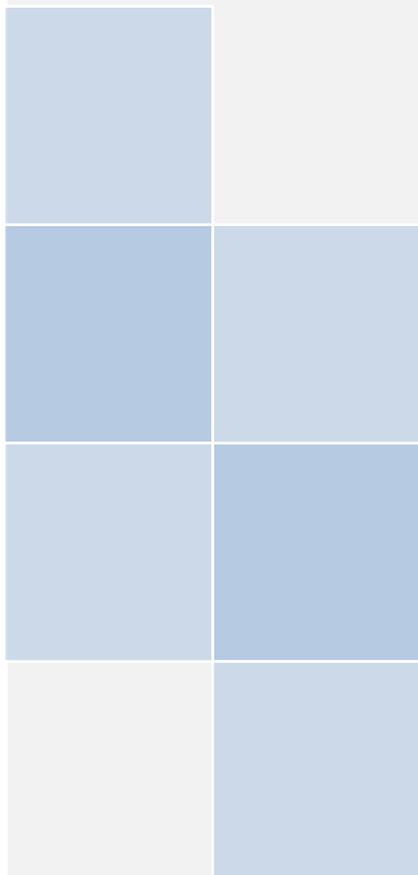
Em R\$ milhões		Fundo Administrativo				
Fundo de Investimento	CNPJ	Saldo em 29/11/2019	Rent. Mês %	Rent. Ano %	Rent. 12 meses %	Taxa Adm. % a.a.
Bradesco - Federal Extra	03.256.793/0001-00	14,43	0,37%	5,40%	5,90%	0,15
Total		14,43				

COMITÊ DE INVESTIMENTO – NOVEMBRO/2019

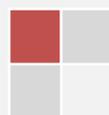
Conforme a Ata da Reunião do Comitê de Investimento do Fundo Único de Previdência Social do Estado do Rio de Janeiro – Rioprevidência, realizado no dia 18 de novembro de 2019, na Sede Administrativa, à Rua da Quitanda nº 106 – Centro - Rio de Janeiro, foi aprovada a seguinte proposta para o período que compreende de 19/11 a 18/12 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
		29/11/2019	Mês	Ano	12 meses	Adm.
			%	%	%	% a.a.
BB Referenciado	11.046.645/0001-81	90,29	0,37%	5,47%	5,98%	0,10
Itaú Soberano	06.175.696/0001-73	30,46	0,37%	5,43%	5,94%	0,15
Caixa - FI Brasil TP RF LP	05.164.356/0001-84	11,37	0,33%	5,52%	6,03%	0,20
Itaú Institucional	00.832.435/0001-00	9,50	0,35%	5,41%	5,92%	0,18
Bradesco - Premium DI	03.399.411/0001-90	2,82	0,33%	5,45%	5,96%	0,20
Santander FIC REF DI	02.224.354/0001-45	1,51	0,31%	5,42%	5,95%	0,20
Caixa - FI Brasil DI	03.737.206/0001-97	0,81	0,31%	5,34%	5,85%	0,20
Bradesco - Federal Extra	03.256.793/0001-00	0,26	0,37%	5,40%	5,90%	0,15
BB Institucional	02.296.928/0001-90	0,22	0,33%	5,44%	5,93%	0,20
Santander Corporate	03.069.104/0001-40	0,18	0,32%	5,41%	5,93%	0,20
Bradesco RF REF DI LP	00.975.480/0001-06	0,01	0,36%	5,38%	5,88%	0,15
BTG Master Cash	09.215.250/0001-13	0,00	0,36%	5,39%	5,89%	0,20
Total		147,42				

COMPOSIÇÃO DAS APLICAÇÕES POR BENCHMARK

Fundos	Participação	R\$ (milhões)
DI	100,00%	147,42
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%	-
TOTAL	100,00%	147,42

DISTRIBUIÇÃO DAS CARTEIRAS DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição	Participação	R\$ (milhões)
Bradesco	2,09%	3,08
Caixa	8,26%	12,18
BB	61,39%	90,51
Itaú	27,11%	39,96
BTG	0,00%	0,00
Santander	1,15%	1,69
TOTAL	100,00%	147,42

COMITÊ DE INVESTIMENTO – NOVEMBRO/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 18 de novembro 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 19/11 a 18/12 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 29/11/2019	Rent. Mês %	Rent. Ano %	Rent. 12 meses %	Taxa Adm. % a.a.
Itaú Inflação 5	09.093.819/0001-15	233,15	-0,30%	11,51%	13,00%	0,18
Caixa Brasil 2024 IV	20.139.595/0001-78	168,71	-0,99%	15,77%	17,86%	0,20
Santander FIC FI	02.224.354/0001-45	124,35	0,31%	5,42%	5,95%	0,20
Santander FIC IMA B	14.504.578/0001-90	108,36	-2,48%	20,20%	22,20%	0,20
Itaú Instucional DI	00.832.435/0001-00	107,92	0,35%	5,41%	5,92%	0,18
Santander FIC IMA B-5	13.455.117/0001-01	92,80	-0,30%	11,54%	13,04%	0,20
Bradesco IDKA	24.022.566/0001-82	79,01	-0,40%	11,01%	12,85%	0,20
Caixa IDKA IPCA 2	14.386.926/0001-71	69,93	0,01%	9,98%	11,25%	0,20
BB Prev TP RF IPCA I	19.303.793/0001-46	65,16	-0,38%	12,82%	14,66%	0,15
Caixa Brasil 2030 III	20.139.534/0001-00	63,71	-2,63%	21,88%	23,62%	0,20
BB IDKA 2	13.322.205/0001-35	53,47	0,21%	9,94%	11,28%	0,20
BB Prev TP RF IPCA	15.486.093/0001-83	45,48	-0,75%	14,06%	16,24%	0,15
Caixa IMAB TP RF	10.740.658/0001-93	38,84	-2,54%	20,20%	22,16%	0,20
Caixa Brasil 2020 IV	21.919.953/0001-28	37,37	0,87%	7,82%	8,82%	0,20
BB IMAB 5	03.543.447/0001-03	34,46	-0,31%	11,56%	13,06%	0,20
Caixa Brasil 2024 VI	22.791.074/0001-26	33,80	-0,99%	15,78%	17,87%	0,20
BB IRF-M	07.111.384/0001-69	28,86	-0,47%	11,12%	12,80%	0,20
BB Prev TP RF IPCA XI	24.117.278/0001-01	28,81	-0,38%	12,75%	14,58%	0,20
Caixa Brasil TP RF LP	05.164.356/0001-84	26,79	0,33%	5,52%	6,03%	0,20
Bradesco - Premium DI	03.399.411/0001-90	22,83	0,33%	5,45%	5,96%	0,20
BB Ref DI TP	11.046.645/0001-81	21,93	0,37%	5,47%	5,98%	0,10
BB PREV IMAB TP	07.442.078/0001-05	21,23	-2,48%	20,27%	22,21%	0,20
BB Prev TP RF IPCA X	20.734.931/0001-20	20,22	-0,29%	12,52%	14,21%	0,20
Caixa Brasil 2020 III	20.139.342/0001-02	19,92	0,87%	7,80%	8,81%	0,20
Bradesco IMAB 5	20.216.216/0001-04	14,25	-0,39%	11,55%	13,07%	0,20
BB Prev TP RF IPCA VI	19.523.306/0001-50	7,44	-0,59%	13,76%	15,67%	0,20
BB Perfil	13.077.418/0001-49	7,02	0,34%	5,37%	5,86%	0,20
Caixa - FI Brasil DI	03.737.206/0001-97	3,32	0,31%	5,34%	5,85%	0,20
BB Aloc Ativa	25.078.994/0001-90	0,44	-0,94%	12,00%	13,31%	0,30
Safra Executive 2	10.787.647/0001-69	0,09	0,23%	6,04%	6,81%	0,50
Itaú Aloc Dinâmica	21.838.150/0001-49	0,02	0,35%	11,53%	13,22%	0,40
Total		1579,68				

COMPOSIÇÃO DAS APLICAÇÕES POR BENCHMARK

Fundos	Participação	R\$ (milhões)
DI	19,89%	314,16
IMA Geral	0,03%	0,46
IMA B	10,66%	168,43
IMA B 5	37,92%	599,08
IMA B 5+	16,85%	266,21
IRFM1	0,01%	0,09
IRFM	1,83%	28,86
IDKA 2 IPCA	7,81%	123,39
IDKA 2 Pré	5,00%	79,01
TOTAL	100,00%	1.579,68

DISTRIBUIÇÃO DAS CARTEIRAS DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição	Participação	R\$ (milhões)
Bradesco	7,35%	116,09
Caixa	29,27%	462,38
BB	21,18%	334,54
Itaú	21,59%	341,08
Safra	0,01%	0,09
Santander	20,61%	325,51
TOTAL	100,00%	1.579,68

COMITÊ DE INVESTIMENTO – NOVEMBRO 2019

Ao décimo oitavo dia do mês de novembro de dois mil e dezenove, às quatorze 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), Nicholas Ribeiro da Costa Cardoso, Eduardo Alfradique de Oliveira, Alisson José Ramos Batista, Rodrigo Santos Martins e Michelle Bouhid, todos membros designados pelo Diretor de Investimentos. A reunião transcorreu com a seguinte pauta: **Item Um. Análise da proposta vigente durante o período de 16 de outubro de 2019 a 18 de novembro 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 19 de novembro a 18 de dezembro).** 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, Alisson José Ramos Batista, Assistente Previdenciário, lavrei a presente ata que será assinada por mim e pelos demais membros participantes da reunião.