

2019



# Relatório Mensal de Investimentos

Fundos Financeiro e Previdenciário

DEZEMBRO



## **Diretoria de Investimentos**

**Aloisio Villeth Lemos**  
Diretor de Investimentos

## **Gerência de Operações e Planejamento**

**Nícolás Ribeiro da Costa Cardoso**  
Gerência de Operações e Planejamento

**Rodrigo Santos Martins**  
Assessoria de Investimentos

**Alisson José Ramos Batista**  
Coordenadoria de Operações Financeiras

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

### **Equipe:**

**Angela Maria Monteiro Pandolfo**

**Carolina Miranda Mourão**

**Elen dos Santos Brito**

**Fernanda Felipe Moreira**

**Flávio Carramanhos Werneck**

**Isabelle Cardozo de Melo**

**Júlia Vieira Freitas**

**Michelle Caldas Bouhid**

**Pedro Daflon Fraiz**

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

**Rua da Quitanda nº 106**

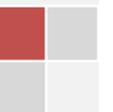
**20091-005 – Centro – Rio de Janeiro – RJ**

**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

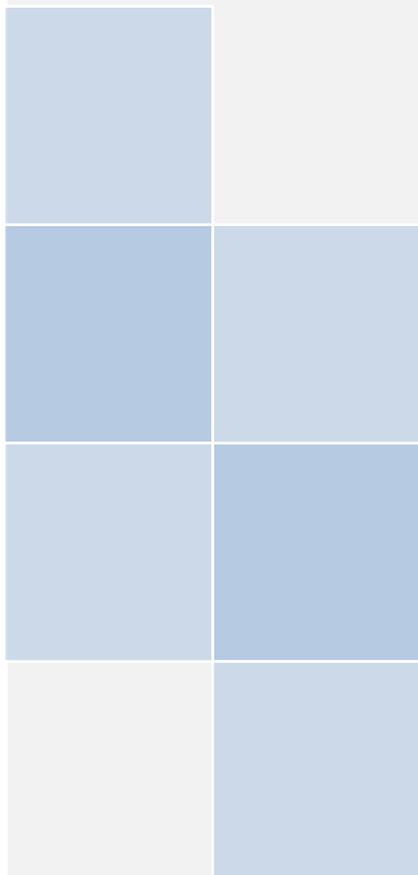
Em R\$ milhões		Fundo Administrativo				
Fundo de Investimento	CNPJ	Saldo em 31/12/2019	Rent. Mês %	Rent. Ano %	Rent. 12 meses %	Taxa Adm. % a.a.
Bradesco - Federal Extra	03.256.793/0001-00	17,34	0,36%	5,78%	5,78%	0,15
<b>Total</b>		<b>17,34</b>				

### COMITÊ DE INVESTIMENTO – DEZEMBRO/2019

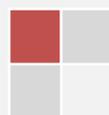
Conforme a Ata da Reunião do Comitê de Investimento do Fundo Único de Previdência Social do Estado do Rio de Janeiro – Rioprevidência, realizado no dia 18 de dezembro de 2019, na Sede Administrativa, à Rua da Quitanda nº 106 – Centro - Rio de Janeiro, foi aprovada a seguinte proposta para o período que compreende de 19/12/2019 a 22/01/2020:

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 31/12/2019	Rent.	Rent.	Rent.	Taxa
			Mês	Ano	12 meses	Adm.
			%	%	%	% a.a.
Caixa - FI Brasil TP RF LP	05.164.356/0001-84	127,76	0,38%	5,91%	5,91%	0,20
BB Referenciado	11.046.645/0001-81	43,42	0,37%	5,85%	5,85%	0,10
Bradesco - Premium DI	03.399.411/0001-90	2,83	0,37%	5,83%	5,83%	0,20
Itaú Institucional	00.832.435/0001-00	2,65	0,33%	5,76%	5,76%	0,18
Bradesco - Federal Extra	03.256.793/0001-00	2,05	0,36%	5,78%	5,78%	0,15
Itaú Soberano	06.175.696/0001-73	1,93	0,36%	5,81%	5,81%	0,15
Santander FIC REF DI	02.224.354/0001-45	1,51	0,37%	5,81%	5,81%	0,20
Caixa - FI Brasil DI	03.737.206/0001-97	0,81	0,35%	5,72%	5,72%	0,20
BB Institucional	02.296.928/0001-90	0,22	0,37%	5,83%	5,83%	0,20
Santander Corporate	03.069.104/0001-40	0,18	0,35%	5,77%	5,77%	0,20
Bradesco RF REF DI LP	00.975.480/0001-06	0,01	0,36%	5,76%	5,76%	0,15
BTG Master Cash	09.215.250/0001-13	0,00	0,36%	5,77%	5,77%	0,20
<b>Total</b>		<b>183,37</b>				

## COMPOSIÇÃO DAS APLICAÇÕES POR BENCHMARK

Fundos	Participação	R\$ (milhões)
DI	100,00%	183,37
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>183,37</b>

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

Instituição	Participação	R\$ (milhões)
Bradesco	2,66%	4,88
Caixa	70,11%	128,57
BB	23,80%	43,64
Itaú	2,50%	4,58
BTG	0,00%	0,00
Santander	0,93%	1,70
<b>TOTAL</b>	<b>100,00%</b>	<b>183,37</b>

## **COMITÊ DE INVESTIMENTO – DEZEMBRO/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 dezembro 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 19/12/2019 a 22/01/2020:

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 31/12/2019	Rent. Mês	Rent. Ano	Rent. 12 meses	Taxa Adm.
			%	%	%	% a.a.
Itaú Inflação 5	09.093.819/0001-15	235,99	1,22%	12,87%	12,87%	0,18
Caixa Brasil 2024 IV	20.139.595/0001-78	171,22	1,49%	17,50%	17,50%	0,20
Itaú Instucional DI	00.832.435/0001-00	140,22	0,33%	5,76%	5,76%	0,18
Santander FIC FI	02.224.354/0001-45	137,06	0,37%	5,81%	5,81%	0,20
Santander FIC IMA B	14.504.578/0001-90	110,50	1,98%	22,58%	22,58%	0,20
Santander FIC IMA B-5	13.455.117/0001-01	93,93	1,22%	12,90%	12,90%	0,20
Bradesco IDKA	24.022.566/0001-82	79,43	0,54%	11,60%	11,60%	0,20
Caixa IDKA IPCA 2	14.386.926/0001-71	70,69	1,10%	11,19%	11,19%	0,20
BB Prev TP RF IPCA I	19.303.793/0001-46	65,93	1,18%	14,15%	14,15%	0,15
Caixa Brasil 2030 III	20.139.534/0001-00	64,41	1,10%	23,22%	23,22%	0,20
BB IDKA 2	13.322.205/0001-35	54,09	1,15%	11,20%	11,20%	0,20
BB Prev TP RF IPCA	15.486.093/0001-83	46,14	1,45%	15,72%	15,72%	0,15
Caixa IMAB TP RF	10.740.658/0001-93	39,62	1,99%	22,59%	22,59%	0,20
Caixa Brasil 2020 IV	21.919.953/0001-28	37,66	0,78%	8,66%	8,66%	0,20
BB IMAB 5	03.543.447/0001-03	34,88	1,19%	12,89%	12,89%	0,20
Caixa Brasil 2024 VI	22.791.074/0001-26	34,30	1,49%	17,51%	17,51%	0,20
BB Prev TP RF IPCA XI	24.117.278/0001-01	29,15	1,18%	14,07%	14,07%	0,20
BB IRF-M	07.111.384/0001-69	29,04	0,60%	11,79%	11,79%	0,20
Caixa Brasil TP RF LP	05.164.356/0001-84	26,89	0,38%	5,91%	5,91%	0,20
Bradesco - Premium DI	03.399.411/0001-90	22,91	0,37%	5,83%	5,83%	0,20
BB Ref DI TP	11.046.645/0001-81	22,01	0,37%	5,85%	5,85%	0,10
BB PREV IMAB TP	07.442.078/0001-05	21,65	1,97%	22,64%	22,64%	0,20
BB Prev TP RF IPCA X	20.734.931/0001-20	20,46	1,19%	13,85%	13,85%	0,20
Caixa Brasil 2020 III	20.139.342/0001-02	20,08	0,78%	8,64%	8,64%	0,20
Bradesco IMAB 5	20.216.216/0001-04	14,43	1,23%	12,92%	12,92%	0,20
BB Prev TP RF IPCA VI	19.523.306/0001-50	7,54	1,28%	15,21%	15,21%	0,20
BB Perfil	13.077.418/0001-49	7,05	0,35%	5,74%	5,74%	0,20
Caixa - FI Brasil DI	03.737.206/0001-97	3,33	0,35%	5,72%	5,72%	0,20
BB Aloc Ativa	25.078.994/0001-90	0,44	0,96%	13,07%	13,07%	0,30
Safra Executive 2	10.787.647/0001-69	0,09	0,40%	6,46%	6,46%	0,50
Itaú Aloc Dinâmica	21.838.150/0001-49	0,02	0,34%	11,91%	11,91%	0,40
<b>Total</b>		<b>1641,15</b>				

## COMPOSIÇÃO DAS APLICAÇÕES POR BENCHMARK

Fundos	Participação	R\$ (milhões)
DI	21,90%	359,47
IMA Geral	0,03%	0,46
IMA B	10,47%	171,76
IMA B 5	36,94%	606,19
IMA B 5+	16,45%	269,93
IRFM1	0,01%	0,09
IRFM	1,77%	29,04
IDKA 2 IPCA	7,60%	124,78
IDKA 2 Pré	4,84%	79,43
TOTAL	100,00%	1.641,15

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

Instituição	Participação	R\$ (milhões)
Bradesco	7,12%	116,77
Caixa	28,53%	468,20
BB	20,62%	338,37
Itaú	22,92%	376,22
Safra	0,01%	0,09
Santander	20,81%	341,50
TOTAL	100,00%	1.641,15

## COMITÊ DE INVESTIMENTO – DEZEMBRO 2019

Ao décimo oitavo dia do mês de dezembro 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), 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 19 de novembro de 2019 a 18 de dezembro 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 dezembro de 2019 e 22 de janeiro de 2020).** 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.