

2020



Relatório Mensal de Investimentos

Fundos Administrativo,
Financeiro e Previdenciário

JANEIRO



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

Fernanda Felipe Moreira

Flávio Carramanhos Werneck

Flávio de Matos Silva

Gustavo Vergete Marins

Isabelle Cardozo de Melo

Júlia Vieira Freitas

Kenia da Silva Braga

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



Fundo Administrativo



ALOCAÇÃO DOS RECURSOS Fundos de Investimentos

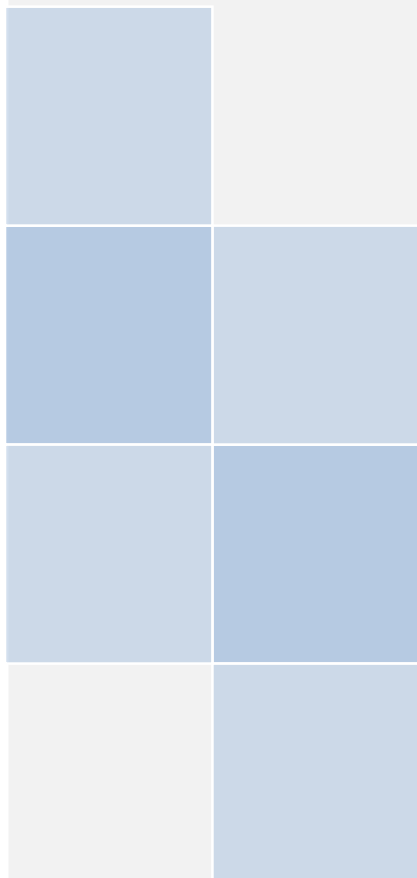
Em R\$ milhões		Fundo Administrativo				
Fundo de Investimento	CNPJ	Saldo em 31/01/2020	Rent. Mês %	Rent. Ano %	Rent. 12 meses %	Taxa Adm. % a.a.
Bradesco - Federal Extra	03.256.793/0001-00	4,84	0,36%	0,36%	5,60%	0,15
Total		4,84				

COMITÊ DE INVESTIMENTO – JANEIRO/2020

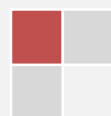
Conforme a Ata da Reunião do Comitê de Investimento do Fundo Único de Previdência Social do Estado do Rio de Janeiro – Rioprevidência, realizado no dia 22 de janeiro de 2020, na Sede Administrativa, à Rua da Quitanda nº 106 – Centro - Rio de Janeiro, foi aprovada a seguinte proposta para o período que compreende de 23/01/2020 a 28/02/2020:

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	Rent.	Rent.	Rent.	Taxa
		31/01/2020	Mês	Ano	12 meses	Adm.
			%	%	%	% a.a.
Caixa - FI Brasil TP RF LP	05.164.356/0001-84	64,62	0,39%	0,39%	5,76%	0,20
BB Institucional	02.296.928/0001-90	60,28	0,36%	0,36%	5,64%	0,20
BB Referenciado	11.046.645/0001-81	43,53	0,37%	0,37%	5,68%	0,10
Santander FIC REF DI	02.224.354/0001-45	10,06	0,37%	0,37%	5,63%	0,20
Bradesco - Federal Extra	03.256.793/0001-00	5,46	0,36%	0,36%	5,60%	0,15
Bradesco - Premium DI	03.399.411/0001-90	2,84	0,37%	0,37%	5,66%	0,20
Itaú Institucional	00.832.435/0001-00	2,60	0,37%	0,37%	5,59%	0,18
Itaú Soberano	06.175.696/0001-73	1,95	0,36%	0,36%	5,63%	0,15
Caixa - FI Brasil DI	03.737.206/0001-97	0,81	0,37%	0,37%	5,55%	0,20
Santander Corporate	03.069.104/0001-40	0,18	0,38%	0,38%	5,60%	0,20
Bradesco RF REF DI LP	00.975.480/0001-06	0,01	0,36%	0,36%	5,58%	0,15
BTG Master Cash	09.215.250/0001-13	0,00	0,36%	0,36%	5,59%	0,20
Total		192,35				

COMPOSIÇÃO DAS APLICAÇÕES POR BENCHMARK

Fundos	Participação	R\$ (milhões)
DI	100,00%	192,35
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%	192,35

DISTRIBUIÇÃO DAS CARTEIRAS DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição	Participação	R\$ (milhões)
Bradesco	4,32%	8,31
Caixa	34,02%	65,44
BB	53,97%	103,81
Itaú	2,37%	4,55
BTG	0,00%	0,00
Santander	5,33%	10,25
TOTAL	100,00%	192,35

COMITÊ DE INVESTIMENTO – JANEIRO/2020

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 22 de janeiro de 2020, na Sede Administrativa, à Rua da Quitanda nº 106 – Centro - Rio de Janeiro, foi aprovada a seguinte proposta para o período que compreende de 23/01/2020 a 28/02/2020:

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	Rent.	Rent.	Rent.	Taxa
		31/01/2020	Mês	Ano	12 meses	Adm.
			%	%	%	% a.a.
Itaú Inflação 5	09.093.819/0001-15	237,26	0,54%	0,54%	11,80%	0,18
Caixa Brasil 2024 IV	20.139.595/0001-78	172,59	0,80%	0,80%	15,64%	0,20
Santander FIC FI	02.224.354/0001-45	150,29	0,37%	0,37%	5,63%	0,20
Itaú Instucional DI	00.832.435/0001-00	130,80	0,37%	0,37%	5,59%	0,18
Santander FIC IMA B	14.504.578/0001-90	110,77	0,24%	0,24%	17,78%	0,20
Santander FIC IMA B-5	13.455.117/0001-01	94,44	0,54%	0,54%	11,81%	0,20
Bradesco IDKA	24.022.566/0001-82	80,19	0,95%	0,95%	11,24%	0,20
Caixa IDKA IPCA 2	14.386.926/0001-71	71,02	0,46%	0,46%	10,30%	0,20
BB Prev TP RF IPCA I	19.303.793/0001-46	66,36	0,64%	0,64%	12,70%	0,15
Caixa Brasil 2030 III	20.139.534/0001-00	65,15	1,15%	1,15%	18,70%	0,20
BB IDKA 2	13.322.205/0001-35	54,29	0,38%	0,38%	10,29%	0,20
BB Prev TP RF IPCA	15.486.093/0001-83	46,45	0,67%	0,67%	14,05%	0,15
Caixa IMAB TP RF	10.740.658/0001-93	39,71	0,25%	0,25%	17,72%	0,20
Caixa Brasil 2020 IV	21.919.953/0001-28	37,65	-0,03%	-0,03%	7,50%	0,20
BB IMAB 5	03.543.447/0001-03	35,07	0,56%	0,56%	11,82%	0,20
Caixa Brasil 2024 VI	22.791.074/0001-26	34,57	0,80%	0,80%	15,65%	0,20
Bradesco - Premium DI	03.399.411/0001-90	32,78	0,37%	0,37%	5,66%	0,20
BB Ref DI TP	11.046.645/0001-81	31,89	0,37%	0,37%	5,68%	0,10
Caixa Brasil TP RF LP	05.164.356/0001-84	29,97	0,39%	0,39%	5,76%	0,20
BB Prev TP RF IPCA XI	24.117.278/0001-01	29,34	0,63%	0,63%	12,62%	0,20
BB IRF-M	07.111.384/0001-69	29,28	0,85%	0,85%	11,22%	0,20
BB PREV IMAB TP	07.442.078/0001-05	21,70	0,26%	0,26%	17,83%	0,20
BB Prev TP RF IPCA X	20.734.931/0001-20	20,57	0,53%	0,53%	12,36%	0,20
Caixa Brasil 2020 III	20.139.342/0001-02	20,07	-0,04%	-0,04%	7,48%	0,20
Bradesco IMAB 5	20.216.216/0001-04	14,51	0,56%	0,56%	11,79%	0,20
BB Prev TP RF IPCA VI	19.523.306/0001-50	7,59	0,69%	0,69%	13,63%	0,20
BB Perfil	13.077.418/0001-49	7,07	0,35%	0,35%	5,55%	0,20
Caixa - FI Brasil DI	03.737.206/0001-97	3,34	0,37%	0,37%	5,55%	0,20
BB Aloc Ativa	25.078.994/0001-90	0,45	0,49%	0,49%	11,38%	0,30
Safra Executive 2	10.787.647/0001-69	0,09	0,42%	0,42%	6,26%	0,50
Itaú Aloc Dinâmica	21.838.150/0001-49	0,02	0,34%	0,34%	9,69%	0,40
Total		1675,28				

COMPOSIÇÃO DAS APLICAÇÕES POR BENCHMARK

Fundos	Participação	R\$ (milhões)
DI	23,05%	386,14
IMA Geral	0,03%	0,46
IMA B	10,28%	172,19
IMA B 5	36,37%	609,30
IMA B 5+	16,26%	272,32
IRFM1	0,01%	0,09
IRFM	1,75%	29,28
IDKA 2 IPCA	7,48%	125,31
IDKA 2 Pré	4,79%	80,19
TOTAL	100,00%	1.675,28

DISTRIBUIÇÃO DAS CARTEIRAS DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

Instituição	Participação	R\$ (milhões)
Bradesco	7,61%	127,48
Caixa	28,30%	474,07
BB	20,90%	350,06
Itaú	21,97%	368,08
Safra	0,01%	0,09
Santander	21,22%	355,50
TOTAL	100,00%	1.675,28

COMITÊ DE INVESTIMENTO – JANEIRO 2020

Ao vigésimo segundo dia do mês de janeiro de dois mil e vinte, 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, Flávio de Matos Silva 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 dezembro de 2019 a 22 de janeiro de 2020. 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 23 de janeiro e 28 de fevereiro 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.