

2020



# Relatório Mensal de Investimentos

Fundos Administrativo,  
Financeiro e Previdenciário

MARÇO



## **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](http://www.rioprevidencia.rj.gov.br)**



# Fundo Administrativo



## ALOCAÇÃO DOS RECURSOS Fundos de Investimentos

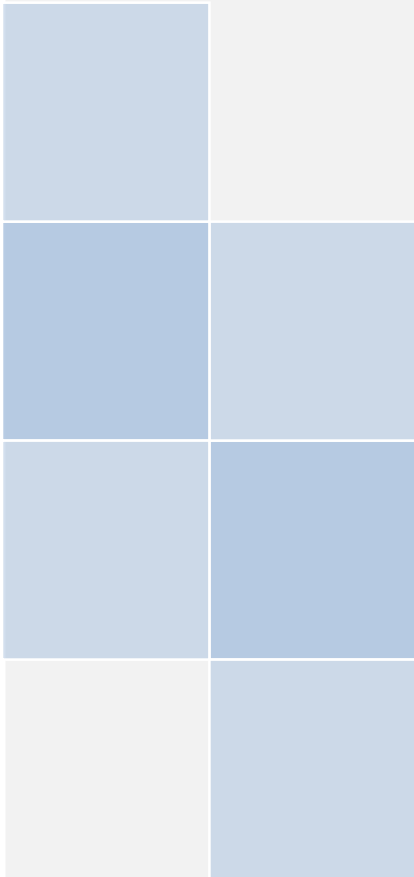
Fundo de Investimento		Fundo Administrativo				
Nome	CNPJ	Saldo em	Mês	Ano	12 meses	Taxa Adm.
		31/03/2020				% a.a.
Bradesco - Federal Extra	03.256.793/0001-00	15,72	0,32%	0,95%	5,24%	0,15
<b>TOTAL</b>		<b>15,72</b>				
						Valores em R\$ milhões

### COMITÊ DE INVESTIMENTO – MARÇO/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 28 de fevereiro de 2020, na Sede Administrativa, à Rua da Quitanda nº 106 – Centro - Rio de Janeiro, foi aprovada a seguinte proposta para o período:

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

Fundo de Investimento		Fundo Financeiro				
Nome	CNPJ	Saldo em	Mês	Ano	12 meses	Taxa Adm.
		31/03/2020				
						% a.a.
Caixa - FI Brasil TP RF LP	05.164.356/0001-84	407,08	0,35%	1,04%	5,47%	0,20
BB Referenciado	11.046.645/0001-81	390,07	0,33%	0,98%	5,32%	0,10
Itaú Soberano	06.175.696/0001-73	262,90	0,32%	0,96%	5,28%	0,15
Bradesco - Federal Extra	03.256.793/0001-00	170,75	0,32%	0,95%	5,24%	0,15
Santander FIC REF DI	02.224.354/0001-45	103,14	-0,07%	0,58%	4,81%	0,20
Itaú Institucional	00.832.435/0001-00	13,70	0,25%	0,89%	5,14%	0,18
BB Previdenciário RF IRFM1	11.328.882/0001-35	5,62	0,60%	1,38%	6,40%	0,20
BB Institucional	02.296.928/0001-90	5,35	-0,25%	0,39%	4,65%	0,20
Caixa - FI Brasil DI	03.737.206/0001-97	0,82	0,14%	0,79%	4,99%	0,20
Bradesco - Premium DI	03.399.411/0001-90	0,24	0,01%	0,63%	4,93%	0,20
Santander Corporate	03.069.104/0001-40	0,18	-0,17%	0,49%	4,70%	0,20
Bradesco RF REF DI LP	00.975.480/0001-06	0,01	0,31%	0,94%	5,21%	0,15
BTG Master Cash	09.215.250/0001-13	0,00	0,31%	0,94%	5,22%	0,20
BB Perfil	13.077.418/0001-49	0,00	-0,03%	0,59%	4,81%	0,20
<b>TOTAL</b>		<b>1359,85</b>				<b>Valores em R\$ milhões</b>

### COMPOSIÇÃO DAS APLICAÇÕES POR BENCHMARK

Fundos	Participação	R\$ (milhões)
DI	99,59%	R\$1.354,24
IMA Geral	0,00%	R\$0,00
IMA B	0,00%	R\$0,00
IMA B 5	0,00%	R\$0,00
IMA B 5+	0,00%	R\$0,00
IRFM1	0,41%	R\$5,62
IRFM	0,00%	R\$0,00
IDKA 2 IPCA	0,00%	R\$0,00
IDKA 2 Pré	0,00%	R\$0,00
<b>TOTAL</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$1.359,85</b>

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

Instituição	Participação	R\$ (milhões)
Bradesco	12,57%	R\$171,00
Caixa	30,00%	R\$407,89
BB	29,49%	R\$401,04
Itaú	20,34%	R\$276,59
BTG	0,00%	R\$0,00
Santander	7,60%	R\$103,32
<b>TOTAL</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$1.359,85</b>

## **COMITÊ DE INVESTIMENTO – MARÇO/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 28 de fevereiro de 2020, na Sede Administrativa, à Rua da Quitanda nº 106 – Centro - Rio de Janeiro, foi aprovada a seguinte proposta para o período:

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

Fundo de Investimento		Fundo Previdenciário				
Nome	CNPJ	Saldo em	Mês	Ano	12 meses	Taxa Adm.
		31/03/2020				
% a.a.						
Itaú Inflação 5	09.093.819/0001-15	233,66	-1,71%	-0,56%	9,18%	0,18
Santander FIC FI	02.224.354/0001-45	172,44	-0,07%	0,58%	4,81%	0,20
Caixa Brasil 2024 IV	20.139.595/0001-78	165,14	-2,69%	-1,23%	11,89%	0,20
Itaú Instucional DI	00.832.435/0001-00	143,02	0,25%	0,89%	5,14%	0,18
Santander FIC IMA B	14.504.578/0001-90	103,27	-7,17%	-6,54%	8,62%	0,20
Santander FIC IMA B-5	13.455.117/0001-01	93,37	-1,75%	-0,60%	9,12%	0,20
Bradesco IDKA	24.022.566/0001-82	82,01	1,21%	3,26%	12,88%	0,20
Caixa IDKA IPCA 2	14.386.926/0001-71	70,41	-1,45%	-0,41%	8,03%	0,20
BB Prev TP RF IPCA I	19.303.793/0001-46	64,04	-1,73%	-0,38%	10,13%	0,15
Caixa Brasil 2030 III	20.139.534/0001-00	59,80	-6,82%	-5,14%	9,95%	0,20
BB IDKA 2	13.322.205/0001-35	53,73	-1,66%	-0,66%	7,78%	0,20
Caixa Brasil TP RF LP	05.164.356/0001-84	51,33	0,35%	1,04%	5,47%	0,20
BB Prev TP RF IPCA	15.486.093/0001-83	45,92	-1,89%	-0,47%	11,28%	0,15
Caixa IMAB TP RF	10.740.658/0001-93	37,05	-7,10%	-6,46%	8,66%	0,20
Caixa Brasil 2020 IV	21.919.953/0001-28	36,31	-1,13%	-0,92%	5,35%	0,20
BB IMAB 5	03.543.447/0001-03	34,67	-1,79%	-0,60%	9,12%	0,20
Bradesco - Premium DI	03.399.411/0001-90	33,97	0,01%	0,63%	4,93%	0,20
Caixa Brasil 2024 VI	22.791.074/0001-26	33,08	-2,69%	-1,23%	11,89%	0,20
BB Ref DI TP	11.046.645/0001-81	32,08	0,33%	0,98%	5,32%	0,10
BB IRF-M	07.111.384/0001-69	29,44	-0,11%	1,38%	10,87%	0,20
BB Prev TP RF IPCA XI	24.117.278/0001-01	28,32	-1,73%	-0,39%	10,06%	0,20
BB PREV IMAB TP	07.442.078/0001-05	20,28	-6,98%	-6,33%	8,93%	0,20
BB Prev TP RF IPCA X	20.734.931/0001-20	19,79	-1,93%	-0,82%	9,49%	0,20
Caixa Brasil 2020 III	20.139.342/0001-02	19,36	-1,13%	-0,93%	5,33%	0,20
Bradesco IMAB 5	20.216.216/0001-04	14,48	-1,78%	-0,59%	9,18%	0,20
BB Prev TP RF IPCA VI	19.523.306/0001-50	7,30	-2,06%	-0,68%	10,67%	0,20
BB Perfil	13.077.418/0001-49	7,09	-0,03%	0,59%	4,81%	0,20
Caixa - FI Brasil DI	03.737.206/0001-97	3,36	0,14%	0,79%	4,99%	0,20
BB Aloc Ativa	25.078.994/0001-90	0,44	-2,10%	-1,18%	8,55%	0,30
Safrá Executive 2	10.787.647/0001-69	0,09	0,40%	1,18%	6,19%	0,50
Itaú Aloc Dinâmica	21.838.150/0001-49	0,02	0,53%	1,13%	9,75%	0,40
Bradesco - Federal Extra	03.256.793/0001-00	0,00	-	-	-	0,30
<b>TOTAL</b>		<b>1695,27</b>	<b>Valores em R\$ milhões</b>			

## COMPOSIÇÃO DAS APLICAÇÕES POR BENCHMARK

Fundos	Participação	R\$ (milhões)
DI	26,15%	R\$443,29
IMA Geral	0,03%	R\$0,46
IMA B	9,47%	R\$160,60
IMA B 5	22,19%	R\$376,18
IMA B 5+	28,26%	R\$479,07
IRFM1	0,01%	R\$0,09
IRFM	1,74%	R\$29,44
IDKA 2 IPCA	7,32%	R\$124,13
IDKA 2 Pré	4,84%	R\$82,01
Dólar	0,00%	R\$0,00
<b>TOTAL</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$1.695,27</b>

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

Instituição	Participação	R\$ (milhões)
Bradesco	7,70%	R\$130,46
Caixa	28,07%	R\$475,84
BB	20,24%	R\$343,09
Itaú	22,22%	R\$376,70
Safra	0,01%	R\$0,09
Santander	21,77%	R\$369,08
<b>TOTAL</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$1.695,27</b>