



Relatório de Carteira de Investimentos

Valores Mobiliários e Títulos da Dívida Pública Federal

Agosto de 2024



Governo do Estado do Rio de Janeiro
Secretaria de Estado de Fazenda
Fundo Único de Previdência Social do Estado do Rio de Janeiro

Comitê de Investimentos

Eucherio Lerner Rodrigues – Diretor de Investimentos

Gustavo Tillmann – Indicado SEFAZ

Robson Luís Barbosa – Indicado SEPLAG

Diretoria Executiva

Diretor-Presidente

Deivis Marcon Antunes

Diretor de Administração e Finanças

Alcione Soares Menezes Filho

Diretor de Investimentos

Eucherio Lerner Rodrigues

Diretor de Seguridade

Guilherme Saraiva de Sá

Diretor Jurídico

Marcel Silva Gladulich

Gerência de Operações e Investimentos – GEROI

Pedro Pinheiro Guerra Leal - Gerente

Transparência Investimentos –

<https://www.rj.gov.br/rioprevidencia/Investimentos>



Fundo Único de Previdência Social do Estado do Rio de Janeiro – Rioprevidência
Sede Administrativa: Rua da Quitanda nº 106, Centro. Rio de Janeiro/RJ – CEP 20091-005
Telefone: (21) 2332-5151 – www.rioprevidencia.rj.gov.br



Governo do Estado do Rio de Janeiro
Secretaria de Estado de Fazenda
Fundo Único de Previdência Social do Estado do Rio de Janeiro

Conteúdo

1. Carteira de Investimentos em Valores Mobiliários e Títulos de Dívida Pública do Rioprevidência.....	3
1.1. Fundo Financeiro.....	3
1.2. Fundo Previdenciário.....	4
1.3. Fundos Administrativo e Militar.....	7
1.3.1. Fundo Administrativo.....	8
1.3.2. Fundo Militar.....	8
2. ENQUADRAMENTO.....	9



Fundo Único de Previdência Social do Estado do Rio de Janeiro – Rioprevidência
Sede Administrativa: Rua da Quitanda nº 106, Centro. Rio de Janeiro/RJ – CEP 20091-005
Telefone: (21) 2332-5151 – www.rioprevidencia.rj.gov.br



Governo do Estado do Rio de Janeiro
Secretaria de Estado de Fazenda
Fundo Único de Previdência Social do Estado do Rio de Janeiro

1. Carteira de Investimentos em Valores Mobiliários e Títulos de Dívida Pública do Rioprevidência

Os fundos de natureza previdenciária geridos pelo Rioprevidência fecharam o mês de agosto com um saldo de R\$ 12.917 milhões, distribuídos entres os Fundos Financeiro e Previdenciário.

1.1.Fundo Financeiro

A carteira do Fundo Financeiro é gerida de forma compatível com suas características de fluxo de caixa e insuficiência de cobertura. Portanto, o volume financeiro deste fundo é alocado em produtos de curtíssimo prazo que têm como benchmark a taxa de juros interbancária de um dia, enquanto o excedente do patrimônio é investido na aquisição de títulos públicos. Essas estratégias visam garantir que, no futuro, haja cobertura suficiente, como pode ser verificado na Tabela 1.

Tabela 1. Resultado do Fundo Financeiro no mês de agosto e comparação à Meta Atuarial.

Carteira	Peso (%)	Retorno no Mês (%)		Retorno no Ano (%)		P&L AcumMês (P)	P&L AcumAno (P)	Valor Merc (R\$)
		Ago	4,64%+ INPC	Ago	4,64% + INPC			
Financeiro	100,00	1,46	0,24	7,06	5,96	74.335.515	421.717.225	8.572.440.506
Renda Fixa	100,00	1,46		7,06		74.335.515	421.717.225	8.572.440.506
Fundos Renda fixa 100% TP/ETF Art. 7º, I, "b"	39,83	0,87		7,02		14.100.421	192.839.300	3.414.316.107
ITAU SOB SIM FIC	26,34	0,87		7,10		10.009.720	145.127.527	2.258.378.951
SANT DI TP PREM	7,21	0,86		7,06		2.842.535	44.376.454	618.306.295
SAFR S RG PR REF	6,27	0,87		7,05		1.248.167	3.335.319	537.630.862
Renda fixa conforme CVM Art. 7º, III, "a"	38,83	0,90		7,23		24.050.681	201.464.744	3.328.548.000
BB DI TP FI	15,61	0,87		7,12		2.328.429	98.871.318	1.330.720.655
BRANCO FI REND	11,25	0,91		7,76		12.444.052	75.687.217	959.160.844
KINEA FIC FI	6,46	0,89		7,48		4.428.020	14.067.002	550.605.802
BB-INSTIT FI RF	1,78	0,93		2,17		1.404.875	2.015.913	152.015.913
NOVUS RF INST FI	1,54	0,63		0,87		824.036	1.133.013	131.133.013
MAG CASH FI RF LP	1,22	1,23		4,09		1.267.779	4.091.161	104.091.161
MAG REF FI	0,00	0,12		0,12		121.301	121.301	100.121.301
SANT DI PREM FIC	0,00	0,93		7,56		3.572	27.175	389.183
BRANCO FI RF LP	0,00	0,92		7,56		1.832	14.053	201.013
SANT DI INST PRE	0,00	0,87		7,05		710	5.622	80.371
BB PREV FLUXO SI	0,00	0,17		1,07		1.225.817	5.428.978	0
ITAU INST DI FI	0,00	0,79		6,44		259	1.990	28.743
Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC) Art. 7º, I, "a"	19,22	1,94		-1,07		35.068.793	25.425.882	1.647.866.737
NTNB_2060_5790	2,97	1,89		-1,50		5.281.670	-2.399.166	253.272.662
NTNB_2050_6170	2,48	2,01		3,46		4.647.372	7.631.919	211.592.030
NTNB_2060_5830	2,48	1,89		-0,60		4.401.391	-939.700	211.060.552
NTNB_2060_5980	2,48	1,89		0,53		4.401.391	2.938.906	211.060.552
NTNB_2050_6150	1,49	2,01		2,19		2.788.423	3.407.331	126.955.218
NTNB_2050_6400	1,49	2,01		4,90		2.788.423	6.313.209	126.955.218
NTNB_2050_6090	0,99	2,01		2,56		1.858.949	2.220.897	84.636.812
NTNB_2060_5890	0,99	1,89		-0,67		1.760.557	32.143	84.424.221
NTNB_2060_5970	0,99	1,89		0,02		1.760.557	818.727	84.424.221
NTNB_2050_6090	0,50	2,01		2,56		929.474	1.154.875	42.318.406
NTNB_2050_6430	0,50	2,01		5,07		929.474	2.168.844	42.318.406
NTNB_2060_5870	0,50	1,89		-0,73		880.278	-34.449	42.212.110
NTNB_2060_5950	0,50	1,89		0,02		880.278	248.750	42.212.110
NTNB_2060_6250	0,50	1,89		2,01		880.278	931.830	42.212.110
NTNB_2060_6150	0,50	1,89		2,01		880.278	931.767	42.212.110
Ativos de RF de Instituições Financeiras Art. 7º, IV	1,54	1,07		2,14		1.050.041	1.921.721	131.643.933
LETRA FINANCEIRA IPCA + 8,10%	0,95	1,02		2,12		827.194	1.698.874	81.701.191
LFT	0,58	0,45		0,45		222.847	222.847	49.942.743
Renda Fixa Crédito Privado Art. 7º, V, "b"	0,58	0,13		0,13		65.579	65.579	50.065.729
MAG DI PREMIUM CP	0,58	0,13		0,13		65.579	65.579	50.065.729

* Fundo com classificação no CADPREV e Tabela Secretaria de Previdência. Aqui ficou a classificação do CADPREV

Fonte: Bloomberg e elaboração GEROI

No mês de agosto tivemos mais de R\$ 74,335 milhões em rentabilidade (1,46%). No que diz respeito ao risco, optou-se por buscar exposição a ativos teoricamente caracterizados por baixo risco ou livre de risco. Dessa forma, busca-se seguir retornos que estejam acima do INPC, acrescido da taxa de 4,64%.



Govorno do Estado do Rio de Janeiro
Secretaria de Estado de Fazenda
Fundo Único de Previdência Social do Estado do Rio de Janeiro

1.2.Fundo Previdenciário

O Fundo Previdenciário do Rioprevidência fechou o mês de agosto com um saldo de R\$ 4.345 milhões. Desse modo, nosso portfólio está distribuído entre as quotas de 8 fundos de investimentos, 31 títulos públicos federais, 6 Letras Financeiras e 1 LFT como pode ser visto na Tabela 2. A carteira do Rioprevidência teve desempenho 1,11% em ago/24, gerando um rendimento de mais de R\$ 47,229 milhões. Já a meta atuarial foi de 0,26% (4,97% + INPC) - no mês.

Tabela 2. Resultado do Fundo Previdenciário no mês de agosto e comparação à Meta Atuarial.

Carteira	Peso (%)	Retorno no Mês (%)		Retorno no Ano (%)		P&L AcumMês (P)	P&L AcumAno (P)	Valor Merc (R\$)
		Ago	4,97% + INPC	Ago	4,97% + INPC			
Previdenciário	100,00	1,11	0,26	6,37	6,18	47.229.951	232.192.718	4.345.010.305
Renda Fixa	96,65	0,97		6,69		40.173.466	233.257.361	4.199.300.007
Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC) Art. 7º, I, "a"	61,49	0,69		5,56		24.683.683	117.340.341	2.671.697.537
Marcados na Curva	36,15	0,70		6,17		11.038.629	108.827.158	1.570.530.579
NTNB_2050_5714	2,59	0,69		7,19		791.951	7.813.811	112.738.969
NTNB_2040_5625	2,59	0,69		7,13		783.171	7.747.225	112.658.697
NTNB_2050_5750	2,58	0,70		7,10		791.697	7.803.014	112.199.829
NTNB_2040_5780	2,55	0,70		7,23		785.596	7.737.031	110.917.414
NTNB_2030_5595	2,54	0,68		7,11		765.702	7.584.022	110.513.032
NTNB_2050_5868	2,54	0,71		7,29		790.774	7.768.520	110.506.127
NTNB_2050_5884	2,54	0,71		7,31		790.639	7.761.977	110.180.614
NTNB_2030_5711	2,53	0,69		7,19		772.077	7.621.341	109.899.769
NTNB_2045_5790	2,60	0,70		7,24		785.789	7.753.011	112.875.130
NTNB_2045_5801	2,59	0,70		7,25		785.819	7.750.835	112.733.790
NTNB_2035_5704	2,59	0,69		7,19		775.694	7.673.138	112.523.615
NTNB_2035_5759	2,58	0,70		7,22		777.479	7.678.805	112.085.462
NTNB_2060_6088	2,47	0,73		7,44		788.274	7.698.822	107.373.565
NTNB_2055_5439	0,22	0,67		7,00		63.607	633.944	9.531.030
NTNB_2055_5724	1,05	0,70		7,20		316.396	3.127.298	45.801.423
NTNB_2055_5801	1,56	0,70		7,25		473.964	4.674.364	67.992.113
Marcados a Mercado	25,34	1,06	-4,38			13.645.054	8.513.183	1.101.166.958
NTNB_2060_5909	0,97	1,89	-3,30			880.278	-1.474.281	42.212.110
NTNB_2060_5500	0,97	1,89	-2,81			880.278	-1.238.688	42.212.110
NTNB_2060_5700	0,05	1,89	-4,09			49.560	-100.030	2.376.542
NTNB_2060_5740	1,94	2,03	-1,22			1.760.557	-1.044.219	84.424.221
NTNB_2060_5740	2,91	2,03	-1,04			2.640.835	-1.331.658	126.636.331
NTNB_2060_5770	1,94	2,03	-0,96			1.760.557	-817.014	84.424.221
NTNB_2060_6250	1,94	1,87	3,56			1.760.557	3.149.993	84.424.221
NTNB_2060_6260	0,97	1,87	3,56			880.278	1.574.997	42.212.110
NTNB_2050_6260	0,97	1,99	3,33			929.474	1.484.178	42.318.406
NTNB_2050_6320	1,95	1,99	3,74			1.858.949	3.302.017	84.636.812
NTNB_2050_6320	2,92	1,99	4,88			2.788.423	6.313.209	126.955.218
NTNB_2050_6430	0,97	2,01	5,07			929.474	2.168.844	42.318.406
NTNB_2050_6110	1,95	0,10	0,10			80.249	80.249	84.636.812
NTNB_2050_6030	2,92	-1,53	-1,53			-1.975.834	-1.975.834	126.955.218
NTNB_2060_6020	1,94	-1,84	-1,84			-1.578.580	-1.578.580	84.424.221
Ativos de RF de Instituições Financeiras Art. 7º, IV	19,38	0,45	0,00			7.743.907	44.327.772	842.065.851
LETRA FINANCEIRA IPCA + 7,8%	5,65	0,87		6,50		2.109.525	15.451.864	245.451.864
LETRA FINANCEIRA IPCA + 8%	5,03	0,97		8,51		2.099.167	17.845.709	218.737.209
LETRA FINANCEIRA IPCA + 8%	2,88	1,06		4,36		1.310.737	5.346.734	125.346.734
LETRA FINANCEIRA IPCA + 8,02%	1,90	0,88		3,38		725.793	2.750.203	82.750.203
LETRA FINANCEIRA IPCA + 8,04%	1,65	0,99		2,65		705.198	1.878.969	71.878.969
LETRA FINANCEIRA IPCA + 8,04%	1,63	0,96		1,33		673.110	933.916	70.933.916
LFT	0,62	0,45		0,45		120.378	120.378	26.966.956
Renda fixa conforme CVM Art. 7º, III, "a"	8,69	0,92	7,61			3.489.006	45.356.090	377.494.752
BRDESCO FI REND	8,48	0,91	7,71			3.254.112	26.076.706	368.460.103
ITAU INST DI FI	0,21	0,89	7,43			234.894	19.279.384	9.034.649
Fundos Renda fixa 100% TP/ETF Art. 7º, I, "b"	1,12	1,44	7,25			1.727.128	17.102.043	48.525.092
ITAU LEGENDS	1,12	0,74	0,74			406.263	406.263	48.498.357
SAFRA IMA INST F	0,00	0,70				182	-97.916	26.269
SANT DI TP PREM	0,00	0,86	7,01			4	30,5	466
Renda Fixa Crédito Privado Art. 7º, V, "b"	5,97	0,98	3,59			2.529.741	9.131.116	259.516.776
BRDESCO FIC RP CP	5,97	0,98	3,74			2.529.741	9.131.116	259.516.776
Renda Variável	3,35	5,09	1,12			7.056.485	-1.064.642	145.710.298
Fundo de Ações CVM Art. 8º, I	3,35	5,09	1,12			7.056.485	-1.064.642	145.710.298
OCCAM FIC FIA	3,35	5,09	3,70			7.054.450	5.657.196	145.657.196
BTG PACTUAL ABS	0,00	3,98	-4,12			2.034	-2.283	53.101

* Fundo com classificação no CADPREV e Tabela Secretaria de Previdência. Aqui ficou a classificação do CADPREV

Fonte: Bloomberg, elaboração GEROI

RIOPREVIDÊNCIA



Governo do Estado do Rio de Janeiro
Secretaria de Estado de Fazenda
Fundo Único de Previdência Social do Estado do Rio de Janeiro

Tivemos um desempenho misto neste mês. O segmento de renda fixa contribuiu com 0,94% e o segmento de renda variável contribuiu com 0,17%. O retorno e a contribuição de cada item da carteira podem ser vistos na tabela 3.

Tabela 3. Retorno dos fundos e contribuição para o retorno total em agosto.

Carteira	Peso Médio (%)	Retorno Total (%)	Contribuição p/ Retorno (%)
Previdenciário	100,00	1,11	1,11
Renda Fixa	96,74	0,97	0,94
Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC) Art. 7º, I, "a"	61,49	0,69	0,42
Marcados na Curva	36,15	0,70	0,25
NTNB_2050_5714	2,59	0,69	0,02
NTNB_2040_5625	2,59	0,69	0,02
NTNB_2050_5750	2,58	0,70	0,02
NTNB_2040_5780	2,55	0,70	0,02
NTNB_2030_5595	2,54	0,68	0,02
NTNB_2050_5868	2,54	0,71	0,02
NTNB_2050_5884	2,54	0,71	0,02
NTNB_2030_5711	2,53	0,69	0,02
NTNB_2045_5790	2,60	0,70	0,02
NTNB_2045_5801	2,59	0,70	0,02
NTNB_2035_5704	2,59	0,69	0,02
NTNB_2035_5759	2,58	0,70	0,02
NTNB_2060_6088	2,47	0,73	0,02
NTNB_2055_5439	0,22	0,67	0,00
NTNB_2055_5724	1,05	0,70	0,01
NTNB_2055_5801	1,56	0,70	0,01
Marcados a Mercado	25,34	1,06	0,27
NTNB_2060_5909	0,97	1,89	0,02
NTNB_2060_5500	0,97	1,89	0,02
NTNB_2060_5700	0,05	1,89	0,00
NTNB_2060_5740	1,94	2,03	0,04
NTNB_2060_5740	2,91	2,03	0,06
NTNB_2060_5770	1,94	2,03	0,04
NTNB_2060_6250	1,94	1,87	0,04
NTNB_2060_6260	0,97	1,87	0,02
NTNB_2050_6260	0,97	1,99	0,02
NTNB_2050_6320	1,95	1,99	0,04
NTNB_2050_6320	2,92	1,99	0,06
NTNB_2050_6430	0,97	2,01	0,02
NTNB_2050_6110	1,95	0,10	0,00
NTNB_2050_6030	2,92	-1,53	-0,04
NTNB_2060_6020	1,94	-1,84	-0,04
Ativos de RF de Instituições Financeiras Art. 7º, IV	19,38	0,45	0,09
LETRA FINANCEIRA IPCA + 7,8%	5,65	0,87	0,05
LETRA FINANCEIRA IPCA + 8%	5,03	0,97	0,05
LETRA FINANCEIRA IPCA + 8%	2,88	1,06	0,03
LETRA FINANCEIRA IPCA + 8,02%	1,90	0,88	0,02
LETRA FINANCEIRA IPCA + 8,04%	1,65	0,99	0,02
LETRA FINANCEIRA IPCA + 8,04%	1,63	0,96	0,02
LFT	0,62	0,45	0,00
Renda fixa conforme CVM Art. 7º, III, "a"	8,69	0,92	0,08
BRABESCO FI REND	8,48	0,91	0,08
ITAU INST DI FI	0,21	0,89	0,00
Fundos Renda fixa 100% TP/ETF Art. 7º, I, "b"	1,12	1,44	0,02
ITAÚ LEGENDS	1,12	0,74	0,01
SAFRA IMA INST F	0,00	0,70	0,00
SANT DI TP PREM	0,00	0,86	0,00
Renda Fixa Crédito Privado Art. 7º, V, "b"	5,97	0,98	0,06
BRABESCO FIC RP CP	5,97	0,98	0,06
Renda Variável	3,35	5,09	0,17
Fundo de Ações CVM Art. 8º, I	3,35	5,09	0,17
OCCAM FIC FIA	3,35	5,09	0,17
BTG PACTUAL ABS	0,00	3,98	0,00

Fonte: Bloomberg, elaboração GEROI

RIOPREVIDÊNCIA



Governo do Estado do Rio de Janeiro
Secretaria de Estado de Fazenda
Fundo Único de Previdência Social do Estado do Rio de Janeiro

A Tabela 5 apresenta a distribuição do fundo por segmentação, destacando que em agosto 96,65% dos recursos foram alocados em Renda Fixa. No segmento de Renda Variável, foi destinado 3,25% dos recursos.

Tabela 5. Distribuição do Fundo Previdenciário divido por Segmentação.

Carteira	29/09/2023	131/10/2023	30/11/2023	29/12/2023	31/01/2024	29/02/2024	28/03/2024	30/04/2024	30/05/2024	28/06/2024	31/07/2024	30/08/2024
Previdenciário	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00
Renda Fixa	96,09	96,28	100,00	100,00	97,36	94,29	93,32	93,70	94,06	96,74	96,75	96,65
Fundos Renda fixa 100% TP/ETF Art. 7º, I, "b"	35,94	27,09	28,38	29,46	26,59	25,85	16,74	15,63	7,63	5,85	5,78	1,12
BB PREV 20 734 9	0,22	0,22	0,22	0,22	0,21	0,20	0,20	0,20	0,20	0,19	0,19	0,00
BB RF TP VI	0,08	0,08	0,08	0,08	0,07	0,07	0,07	0,07	0,07	0,07	0,07	0,00
BTG TES SEL FI D	1,13	1,13	1,13	1,16	1,08	1,07	1,06	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
CAIXA 24 IV TP	5,22	5,18	5,18	5,33	4,96	4,77	4,72	4,71	4,67	4,65	4,60	0,00
CAIXA GEST ESTR	15,69	2,94	2,95	3,05	2,83	2,79	0,53	0,53	0,00	0,00	0,00	0,00
FI CAIXA BRZ TP	4,37	8,99	7,79	8,20	7,63	14,18	7,43	7,41	0,00	0,00	0,00	0,00
FI CX 24 VI TP	1,05	1,04	1,04	1,07	0,99	0,96	0,95	0,94	0,94	0,93	0,92	0,00
SAFRA IMA INST F	5,25	0,41	0,41	0,43	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
SANT DI TP PREM	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
SANTANDER TOP RF	2,51	2,47	2,13	2,20	2,04	1,81	1,79	1,77	1,76	0,00	0,00	0,00
XP MACRO JUROS A			7,03	7,28	6,76	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
ITAU LEGENDS												1,12
Renda fixa conforme CVM Art. 7º, III, "a"	17,34	26,54	29,51	27,20	22,76	15,69	16,66	15,64	16,85	11,35	9,56	8,69
BRABESCO FI REND	1,65	10,18	10,19	10,48	13,00	6,02	9,57	7,63	7,97	7,91	7,81	8,48
ITAU INST DI FI	15,70	16,35	19,32	16,71	9,77	9,67	7,09	8,01	8,88	3,44	1,74	0,21
Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC) Art. 7º, I, "I"	42,81	42,66	42,11	43,35	42,72	41,60	48,85	48,38	47,50	55,91	56,40	61,48
NTNB_2030_5595	3,02	3,01	3,00	3,09	2,87	2,77	2,74	2,73	2,71	2,69	2,65	2,54
NTNB_2030_5711	3,00	2,99	2,98	3,07	2,86	2,75	2,73	2,72	2,70	2,68	2,64	2,53
NTNB_2035_5704	3,07	3,06	2,97	3,05	2,84	2,82	2,79	2,78	2,68	2,66	2,63	2,59
NTNB_2035_5759	3,06	3,05	2,95	3,04	2,83	2,80	2,78	2,77	2,67	2,65	2,62	2,58
NTNB_2040_5625	3,07	3,06	3,05	3,14	2,93	2,82	2,79	2,78	2,76	2,74	2,70	2,59
NTNB_2040_5780	3,02	3,01	3,00	3,09	2,88	2,77	2,75	2,74	2,72	2,70	2,66	2,55
NTNB_2045_5790	3,08	3,06	2,97	3,06	2,85	2,82	2,80	2,79	2,69	2,67	2,63	2,60
NTNB_2045_5801	3,07	3,06	2,97	3,05	2,85	2,82	2,79	2,79	2,69	2,67	2,63	2,59
NTNB_2050_5714	3,07	3,06	3,05	3,14	2,93	2,82	2,79	2,79	2,76	2,74	2,71	2,59
NTNB_2050_5750	3,06	3,05	3,04	3,13	2,91	2,81	2,78	2,77	2,75	2,73	2,69	2,58
NTNB_2050_5868	3,01	3,00	2,99	3,08	2,87	2,76	2,74	2,73	2,71	2,69	2,65	2,54
NTNB_2050_5884	3,00	2,99	2,98	3,07	2,86	2,76	2,73	2,72	2,70	2,68	2,65	2,54
NTNB_2055_5439	0,26	0,26	0,25	0,26	0,24	0,24	0,24	0,24	0,23	0,23	0,22	0,22
NTNB_2055_5724	1,25	1,24	1,21	1,24	1,16	1,15	1,13	1,13	1,09	1,08	1,07	1,05
NTNB_2055_5801	1,85	1,84	1,79	1,84	1,72	1,70	1,68	1,68	1,62	1,61	1,59	1,56
NTNB_2060_6088	2,92	2,91	2,91	2,99	2,79	2,68	2,66	2,65	2,63	2,61	2,58	2,47
NTNB_2060_5909			1,20	1,22	1,17	1,12	1,10	1,06	1,04	1,00	1,00	0,97
NTNB_2060_5500					1,17	1,12	1,10	1,06	1,04	1,00	1,00	0,97
NTNB_2060_5700						0,06	0,06	0,06	0,06	0,06	0,06	0,05
NTNB_2060_5740							3,29	2,11	2,11	1,99	2,00	2,91
NTNB_2060_5740							2,19	3,17	3,11	3,00	3,00	1,94
NTNB_2060_5770							2,19	2,11	2,07	2,00	2,00	1,94
NTNB_2060_6250										2,00	2,00	1,94
NTNB_2060_6260										1,00	1,00	0,97
NTNB_2050_6260										1,00	1,00	0,97
NTNB_2050_6320										3,01	3,01	1,95
NTNB_2050_6320										2,00	2,00	2,92
NTNB_2050_6430											1,00	0,97
NTNB_2050_6110												1,95
NTNB_2050_6030												2,92
NTNB_2060_6020												1,94
Ativos de RF de Instituições Financeiras Art. 7º, IV				5,31	5,29	11,15	11,07	14,05	15,94	17,53	18,99	21,55
LETRA FINANCEIRA IPCA + 7,8%				5,31	5,29	5,91	5,86	5,86	5,82	5,79	5,72	5,65
LETRA FINANCEIRA IPCA + 8%						5,24	5,20	5,21	5,18	5,15	5,09	5,03
LETRA FINANCEIRA IPCA + 8%								2,98	2,98	2,95	2,91	5,03
LETRA FINANCEIRA IPCA + 8,02%									1,96	1,95	1,93	1,90
LETRA FINANCEIRA IPCA + 8,04%										1,69	1,67	1,65
LETRA FINANCEIRA IPCA + 8,04%											1,67	1,65
LFT												0,62
Renda Fixa Crédito Privado Art. 7º, V, "b"									6,14	6,10	6,03	5,97
BRABESCO FIC RP CP									6,14	6,10	6,03	5,97
Renda Variável	3,91	3,72	0,00	0,00	2,64	5,71	6,68	6,29	5,95	3,26	3,26	3,35
Fundo de Ações CVM Art. 8º, I	3,91	3,72	0,00	0,00	0,00	5,71	6,68	6,29	5,95	3,26	3,26	3,35
BTG PACTUAL ABS	3,91	3,72			2,64	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
OCCAM FIC FIA					0,00	2,62	3,14	3,40	3,24	3,26	3,26	3,35
TORK ONLY INST F						3,09	3,53	2,89	2,71	0,00	0,00	0,00

Fonte: Bloomberg, elaboração GEROI.



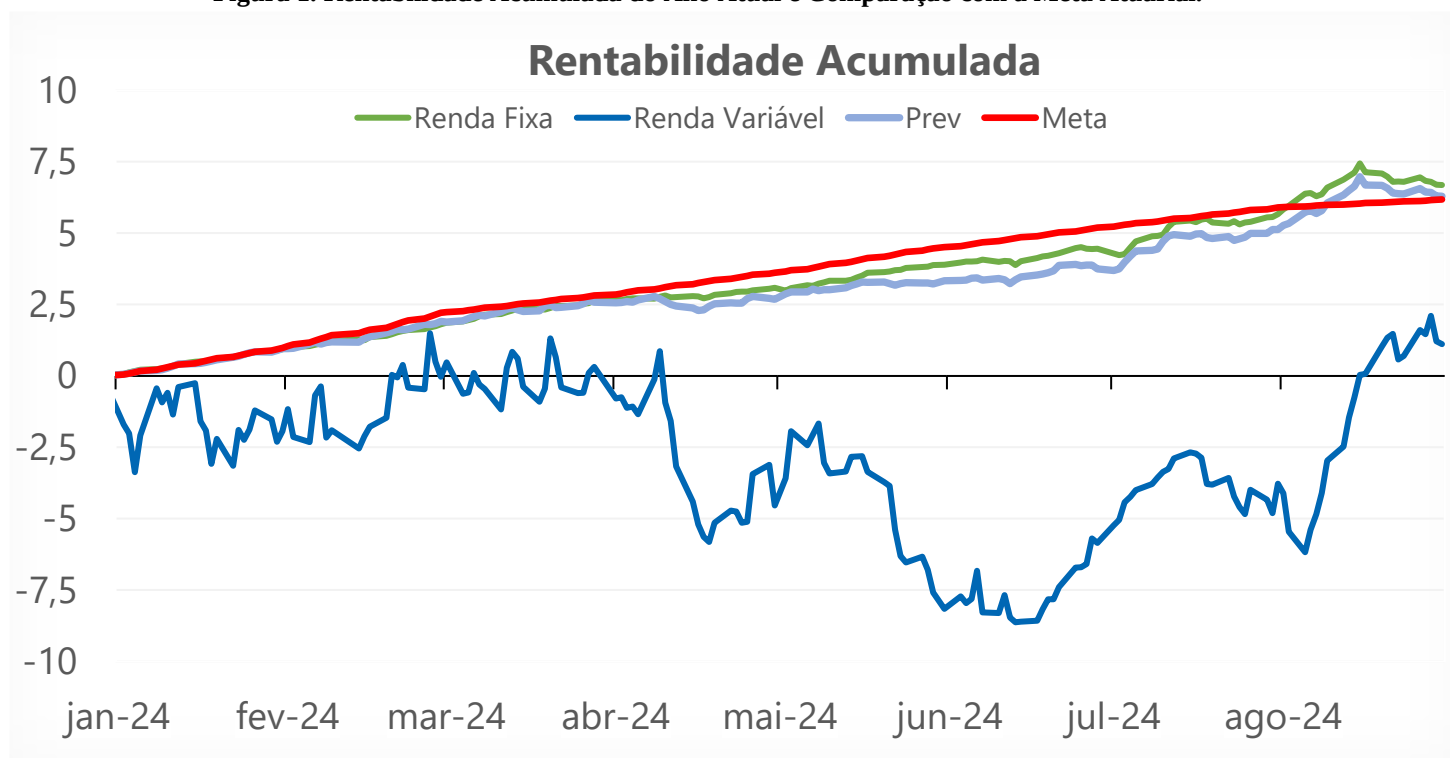
Fundo Único de Previdência Social do Estado do Rio de Janeiro – Rioprevidência
Sede Administrativa: Rua da Quitanda nº 106, Centro. Rio de Janeiro/RJ – CEP 20091-005
Telefone: (21) 2332-5151 – www.rioprevidencia.rj.gov.br



Governo do Estado do Rio de Janeiro
Secretaria de Estado de Fazenda
Fundo Único de Previdência Social do Estado do Rio de Janeiro

Na Figura 1 é possível observar a rentabilidade acumulada do ano do total da carteira. Com base nesses dados é possível perceber que a renda fixa performou com um acumulado total de 6,69%, a renda variável performou com 1,12%, enquanto a meta acumulou 6,18% no ano atual.

Figura 1. Rentabilidade Acumulada do Ano Atual e Comparação com a Meta Atuarial.



Fonte: Elaboração GEROI.

RIOPREVIDÊNCIA

Fundo Único de Previdência Social do Estado do Rio de Janeiro – Rioprevidência
Sede Administrativa: Rua da Quitanda nº 106, Centro. Rio de Janeiro/RJ – CEP 20091-005
Telefone: (21) 2332-5151 – www.rioprevidencia.rj.gov.br



Governo do Estado do Rio de Janeiro
Secretaria de Estado de Fazenda
Fundo Único de Previdência Social do Estado do Rio de Janeiro

1.3 Fundos Administrativo e Militar

Além dos citados fundos de natureza previdenciária, o Rioprevidência faz a gestão de dois outros fundos: (i) o Fundo Administrativo, que acumula os recursos advindos do recolhimento da taxa de administração e são utilizados para o custeio da Autarquia ou constituição de reserva; e (ii) o Fundo Militar, denominado gerencialmente assim, que tem como objetivo efetuar os pagamentos relacionados ao Sistema de Proteção Social dos Militares (SPSM).

1.3.1 Fundo Administrativo

A carteira do Fundo Administrativo não cobre benefícios previdenciários. Sua existência se deve à implantação da taxa de administração de 2,00% sobre a folha de ativos e benefícios concedidos, com fins de custeio do RPPS. O volume financeiro que este fundo continha em ago/24 era de R\$ 376,606 milhões, como pode ser visto na Tabela 6.

Tabela 6. Fundo Administrativo em agosto e seu comparativo em relação ao CDI.

Carteira	Peso (%)	Retorno no Mês (%)		Retorno no Ano (%)		P&L AcumMês (P)	P&L AcumAno (P)	Valor Merc (R\$)
		Ago	CDI	Ago	CDI			
Administrativo	100,00	0,93	0,87	7,97	7,09	3.429.379	23.472.224	376.606.484
Renda Fixa	100,00	0,93		6,97		3.429.379	23.472.224	376.606.484
Renda fixa conforme CVM Art. 7º, III, "a"	64,77	0,96		6,07		2.096.536	12.626.312	243.923.463
BB PREV DI PER F		0,96		6,07		2.096.536	12.626.312	243.923.463
Renda fixa conforme CVM Art. 7º, IV	35,23	1,00		7,52		1.332.843	10.845.912	132.683.021
LETRA FINANCEIRA IPCA + 8%		1,00		7,52		1.332.843	10.845.912	132.683.021

Fonte: Bloomberg, elaboração GEROI

1.3.2 Fundo Militar

A carteira do Fundo Militar cobre as obrigações devidas relativas ao Sistema de Proteção dos Militares, conforme Lei Federal nº 13.954/2019, sendo de responsabilidade da Secretária da Fazenda do Estado do Rio de Janeiro e gerida pelo Rioprevidência. Portanto, seu patrimônio não se confunde com o do seu ente gestor. No mês de agosto tivemos performance que gerou R\$ 14,491 milhões em rentabilidade (0,89%), como pode ser visto na Tabela 7.

Tabela 7. Fundo Militar em agosto e seu comparativo em relação a 4,93% + INPC.

Carteira	Peso (%)	Retorno no Mês (%)		Retorno no Ano (%)		P&L AcumMês (P)	P&L AcumAno (P)	Valor Merc (R\$)
		Ago	4,93% + INPC	Ago	4,93% + INPC			
Militar	100,00	0,89	0,26	7,21	6,15	14.491.653	93.363.512	1.624.713.186
Renda Fixa	100,00	0,89		7,21		14.491.653	93.363.512	1.624.713.186
Renda fixa conforme CVM Art. 7º, III, "a"	100,00	0,89		7,21		14.491.653	93.363.512	1.624.713.186
BB PREV DI PER F	100,00	0,89		7,21		14.491.653	93.363.512	1.624.713.186

Fonte: Bloomberg, elaboração GEROI



Fundo Único de Previdência Social do Estado do Rio de Janeiro – Rioprevidência
Sede Administrativa: Rua da Quitanda nº 106, Centro. Rio de Janeiro/RJ – CEP 20091-005
Telefone: (21) 2332-5151 – www.rioprevidencia.rj.gov.br



Governo do Estado do Rio de Janeiro
Secretaria de Estado de Fazenda
Fundo Único de Previdência Social do Estado do Rio de Janeiro

2 ENQUADRAMENTO

Tabela 8. Enquadramento Consolidado do Patrimônio do Fundo Financeiro/ Previdenciário/ Administrativo

Dispositivo 4.963/2021	Alocação	% PL Rioprev	Pró-gestão - Nível II	Tipos de Ativos	Espaço
Art 7 - I - a	R\$4.785.384.059,47	36,57%	100,00%	Título Público de emissão do TN (SELIC)	R\$8.300.651.460,43
Art 7 - I - b	R\$4.792.723.911,55	36,62%	100,00%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF	R\$8.293.311.608,35
Art 7 - III - a	R\$2.525.445.402,46	19,30%	70,00%	Renda fixa conforme CVM	R\$6.634.779.461,47
Art 7 - IV	R\$575.936.168,12	4,40%	30,00%	Renda Fixa em Instituições Financeiras	R\$3.349.874.487,85
Art 7 - V - b	R\$259.416.011,43	1,98%	5,00%	Renda Fixa em Crédito Privado	R\$394.885.764,57
Art 8 - I - a	R\$147.129.966,87	1,12%	40,00%	Fundo de Ações CVM	R\$5.087.284.241,09
Art 9 - II	R\$0,00	0,00%	10,00%	FIC Aberto - Investimento no Exterior	R\$1.308.603.551,99
Art 9 - III	R\$0,00	0,00%	10,00%	Fundo de Ações – BDR Nível I	R\$1.308.603.551,99
Art 10 - I - a	R\$0,00	0,00%	10,00%	Fundos Multimercados	R\$1.308.603.551,99
Art 11	R\$0,00	0,00%	10,00%	FI Imobiliários	R\$1.308.603.551,99
Art 12	R\$0,00	0,00%	10,00%	Empréstimos Consignados	R\$1.308.603.551,99
TOTAL	R\$13.086.035.519,90	100,00%	ENQUADRAMENTO CORRETO		

RIOPREVIDÊNCIA

www.rioprevidencia.rj.gov.br



**GOV
RJ**