



Relatório de Carteira de Investimentos

Valores Mobiliários e Títulos da Dívida Pública Federal

Outubro 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





Govorno 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 outubro com um saldo de R\$ 10.926 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 outubro e comparação à Meta Atuarial.

Carteira	Peso (%)	Retorno no Mês (%)		Retorno no Ano (%)		P&L AcumMês (P)	P&L AcumAno (P)	Valor Merc (R\$)
		Out	4,64%+ INPC	Out	4,64%+ INPC			
Financeiro	100,00	-0,22	0,99	7,10	7,93	-15.736.709	426.829.533	6.503.996.476
Renda Fixa	100,00	-0,22		7,10		-15.736.709	426.829.533	6.503.996.476
Renda fixa conforme CVM Art. 7º, III, "a"	51,29	0,94		9,17		33.120.597	267.158.886	3.335.622.996
ITAU INST DI FI	13,28	0,93		9,42		6.641.351,84	23.097.766,35	863.931.043,59
BRABESCO FI REND	11,74	0,93		9,72		7.088.385,42	91.264.167,42	763.842.768,88
SAFR DI MASTER	11,69	0,93		1,67		7.016.126,29	12.013.759,01	760.059.431,40
BB DI TP FI	4,60	0,93		9,02		6.733.545,82	117.169.911,77	299.323.990,82
MAG CASH FI RF LP	2,38	0,90		4,00		1.383.686,75	4.750.872,99	154.750.872,99
VILAND RF LP FIC FI	2,32	0,44		0,44		663.220,80	663.220,80	150.663.220,80
KINEA FIC FI	2,06	1,06		3,07		1.410.447,06	3.987.031,07	133.987.031,07
NOVUS RF INST FI	1,64	1,21		6,47		1.271.186,92	6.474.228,10	106.474.228,10
MAG REF FI	1,57	0,90		1,89		906.276,49	1.890.011,66	101.890.011,66
BB-INSTIT FI RF	0,01	0,92		9,44		3.596,82	33.997,51	396.004,87
SANT DI PREM FIC	0,00	0,92		9,50		1.859,75	17.668,09	204.627,83
BRABESCO FI RF LP	0,00	0,92		8,92		645,77	6.918,57	70.501,58
SANT DI INST PRE	0,00	0,92		9,43		266,97	2.508,88	29.262,28
Fundos Renda fixa 100% TP/ETF Art. 7º, I, "b"	10,82	0,93		8,92		8.217.531	219.755.677	703.840.608
SAFR S RG PR REF	7,66	0,94		8,97		4.660.517,84	10.947.654	498.145.501
SANT DI TP PREM	1,79	0,92		8,94		1.700.014,59	50.612.734	116.542.574
ITAU SOB SIM FIC	1,37	0,93		8,99		1.856.999,06	158.195.290	89.152.533
Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC) Art. 7º, I, "a"	31,53	-2,46		-5,16		-61.134.665	-69.007.692	2.050.599.840
NTNB_2060_5790	3,70	-0,03		-0,06		-7.549.157	-15.006.180	240.665.648
NTNB_2050_6170	3,10	-0,03		-0,01		-5.704.445	-2.228.777	201.731.333
NTNB_2060_5830	3,08	-0,03		-0,06		-6.290.964	-11.445.546	200.554.707
NTNB_2060_5980	3,08	-0,03		-0,04		-6.290.964	-7.566.940	200.554.707
NTNB_2050_6150	1,86	-0,03		-0,03		-3.422.667	-2.509.087	121.038.800
NTNB_2050_6400	1,86	-0,03		0,00		-3.422.667	396.791	121.038.800
NTNB_2060_6350	1,85	-0,03		-0,03		-3.774.579	-3.547.046	120.332.824
NTNB_2050_6090	1,24	-0,03		-0,02		-2.281.778	-1.723.382	80.692.533
NTNB_2050_6420	1,24	-0,02		-0,02		-1.996.882	-1.996.882	80.692.533
NTNB_2050_6420	1,24	-0,02		-0,02		-1.996.882	-1.996.882	80.692.533
NTNB_2060_5890	1,23	-0,03		-0,06		-2.516.386	-4.170.195	80.221.883
NTNB_2060_6270	1,23	-0,03		-0,04		-2.516.386	-3.081.989	80.221.883
NTNB_2060_5970	1,23	-0,03		-0,05		-2.516.386	-3.383.611	80.221.883
NTNB_2060_6260	0,62	-0,03		-0,04		-1.140.889	-1.524.468	40.346.267
NTNB_2060_6350	0,62	-0,03		-0,03		-1.140.889	-1.173.118	40.346.267
NTNB_2050_6090	0,62	-0,03		-0,02		-1.140.889	-817.264	40.346.267
NTNB_2050_6430	0,62	-0,03		0,00		-1.140.889	196.705	40.346.267
NTNB_2060_5870	0,62	-0,03		-0,06		-1.258.193	-2.135.618	40.110.941
NTNB_2060_6270	0,62	-0,03		-0,04		-1.258.193	-1.540.995	40.110.941
NTNB_2060_5950	0,62	-0,03		-0,05		-1.258.193	-1.852.419	40.110.941
NTNB_2060_6250	0,62	-0,03		-0,03		-1.258.193	-1.169.339	40.110.941
NTNB_2060_6150	0,62	-0,03		-0,03		-1.258.193	-1.169.402	40.110.941
LFT	0,00	0,00		0,01		0	437.952	0
Renda Fixa Crédito Privado Art. 7º, V, "b"	5,09	0,96		1,76		3.151.873	5.790.203	330.796.096
SAFR EXTRA BAN FIC FI	4,30	0,97		1,75		2.681.893,67	4.809.475	279.815.369
MAG DI PREMIUM CP	0,78	0,93		1,96		469.979,26	980.728	50.980.728
Ativos de RF de Instituições Financeiras Art. 7º, IV	1,28	1,11		3,97		907.955	3.132.459	83.136.937
LETRA FINANCEIRA IPCA + 8,10%	1,28	1,10		3,92		907.954,90	3.132.459	83.136.937

Fonte: Bloomberg e elaboração GEROI

No mês de outubro tivemos - R\$ 15,736 milhões em rentabilidade (-0,22%). No que diz respeito ao risco, optou-se por buscar exposição a ativos teoricamente caracterizados por baixo risco ou livre de risco. Dessa forma, buscou-se seguir retornos que estejam acima do INPC, acrescido da taxa de 4,64%.



Governo 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 outubro com um saldo de R\$ 4.422 milhões. Desse modo, nosso portfólio está distribuído entre as quotas de 10 fundos de investimentos, 32 títulos públicos federais, 6 Letras Financeiras e 1 LFT como pode ser visto na Tabela 2. A carteira do Rioprevidência teve desempenho -0,02% em out/24, gerando um rendimento de - R\$ 1,077 milhões. Já a meta atuarial foi de 1,02% (4,97% + INPC) - no mês.

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

Carteira	Peso (%)	Retorno no Mês (%)		Retorno no Ano (%)		P&L AcumMês (P)	P&L AcumAno (P)	Valor Merc (R\$)
		Out	4,97% + INPC	Out	4,97% + INPC			
Previdenciário	100,00	-0,02	1,02	6,29	8,21	-1.077.673	246.336.188	4.422.605.732
Renda Fixa	97,32	0,02		6,76		986.694	254.597.541	4.304.092.145
Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC) Art. 7º, I,"a"	61,34	-2,08		3,29		-15.359.607	90.935.057	2.712.929.170
Marcados na Curva	36,11	1,02		9,05		16.189.289	135.435.971	1.597.139.392
NTNB_2045_5790	2,60	1,03		9,06		1.165.242	9.668.738	114.790.857
NTNB_2045_5801	2,59	1,03		9,07		1.164.959	9.666.330	114.649.285
NTNB_2035_5704	2,59	1,02		8,99		1.153.411	9.567.272	114.417.750
NTNB_2050_5714	2,59	1,02		8,99		1.156.362	9.712.936	114.638.094
NTNB_2040_5625	2,59	1,01		8,92		1.146.675	9.628.076	114.539.547
NTNB_2050_5750	2,58	1,02		8,91		1.154.491	9.699.980	114.096.795
NTNB_2035_5759	2,58	1,02		9,03		1.154.019	9.575.294	113.981.951
NTNB_2040_5780	2,55	1,02		9,05		1.144.254	9.617.924	112.798.307
NTNB_2030_5595	2,54	1,01		8,89		1.121.786	9.423.502	112.352.512
NTNB_2050_5868	2,54	1,03		9,13		1.148.601	9.658.800	112.396.407
NTNB_2050_5884	2,53	1,03		9,15		1.147.489	9.650.839	112.069.476
NTNB_2030_5711	2,53	1,02		8,99		1.126.960	9.472.048	111.750.476
NTNB_2060_6088	2,47	1,05		9,32		1.136.807	9.574.914	109.249.657
NTNB_2055_5801	1,56	1,03		9,07		702.599	5.829.588	69.147.337
NTNB_2055_5724	1,05	1,02		9,00		470.197	3.899.643	46.573.768
NTNB_2055_5439	0,22	0,99		8,76		95.437	790.088	9.687.174
Marcados a Mercado	24,61	-2,91		-8,14		-31.820.276	-45.131.222	1.088.312.891
NTNB_2050_6030	2,74	-2,75		-6,12		-3.422.667	-7.892.251	121.038.800
NTNB_2050_6320	2,74	-2,75		-0,01		-3.422.667	396.791	121.038.800
NTNB_2060_5740	2,72	-3,04		-5,97		-3.774.579	-7.635.165	120.332.824
NTNB_2050_6320	1,82	-2,75		-1,09		-2.281.778	-642.262	80.692.533
NTNB_2050_6110	1,82	-2,75		-4,56		-2.281.778	-3.864.030	80.692.533
NTNB_2060_5740	1,81	-3,04		-6,13		-2.516.386	-5.246.557	80.221.883
NTNB_2060_6250	1,81	-3,04		-1,60		-2.516.386	-1.052.345	80.221.883
NTNB_2060_5770	1,81	-3,04		-5,89		-2.516.386	-5.019.352	80.221.883
NTNB_2060_6020	1,81	-3,04		-6,72		-2.516.386	-5.780.918	80.221.883
NTNB_2050_6260	0,91	-2,75		-1,48		-1.140.889	-487.961	40.346.267
NTNB_2050_6570	0,91	-1,09		-1,09		-444.071	-444.071	40.346.267
NTNB_2050_6430	0,91	-2,75		0,17		-1.140.889	196.705	40.346.267
NTNB_2060_6260	0,91	-3,04		-1,60		-1.258.193	-526.172	40.110.941
NTNB_2060_5909	0,91	-3,04		-8,12		-1.258.193	-3.575.450	40.110.941
NTNB_2060_5500	0,91	-3,04		-7,65		-1.258.193	-3.339.857	40.110.941
NTNB_2060_5700	0,05	-3,04		-8,86		-70.836	-218.326	2.258.246
Outros Títulos	0,62	1,00		2,35		271.379	630.308	27.476.887
LFT	0,62	1,00		2,35		271.379	630.308	27.476.887
Ativos de RF de Instituições Financeiras Art. 7º, IV	18,78	1,11		10,27		9.116.479	59.744.982	830.636.482
LETRA FINANCEIRA IPCA + 7,8%	5,66	1,21		8,53		3.000.403	20.471.397	250.471.397
LETRA FINANCEIRA IPCA + 8%	5,03	0,95		10,27		2.083.982	21.716.658	222.608.158
LETRA FINANCEIRA IPCA + 8%	2,88	1,15		6,13		1.447.898	7.575.951	127.575.951
LETRA FINANCEIRA IPCA + 8,02%	1,91	1,23		5,44		1.027.427	4.472.523	84.472.523
LETRA FINANCEIRA IPCA + 8,04%	1,65	0,97		4,40		705.017	3.148.263	73.148.263
LETRA FINANCEIRA IPCA + 8,04%	1,64	1,19		3,39		851.752	2.360.190	72.360.190
Renda fixa conforme CVM Art. 7º, III,"a"	8,27	0,93		9,56		3.465.506	51.930.284	365.687.777
BRADESCO FI REND	6,58	0,93		9,68		2.888.121	31.887.088	291.140.575
ITAU INST DI FI	1,69	0,93		9,37		577.385	20.043.196	74.547.201
Fundos Renda fixa 100% TP/ETF Art. 7º, I,"b"	1,98	1,23		8,47		886.683	37.209.300	87.675.138
ITAU LEGENDS	1,98	1,34		3,35		886.683	2.082.696	87.648.691
SAFRA IMA INST F	0,00	-0,58		-0,43		-152	-98.213	25.972
Renda Fixa Crédito Privado Art. 7º, V,"b"	5,98	1,14		2,05		2.394.749	13.909.390	264.295.050
BRADESCO FIC RP CP	5,98	0,91		5,65		2.394.749	13.909.390	264.295.050
Renda Fixa Crédito Privado Art. 7º, V,"a"	0,97	0,91		5,56		482.885	868.529	42.868.529
ASPEN FIC FIDC	0,69	1,16		0,02		350.452	631.608	30.631.608
MEGEVE FIC FIDC	0,28	1,09		1,97		132.433	236.921	12.236.921
Renda Variável	2,68	-1,54		-3,95		-2.064.367	-8.261.354	118.513.586
Fundo de Ações CVM Art. 8º, I	2,68	-1,54		-3,95		-2.064.367	-8.261.354	118.513.586
OCCAM FIC FIA	2,68	-1,54		-1,49		-2.063.710	-1.536.285	118.463.715
BTG PACTUAL ABS	0,00	-1,30		-9,95		-657	-5.513	49.872

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

Fonte: Bloomberg, 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

Tivemos um desempenho misto neste mês. O segmento de renda fixa contribuiu com 0,02% e o segmento de renda variável contribuiu com -0,4%. 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 outubro.

Carteira	Peso Médio (%)	Retorno Total (%)	Contribuição p/ Retorno (%)
Previdenciário	100,00	-0,02	-0,02
Renda Fixa	97,32	0,02	0,02
Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC) Art. 7º, I, "a"	61,39	-2,08	-1,28
Marcados na Curva	36,11	1,02	0,37
NTNB_2045_5790	2,60	1,03	0,03
NTNB_2045_5801	2,59	1,03	0,03
NTNB_2035_5704	2,59	1,02	0,03
NTNB_2050_5714	2,59	1,02	0,03
NTNB_2040_5625	2,59	1,01	0,03
NTNB_2050_5750	2,58	1,02	0,03
NTNB_2035_5759	2,58	1,02	0,03
NTNB_2040_5780	2,55	1,02	0,03
NTNB_2030_5595	2,54	1,01	0,03
NTNB_2050_5868	2,54	1,03	0,03
NTNB_2050_5884	2,53	1,03	0,03
NTNB_2030_5711	2,53	1,02	0,03
NTNB_2060_6088	2,47	1,05	0,03
NTNB_2055_5801	1,56	1,03	0,02
NTNB_2055_5724	1,05	1,02	0,01
NTNB_2055_5439	0,22	0,99	0,00
Marcados a Mercado	24,61	-2,91	-0,72
NTNB_2050_6030	2,74	-2,75	-0,08
NTNB_2050_6320	2,74	-2,75	-0,08
NTNB_2060_5740	2,72	-3,04	-0,08
NTNB_2050_6320	1,82	-2,75	-0,05
NTNB_2050_6110	1,82	-2,75	-0,05
NTNB_2060_5740	1,81	-3,04	-0,06
NTNB_2060_6250	1,81	-3,04	-0,06
NTNB_2060_5770	1,81	-3,04	-0,06
NTNB_2060_6020	1,81	-3,04	-0,06
NTNB_2050_6260	0,91	-2,75	-0,03
NTNB_2050_6570	0,91	-1,09	-0,01
NTNB_2050_6430	0,91	-2,75	-0,03
NTNB_2060_6260	0,91	-3,04	-0,03
NTNB_2060_5909	0,91	-3,04	-0,03
NTNB_2060_5500	0,91	-3,04	-0,03
NTNB_2060_5700	0,05	-3,04	0,00
Outros Títulos	0,62	1,00	0,01
LFT	0,62	1,00	0,01
Ativos de RF de Instituições Financeiras Art. 7º, IV	18,78	1,11	0,21
LETRA FINANCEIRA IPCA + 7,8%	5,66	1,21	0,07
LETRA FINANCEIRA IPCA + 8%	5,03	0,95	0,05
LETRA FINANCEIRA IPCA + 8%	2,88	1,15	0,03
LETRA FINANCEIRA IPCA + 8,02%	1,91	1,23	0,02
LETRA FINANCEIRA IPCA + 8,04%	1,65	0,97	0,02
LETRA FINANCEIRA IPCA + 8,04%	1,64	1,19	0,02
Renda fixa conforme CVM Art. 7º, III, "a"	8,27	0,93	0,08
BRASESCO FI REND	6,58	0,93	0,06
ITAU INST DI FI	1,69	0,93	0,02
Fundos Renda fixa 100% TP/ETF Art. 7º, I, "b"	1,98	1,23	0,02
ITAU LEGENDS	1,98	1,34	0,03
SAFRA IMA INST F	0,00	-0,58	0,00
Renda Fixa Crédito Privado Art. 7º, V, "b"	5,98	1,14	0,07
BRASESCO FIC RP CP	5,98	0,91	0,05
Renda Fixa Crédito Privado Art. 7º, V, "a"	0,97	0,91	0,01
ASPEN FIC FIDC	0,69	1,16	0,01
MEGEVE FIC FIDC	0,28	1,09	0,00
Renda Variável	2,68	-1,54	-0,04
Fundo de Ações CVM Art. 8º, I	2,68	-1,54	-0,04
OCCAM FIC FIA	2,68	-1,54	-0,04
BTG PACTUAL ABS	0,00	-1,30	0,00

Fonte: Bloomberg, elaboração GEROI





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 outubro 97,32% dos recursos foram alocados em Renda Fixa. No segmento de Renda Variável, foi destinado 2,68% dos recursos.

Tabela 5. Distribuição do Fundo Previdenciário divido por Segmentação.

Carteira	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	30/09/2024	31/10/2024
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	100,00	100,00	97,36	94,29	93,32	93,70	94,06	96,74	96,75	96,65	96,78	97,32
Fundos Renda fixa 100% TP/ETF Art. 7º, I, "b"	28,38	29,46	26,59	25,85	16,74	15,63	7,63	5,85	5,78	1,12	1,37	1,98
BB PREV 20 734 9	0,22	0,22	0,21	0,20	0,20	0,20	0,20	0,19	0,19	0,00	0,00	0,00
BB RF TP VI	0,08	0,08	0,07	0,07	0,07	0,07	0,07	0,07	0,07	0,00	0,00	0,00
BTG TES SEL FI D	1,13	1,16	1,08	1,07	1,06	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
CAIXA 24 IV TP	5,18	5,33	4,96	4,77	4,72	4,71	4,67	4,65	4,60	0,00	0,00	0,00
CAIXA GEST ESTR	2,95	3,05	2,83	2,79	0,53	0,53	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FI CAIXA BRZ TP	7,79	8,20	7,63	14,18	7,43	7,41	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FI CX 24 VI TP	1,04	1,07	0,99	0,96	0,95	0,94	0,94	0,93	0,92	0,00	0,00	0,00
SAFRA IMA INST F	0,41	0,43	0,00	0,00	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	2,13	2,20	2,04	1,81	1,79	1,77	1,76	0,00	0,00	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	0,00	0,00
ITAU LEGENDS										1,12	1,37	1,98
Renda fixa conforme CVM Art. 7º, III, "a"	29,51	27,20	22,76	15,69	16,66	15,64	16,85	11,35	9,56	8,69	8,32	8,27
BRABESCO FI REND	10,19	10,48	13,00	6,02	9,57	7,63	7,97	7,91	7,81	8,48	7,52	6,58
ITAU INST DI FI	19,32	16,71	9,77	9,67	7,09	8,01	8,88	3,44	1,74	0,21	0,80	1,69
Títulos Públicos de emissão do TN (SELIC) Art. 7º, I, "a"	42,11	43,35	42,72	41,60	48,85	48,38	47,50	55,91	56,40	61,48	61,38	61,35
NTNB_2030_5595	3,00	3,09	2,87	2,77	2,74	2,73	2,71	2,69	2,65	2,54	2,54	2,54
NTNB_2030_5711	2,98	3,07	2,86	2,75	2,73	2,72	2,70	2,68	2,64	2,53	2,53	2,53
NTNB_2035_5704	2,97	3,05	2,84	2,82	2,79	2,78	2,68	2,66	2,63	2,59	2,59	2,59
NTNB_2035_5759	2,95	3,04	2,83	2,80	2,78	2,77	2,67	2,65	2,62	2,58	2,58	2,58
NTNB_2040_5625	3,05	3,14	2,93	2,82	2,79	2,78	2,76	2,74	2,70	2,59	2,59	2,59
NTNB_2040_5780	3,00	3,09	2,88	2,77	2,75	2,74	2,72	2,70	2,66	2,55	2,55	2,55
NTNB_2045_5790	2,97	3,06	2,85	2,82	2,80	2,79	2,69	2,67	2,63	2,60	2,60	2,60
NTNB_2045_5801	2,97	3,05	2,85	2,82	2,79	2,79	2,69	2,67	2,63	2,59	2,59	2,59
NTNB_2050_5714	3,05	3,14	2,93	2,82	2,79	2,79	2,76	2,74	2,71	2,59	2,59	2,59
NTNB_2050_5750	3,04	3,13	2,91	2,81	2,78	2,77	2,75	2,73	2,69	2,58	2,58	2,58
NTNB_2050_5868	2,99	3,08	2,87	2,76	2,74	2,73	2,71	2,69	2,65	2,54	2,54	2,54
NTNB_2050_5884	2,98	3,07	2,86	2,76	2,73	2,72	2,70	2,68	2,65	2,54	2,53	2,53
NTNB_2055_5439	0,25	0,26	0,24	0,24	0,24	0,24	0,23	0,23	0,22	0,22	0,22	0,22
NTNB_2055_5724	1,21	1,24	1,16	1,15	1,13	1,13	1,09	1,08	1,07	1,05	1,05	1,05
NTNB_2055_5801	1,79	1,84	1,72	1,70	1,68	1,68	1,62	1,61	1,59	1,56	1,56	1,56
NTNB_2060_6088	2,91	2,99	2,79	2,68	2,66	2,65	2,63	2,61	2,58	2,47	2,47	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	0,94	0,91
NTNB_2060_5500			1,17	1,12	1,10	1,06	1,04	1,00	1,00	0,97	0,94	0,91
NTNB_2060_5700				0,06	0,06	0,06	0,06	0,06	0,06	0,05	0,05	0,05
NTNB_2060_5740					3,29	2,11	2,11	1,99	2,00	2,91	2,83	2,72
NTNB_2060_5740					2,19	3,17	3,11	3,00	3,00	1,94	1,89	1,82
NTNB_2060_5770					2,19	2,11	2,07	2,00	2,00	1,94	1,89	1,81
NTNB_2060_6250								2,00	2,00	1,94	1,89	1,81
NTNB_2060_6260								1,00	1,00	0,97	0,94	0,91
NTNB_2050_6260								1,00	1,00	0,97	0,95	0,91
NTNB_2050_6320								3,01	3,01	1,95	1,90	2,74
NTNB_2050_6320								2,00	2,00	2,92	2,84	2,74
NTNB_2050_6430									1,00	0,97	0,95	0,91
NTNB_2050_6110										1,95	1,90	1,82
NTNB_2050_6030										2,92	2,84	2,74
NTNB_2060_6020										1,94	1,89	1,81
LFT										0,62	0,62	0,62
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	18,76	18,79	
LETRA FINANCEIRA IPCA + 7,8%		5,31	5,29	5,91	5,86	5,82	5,79	5,72	5,65	5,65	5,66	
LETRA FINANCEIRA IPCA + 8%				5,24	5,20	5,21	5,18	5,15	5,09	5,03	5,04	
LETRA FINANCEIRA IPCA + 8%						2,98	2,98	2,95	2,91	2,89	2,88	
LETRA FINANCEIRA IPCA + 8,02%							1,96	1,95	1,93	1,90	1,91	
LETRA FINANCEIRA IPCA + 8,04%								1,69	1,67	1,65	1,65	
LETRA FINANCEIRA IPCA + 8,04%									1,67	1,65	1,63	
Renda Fixa Crédito Privado Art. 7º, V, "b"	6,14	6,10	6,03	5,97	5,98	5,98						
BRABESCO FIC RP CP	6,14	6,10	6,03	5,97	5,98	5,98						
Renda Fixa Crédito Privado Art. 7º, V, "a"												
ASPEN FIC FIDC												0,69
MEGEVE FIC FIDC												0,28
Renda Variável	0,00	0,00	2,64	5,71	6,68	6,29	5,95	3,26	3,26	3,35	3,21	2,68
Fundo de Ações CVM Art. 8º, I	0,00	0,00	0,00	5,71	6,68	6,29	5,95	3,26	3,26	3,35	3,21	2,68
BTG PACTUAL ABS			2,64	0,00	0,00	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	3,21	2,68
TORK ONLY INST F				3,09	3,53	2,89	2,71	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

Fonte: Bloomberg, elaboração GEROI.

RIOPREVIDÊNCIA

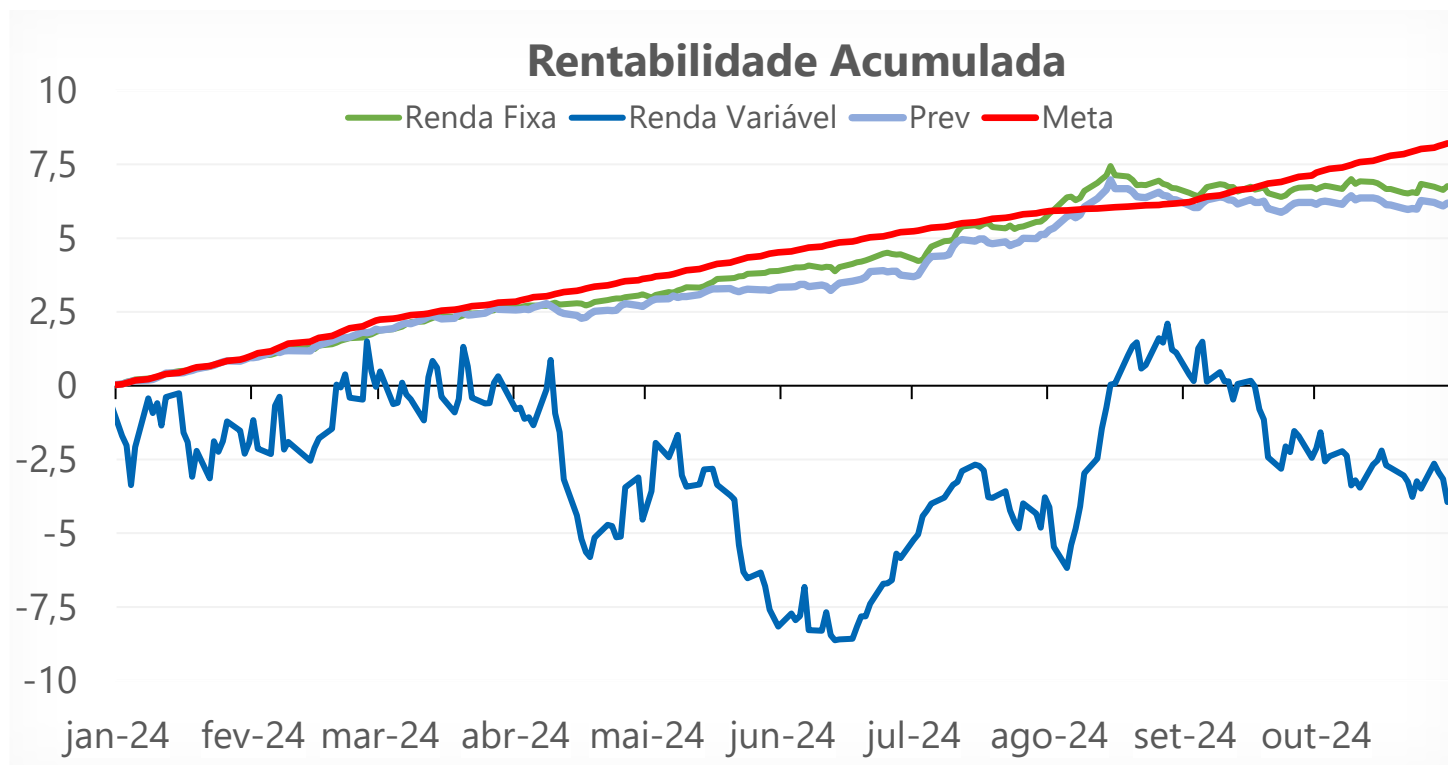
Fundo Único de Previdência Social do Estado do Rio de Janeiro – Rioprevidência
Sede Administrativa: Rua da Quitanda nº 106, Centro. Rio de Janeiro/RJ – CEP 20091-005
Telefone: (21) 2332-5151 – www.rioprevidencia.rj.gov.br



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

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 6,76%, a renda variável performou com -3,95%, enquanto a rentabilidade no ano acumulou 6,27% no ano atual.

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



Fonte: 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

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 out/24 era de R\$ 457,510 milhões, como pode ser visto na Tabela 6.

Tabela 6. Fundo Administrativo em outubro 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\$)
		Out	CDI	Out	CDI			
Administrativo	100,00	0,97	0,93	9,89	8,64	16.246.756	153.313.598	457.510.018
Renda Fixa	100,00	0,97		9,89		16.246.756	153.313.598	457.510.018
Renda fixa conforme CVM Art. 7º, III, "a"	70,48	0,89		9,13		3.046.647	18.343.140	322.471.782
BB PREV DI PER F	70,48	0,89		9,13		3.046.647	18.343.140	322.471.782
Renda fixa conforme CVM Art. 7º, IV	29,52	1,00		10,83		13.200.110	134.970.458	135.038.236
LETRA FINANCEIRA IPCA + 8%	29,52	1,00		10,83		13.200.110	134.970.458	135.038.236

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 outubro tivemos performance que gerou R\$ 14,553 milhões em rentabilidade (0,93%), como pode ser visto na Tabela 7.

Tabela 7. Fundo Militar em outubro 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\$)
		Out	4,93% + INPC	Out	4,93% + INPC			
Militar	100,00	0,93	1,01	9,12	8,18	14.553.122	120.484.170	1.609.898.704
Renda Fixa	100,00	0,93		9,12		14.553.122	120.484.170	1.609.898.704
Renda fixa conforme CVM Art. 7º, III, "a"	100,00	0,93		9,12		14.553.122	120.484.170	1.609.898.704
BB PREV DI PER F	100,00	0,93		9,12		14.553.122	120.484.170	1.609.898.704

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\$4.693.518.041,62	49,19%	100,00%	Título Público de emissão do TN (SELIC)	R\$4.847.189.143,58
Art 7 - I - b	R\$344.843.735,72	3,61%	100,00%	Fundos Renda fixa 100% TP/ETF	R\$9.195.863.449,48
Art 7 - III - a	R\$2.975.803.130,79	31,19%	70,00%	Renda fixa conforme CVM	R\$3.702.691.898,85
Art 7 - IV	R\$1.048.811.655,00	10,99%	20,00%	Renda Fixa em Instituições Financeiras	R\$859.329.782,04
Art. 7 - V - a	R\$42.805.540,67	0,45%	5,00%	FI em Direitos Creditórios (FIDC)	R\$434.229.818,59
Art 7 - V - b	R\$315.157.677,43	3,30%	5,00%	Renda Fixa em Crédito Privado	R\$161.877.681,83
Art 8 - I - a	R\$119.767.403,97	1,26%	40,00%	Fundo de Ações CVM	R\$3.696.515.470,11
Art 9 - II	R\$0,00	0,00%	10,00%	FIC Aberto - Investimento no Exterior	R\$954.070.718,52
Art 9 - III	R\$0,00	0,00%	10,00%	Fundo de Ações – BDR Nível I	R\$954.070.718,52
Art 10 - I - a	R\$0,00	0,00%	10,00%	Fundos Multimercados	R\$954.070.718,52
Art 11	R\$0,00	0,00%	10,00%	FI Imobiliários	R\$954.070.718,52
Art 12	R\$0,00	0,00%	10,00%	Empréstimos Consignados	R\$954.070.718,52
TOTAL	R\$9.540.707.185,20	100,00%	ENQUADRAMENTO CORRETO		

RIOPREVIDÊNCIA

www.rioprevidencia.rj.gov.br



**GOV
RJ**