

Relatório Mensal

2021

Junho

Instituto de Previdência e Assistência do Município do
Rio de Janeiro - PREVI-RIO

DIRETORIA DE
INVESTIMENTOS

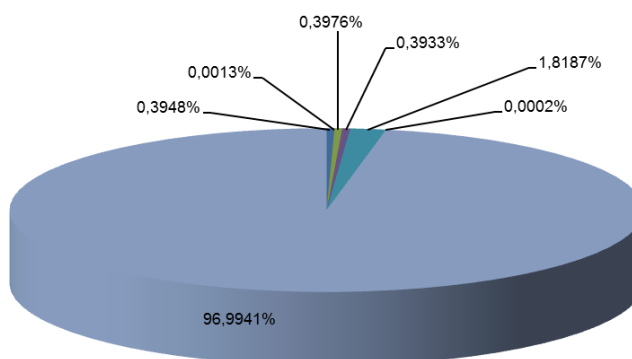
Composição da Carteira

Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)

Valor da Carteira pelo Mercado	
PREVI-RIO	R\$ 66.869.617,72
FUNPREVI	R\$ 789.537.835,53
FASS	R\$ 44.881.774,94

FUNPREVI



■ FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	■ FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF
■ FI Caixa Brasil TP RF LP	■ FI Caixa Aliança TP RF
■ FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	■ Ações
■ Imóveis	

Valor por Tipo de Ativo pelo Mercado	
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	R\$ 3.117.182,24
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 10.265,50
FI Caixa Brasil TP RF LP	R\$ 3.138.992,62
FI Caixa Aliança TP RF	R\$ 3.105.104,70
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 14.359.374,47
Ações	R\$ 1.416,00
Subtotal Valores Mobiliários Funprevi	R\$ 23.732.335,53
Imóveis	R\$ 765.805.500,00
Total Carteira Funprevi	R\$ 789.537.835,53

Valor Presente dos Recebíveis de Royalties	
Valor Presente (31/12/2020) ⁽¹⁾	R\$ 5.615.250.926,81

Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos	
(Saldo Junho 2021)	R\$ 301.916.396,42

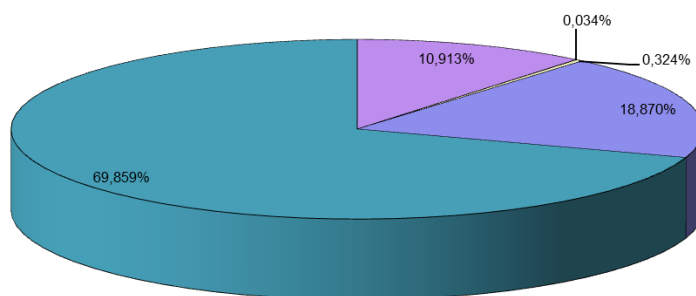
Aluguéis Recebidos	
Junho 2021	R\$ 4.203.207,72

(1) Os valores de estoque de royalties de petróleo serão atualizados anualmente conforme consumo e correções monetárias, de forma a guardar a comparabilidade com os demais relatórios oficiais (Balancete de Verificação - Contábil, emitido pela DAF; e DRAA - Atuarial, emitido pela CIP).

Composição da Carteira

Ativos Mobiliários e Imobiliários

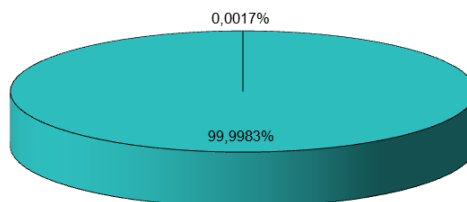
PREVI-RIO



FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	FI Caixa PCRJ RF
Imóveis	

Valor da Carteira	
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R\$ 7.297.739,95
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 22.736,76
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	R\$ 216.547,43
FI Caixa PCRJ RF	R\$ 12.618.301,61
Subtotal Valores Mobiliários Previ-Rio	R\$ 20.155.325,75
Imóveis	R\$ 46.714.291,97
Total Carteira Previ-Rio	R\$ 66.869.617,72

FASS



FI CAIXA PCRJ RF	FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF
------------------	---

Valor da Carteira	
FI CAIXA PCRJ RF	R\$ 44.880.994,76
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 780,18
Total Carteira FASS	R\$ 44.881.774,94

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

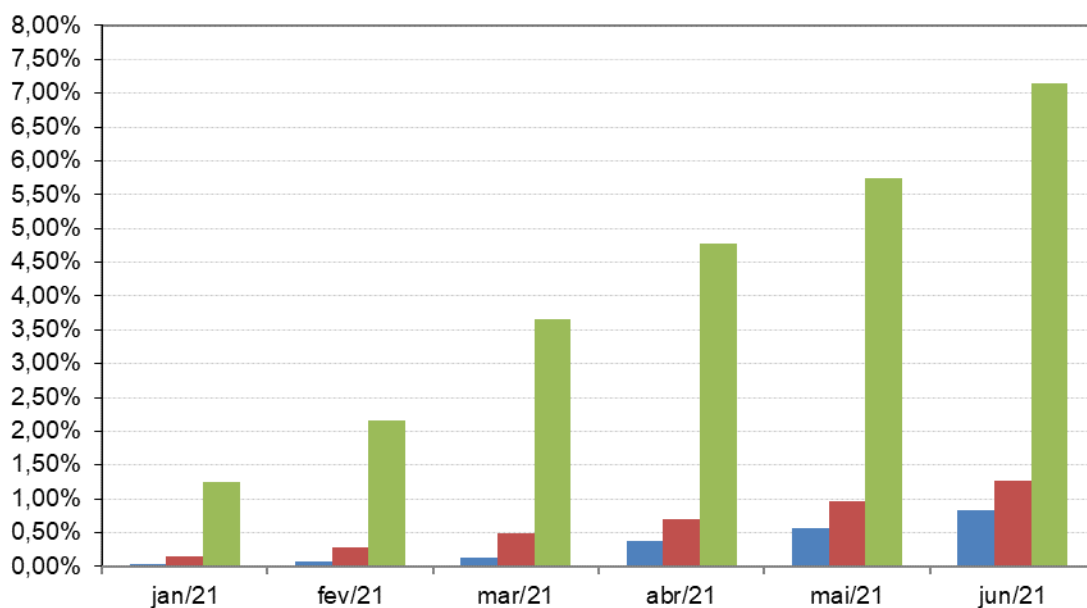
FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	jun/21	Acum. Ano	jun/21	Acum. 2021	jun/21	Acum. 2021
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,3058%	1,1569%	23,12%	16,19%	99,36%	90,55%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,2350%	0,8546%	17,77%	11,96%	76,37%	66,89%
FI Caixa Brasil TP RF LP	0,3104%	0,6481%	23,46%	24,49%	100,84%	99,40%
FI Caixa Aliança TP RF	0,2963%	0,6283%	22,40%	23,74%	96,26%	96,36%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,1886%	0,6954%	14,26%	9,73%	61,29%	54,43%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Funprevi	0,2618%	0,8230%	19,79%	11,52%	85,07%	64,42%
Meta Rentabilidade	1,3228%	7,1444%				
Selic	0,3078%	1,2776%				

OBSERVAÇÕES:

- 1) Aplicações informadas com posição de fechamento do último dia útil.
- 2) A aplicação inicial no FI Caixa Brasil TP RF LP ocorreu em 20/04/2021, portanto a rentabilidade acumulada do ano é parcial.
- 3) A aplicação inicial no FI Caixa Aliança TP RF ocorreu em 20/04/2021, portanto a rentabilidade acumulada do ano é parcial.

Rentabilidade Acumulada - Funprevi x Meta Rentabilidade x Selic



■ Rentabilidade Total Funprevi ■ Selic ■ Meta Rentabilidade (IPCA-E + 6% ao ano)

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

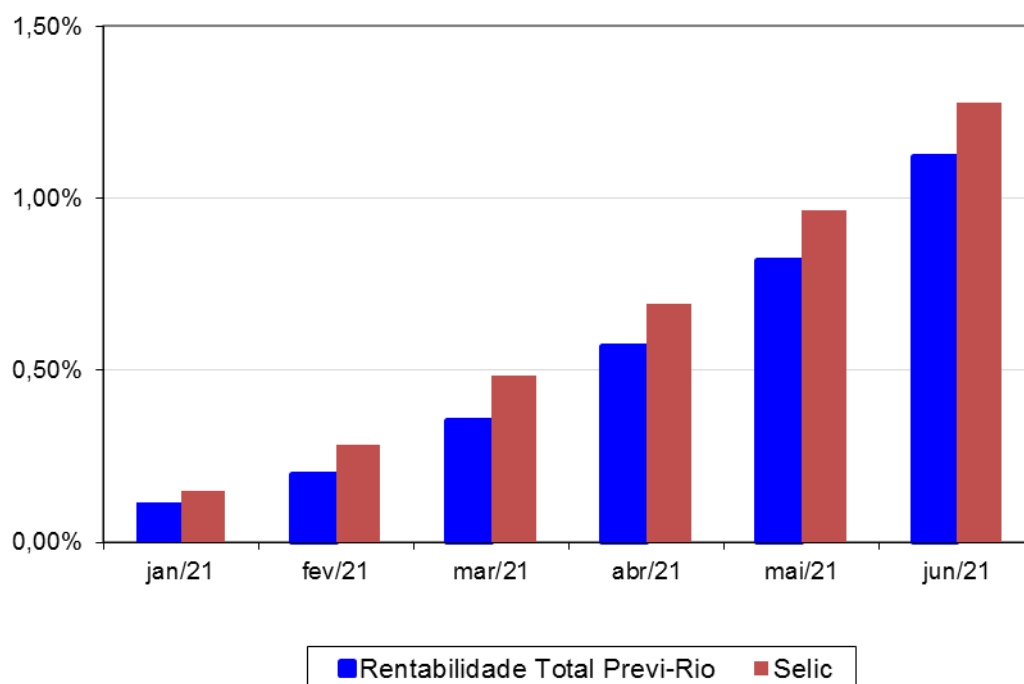
PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	jun/21	Acum. Ano	jun/21	Acum. 2021
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,3058%	1,1569%	99,36%	90,55%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,2350%	0,8546%	76,37%	66,89%
FI Caixa PCRJ RF	0,2960%	1,2155%	96,18%	95,14%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,1886%	0,6954%	61,29%	54,43%
Rentabilidade Total Previ-Rio	0,2983%	1,1218%	96,92%	87,81%
Selic	0,3078%	1,2776%		

OBSERVAÇÃO:

- 1) Aplicações informadas com posição de fechamento do último dia útil.

Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

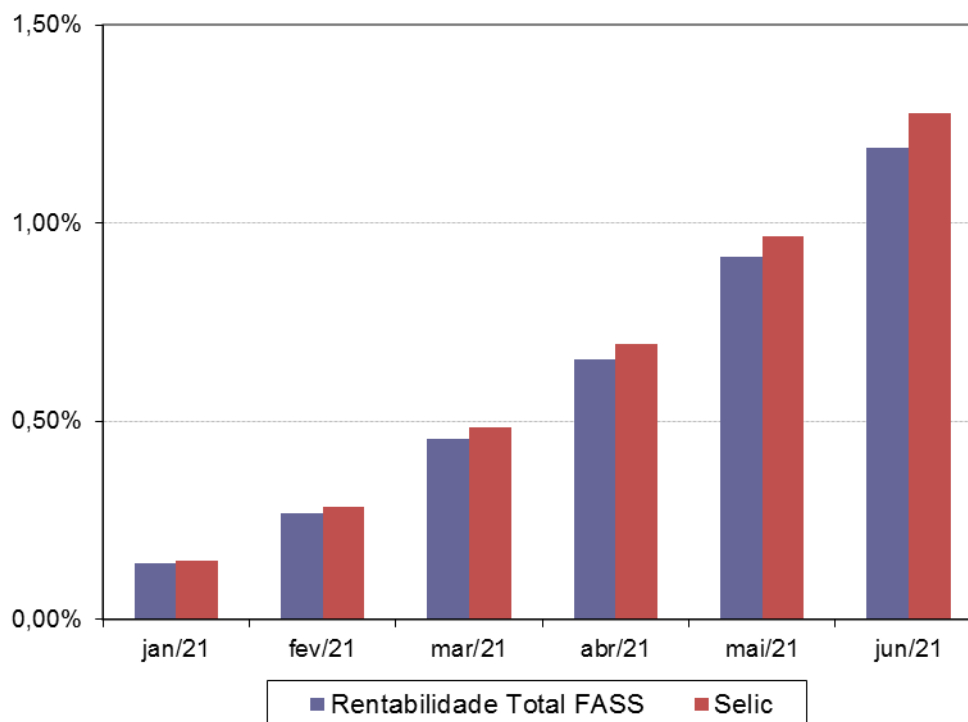
FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	jun/21	Acum. Ano	jun/21	Acum. 2021
FI Caixa PCRJ RF	0,2960%	1,2155%	96,18%	95,14%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,2350%	0,8546%	76,37%	66,89%
Rentabilidade Total FASS	0,2715%	1,1907%	88,22%	93,19%
Selic	0,3078%	1,2776%		

OBSERVAÇÃO:

- 1) Aplicações informadas com posição de fechamento do último dia útil.

Rentabilidade Acumulada - FASS x Selic



CARTEIRA FUNPREVI

Os fundos de investimentos que compõem a carteira do FUNPREVI apresentaram, em junho, rentabilidades em relação à meta de rentabilidade ⁽¹⁾ de 17,77% (FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF), 23,12% (Caixa Brasil Referenciado DI LP), 23,46% (FI Caixa Brasil TP RF LP), 22,40% (FI Caixa Aliança TP RF) e 14,26% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal. Desta forma, a carteira registrou um desempenho no mês de 19,79% em relação à meta e de 85,07% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 11,52% e de 64,42% em relação à meta e à taxa Selic, respectivamente.

O comportamento da carteira do FUNPREVI resultou diretamente de dois fatores, a saber: do atual cenário da economia brasileira e das peculiaridades do fluxo de caixa do FUNPREVI. Estas, ressalte-se, restringem sobremaneira as opções de aplicação dos recursos do RPPS.

(1 - Meta de rentabilidade de 6% + IPCA-E)