

Relatório Mensal

2021 Abril

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

DIRETORIA DE
INVESTIMENTOS

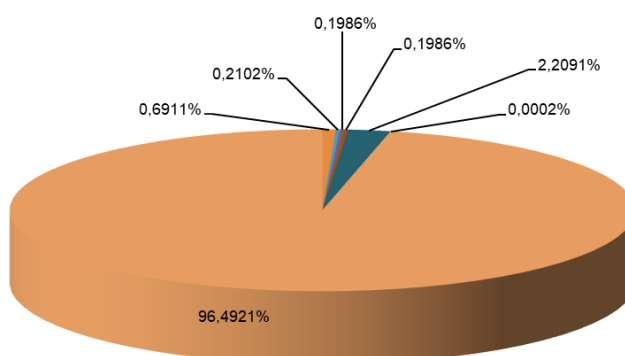
Composição da Carteira

Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)

Valor da Carteira pelo Mercado	
PREVI-RIO	R\$ 70.154.139,85
FUNPREVI	R\$ 795.780.009,12
FASS	R\$ 44.244.500,32

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\$ 5.499.862,65
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 1.672.977,29
FI Caixa Brasil TP RF LP	R\$ 1.580.742,64
FI Caixa Aliança TP RF	R\$ 1.580.805,44
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 17.579.705,10
Ações	R\$ 1.416,00
Subtotal Valores Mobiliários Funprevi	R\$ 27.915.509,12
Imóveis	R\$ 767.864.500,00
Total Carteira Funprevi	R\$ 795.780.009,12

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

Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos	
(Saldo Abril 2021)	R\$ 307.370.597,94

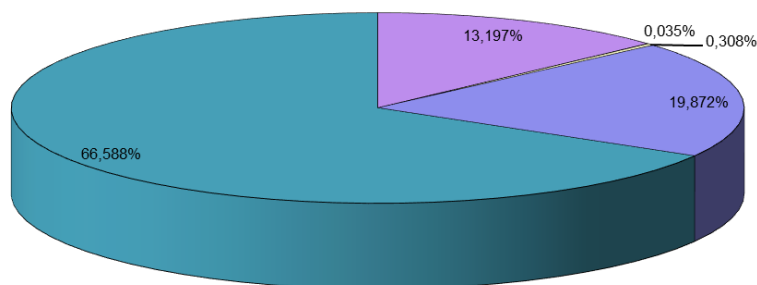
Aluguéis Recebidos	
Abril 2021	R\$ 4.203.207,72

(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

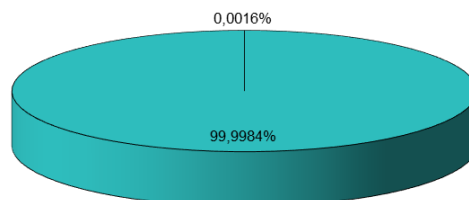
PREVI-RIO



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\$ 9.258.500,68
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 24.833,55
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	R\$ 215.772,42
FI Caixa PCRJ RF	R\$ 13.940.741,23
Subtotal Valores Mobiliários Previ-Rio	R\$ 23.439.847,88
Imóveis	R\$ 46.714.291,97
Total Carteira Previ-Rio	R\$ 70.154.139,85

FASS



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

Valor da Carteira	
FI CAIXA PCRJ RF	R\$ 44.243.784,94
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 715,38
Total Carteira FASS	R\$ 44.244.500,32

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

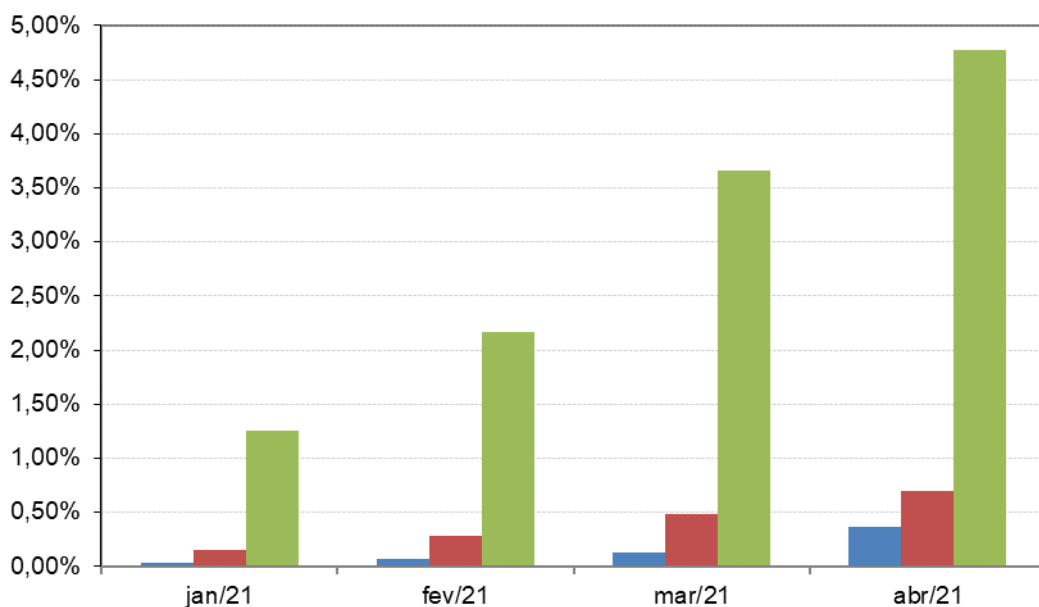
FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	abr/21	Acum. Ano	abr/21	Acum. 2021	abr/21	Acum. 2021
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,26%	0,60%	24,70%	12,65%	126,95%	86,87%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,14%	0,42%	13,20%	8,80%	67,87%	60,46%
FI Caixa Brasil TP RF LP	0,05%	0,05%	13,39%	13,39%	68,65%	68,65%
FI Caixa Aliança TP RF	0,05%	0,05%	14,27%	14,27%	73,17%	73,17%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,28%	0,34%	26,44%	7,02%	135,92%	48,23%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Funprevi	0,24%	0,37%	22,57%	7,76%	116,02%	53,31%
Meta Rentabilidade	1,07%	4,77%				
Selic	0,21%	0,69%				

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

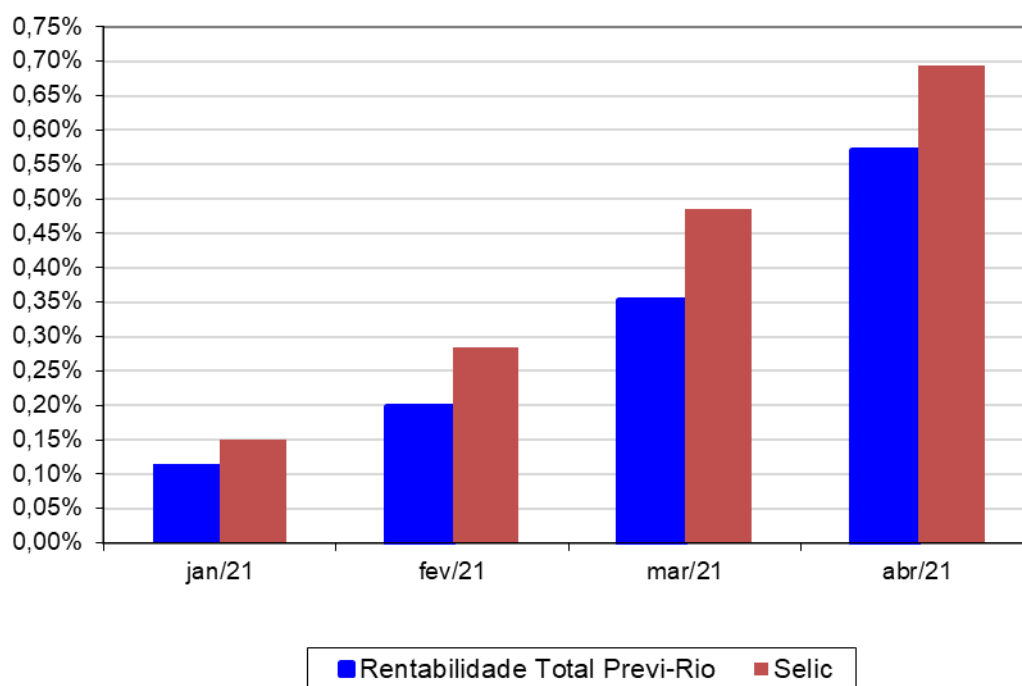
PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	abr/21	Acum. Ano	abr/21	Acum. 2021
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,26%	0,60%	126,95%	86,87%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,14%	0,42%	67,87%	60,46%
FI Caixa PCRJ RF	0,20%	0,66%	95,90%	94,54%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,28%	0,34%	135,92%	48,23%
Rentabilidade Total Previ-Rio	0,22%	0,57%	104,30%	82,11%
Selic	0,21%	0,69%		

OBSERVAÇÃO:

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

Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

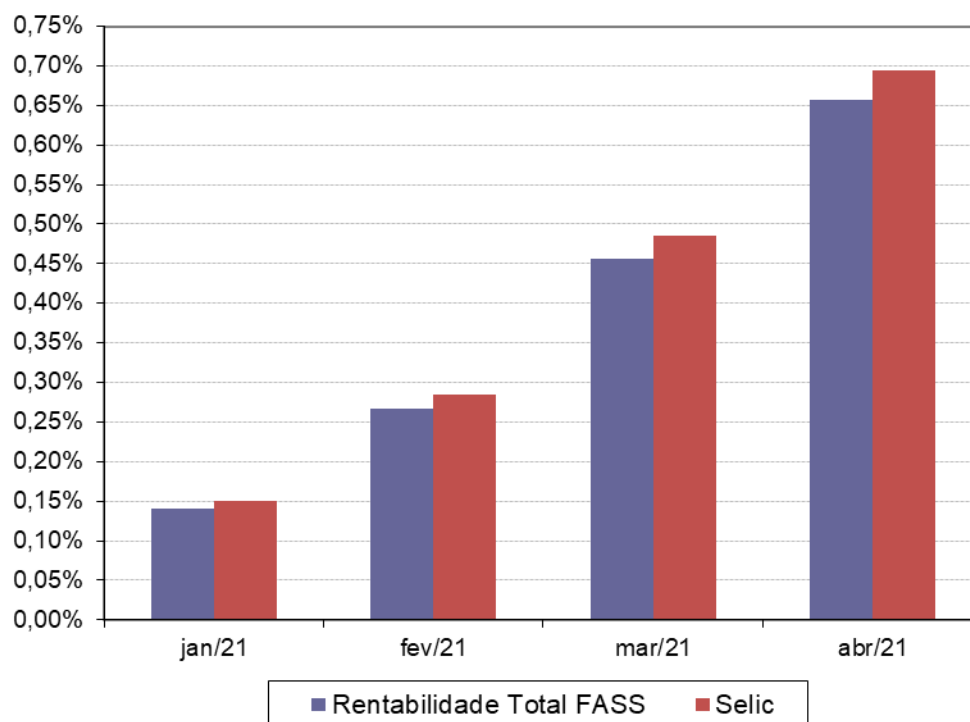
FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	abr/21	Acum. Ano	abr/21	Acum. 2021
FI Caixa PCRJ RF	0,20%	0,66%	95,90%	94,54%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,14%	0,42%	67,87%	60,46%
Rentabilidade Total FASS	0,20%	0,66%	95,90%	94,52%
Selic	0,21%	0,69%		

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 abril, rentabilidades em relação à meta de rentabilidade ⁽¹⁾ de 13,20% (FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF), 24,70% (Caixa Brasil Referenciado DI LP), 13,39% (FI Caixa Brasil TP RF LP), 14,27% (FI Caixa Aliança TP RF) e 26,44% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal. Desta forma, a carteira registrou um desempenho no mês de 22,57% em relação à meta e de 116,02% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 7,76% e de 53,31% 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)