

Relatório Mensal

2021

Novembro

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

DIRETORIA DE
INVESTIMENTOS

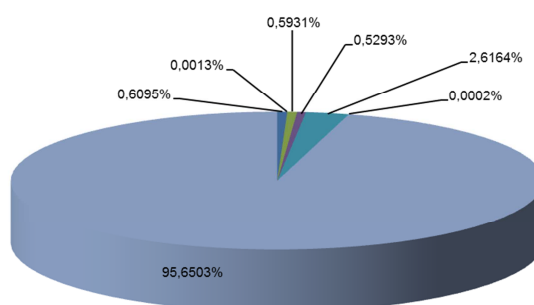
Composição da Carteira

Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)

Valor da Carteira pelo Mercado	
PREVI-RIO	R\$ 56.749.990,04
FUNPREVI	R\$ 802.106.868,38
FASS	R\$ 43.987.720,11

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\$ 4.888.810,80
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 10.229,22
FI Caixa Brasil TP RF LP	R\$ 4.757.520,70
FI Caixa Aliança TP RF	R\$ 4.245.295,58
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 20.986.072,71
Ações	R\$ 1.416,00
Subtotal Valores Mobiliários Funprevi	R\$ 34.889.345,01
Imóveis	R\$ 767.217.523,37
Total Carteira Funprevi	R\$ 802.106.868,38

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

Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos	
(Saldo Novembro 2021)	R\$ 295.231.987,46

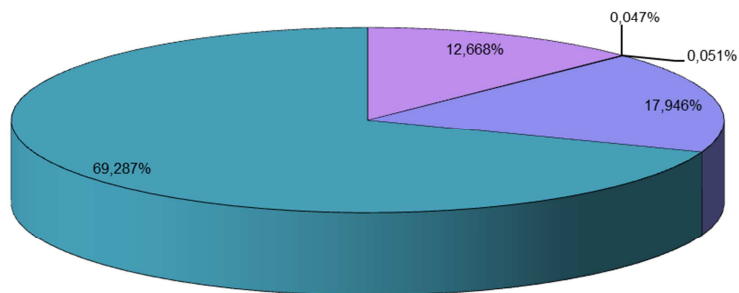
Aluguéis Recebidos	
Novembro 2021	R\$ 4.319.617,72

(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

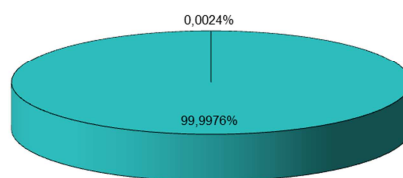
PREVI-RIO



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\$ 7.189.224,87
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 26.885,65
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	R\$ 29.218,06
FI Caixa PCRJ RF	R\$ 10.184.392,86
Subtotal Valores Mobiliários Previ-Rio	R\$ 17.429.721,44
Imóveis	R\$ 39.320.268,60
Total Carteira Previ-Rio	R\$ 56.749.990,04

FASS



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

Valor da Carteira	
FI CAIXA PCRJ RF	R\$ 43.986.668,33
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 1.051,78
Total Carteira FASS	R\$ 43.987.720,11

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

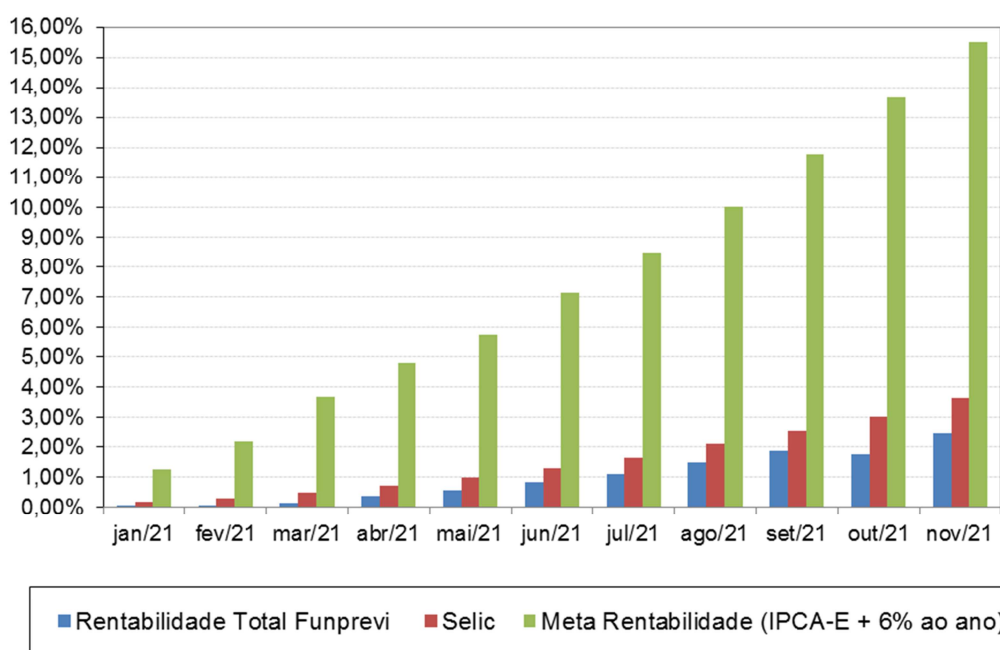
FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	nov/21	Acum. Ano	nov/21	Acum. 2021	nov/21	Acum. 2021
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,6224%	3,8118%	37,93%	24,55%	106,07%	105,11%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,4748%	2,6430%	28,94%	17,02%	80,92%	72,88%
FI Caixa Brasil TP RF LP	0,5942%	3,0125%	36,21%	28,22%	101,26%	100,87%
FI Caixa Aliança TP RF	0,5728%	2,8776%	34,91%	26,96%	97,62%	96,35%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,7801%	1,8367%	47,54%	11,83%	132,95%	50,64%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Funprevi	0,6766%	2,4403%	41,24%	15,72%	115,31%	67,29%
Meta Rentabilidade	1,6408%	15,5247%				
Selic	0,5868%	3,6266%				

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 da Carteira de Ativos Mobiliários

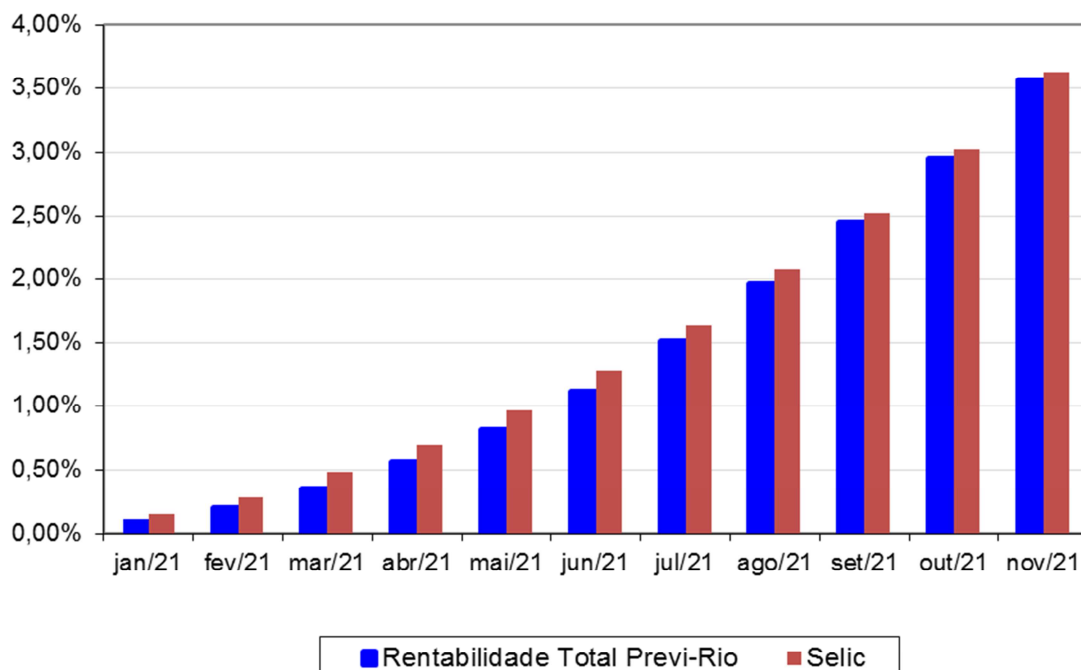
PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	nov/21	Acum. Ano	nov/21	Acum. 2021
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,6224%	3,8118%	106,07%	105,11%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,4748%	2,6430%	80,92%	72,88%
FI Caixa PCRJ RF	0,5797%	3,5081%	98,79%	96,73%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,7801%	1,8367%	132,95%	50,64%
Rentabilidade Total Previ-Rio	0,5988%	3,5685%	102,05%	98,40%
Selic	0,5868%	3,6266%		

OBSERVAÇÃO:

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

Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

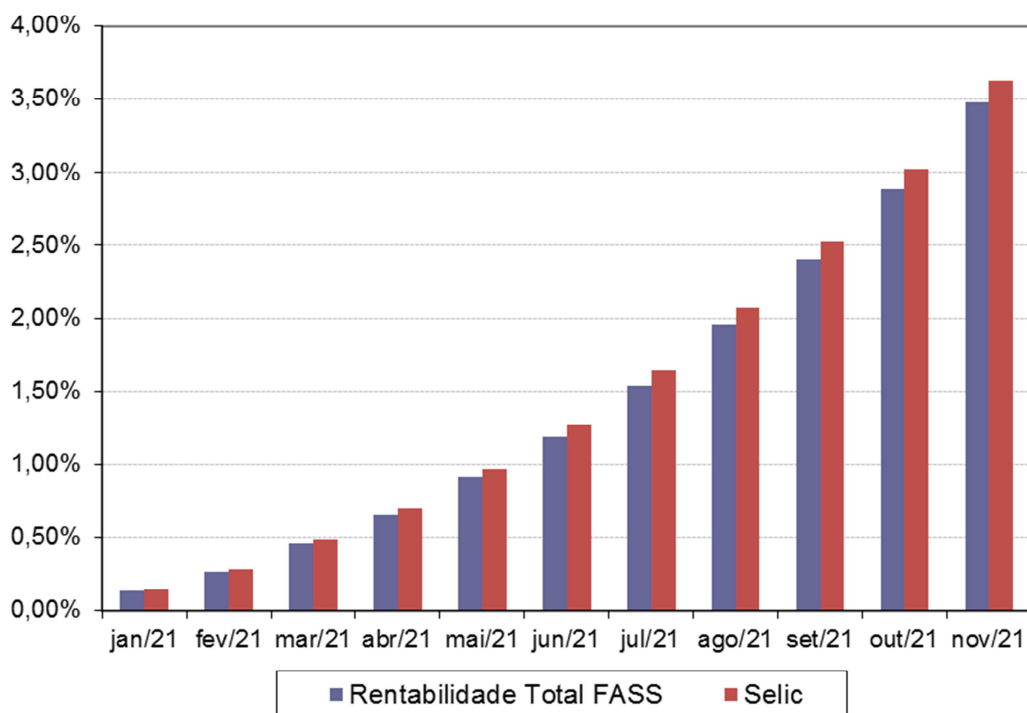
FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	nov/21	Acum. Ano	nov/21	Acum. 2021
FI Caixa PCRJ RF	0,5797%	3,5081%	98,79%	96,73%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,4748%	2,6430%	80,92%	72,88%
Rentabilidade Total FASS	0,5797%	3,4827%	98,79%	96,03%
Selic	0,5868%	3,6266%		

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 novembro, rentabilidades em relação à meta de rentabilidade ⁽¹⁾ de 28,94% (FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF), 37,93% (Caixa Brasil Referenciado DI LP), 36,21% (FI Caixa Brasil TP RF LP), 34,91% (FI Caixa Aliança TP RF) e 47,54% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal. Desta forma, a carteira registrou um desempenho no mês de 41,24% em relação à meta e de 115,31% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 15,72% e de 67,29% 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)