

# Relatório Mensal

2021

# Outubro

---

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

DIRETORIA DE  
INVESTIMENTOS

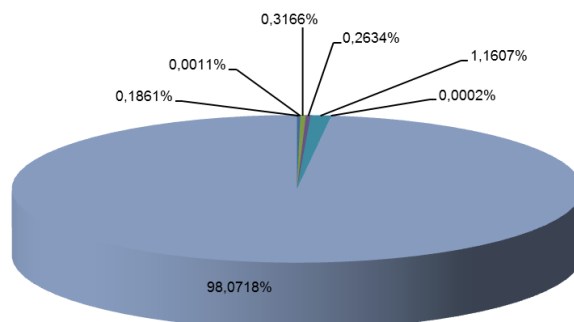
# Composição da Carteira

## Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

### TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)

Valor da Carteira pelo Mercado	
PREVI-RIO	R\$ 66.824.937,80
FUNPREVI	R\$ 774.762.209,94
FASS	R\$ 45.509.398,89

### 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\$ 1.442.102,35
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 8.756,02
FI Caixa Brasil TP RF LP	R\$ 2.453.190,59
FI Caixa Aliança TP RF	R\$ 2.040.467,95
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 8.992.777,03
Ações	R\$ 1.416,00
Subtotal Valores Mobiliários Funprevi	R\$ 14.938.709,94
Imóveis	R\$ 759.823.500,00
Total Carteira Funprevi	R\$ 774.762.209,94

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

Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos	
(Saldo Outubro 2021)	R\$ 295.710.496,81

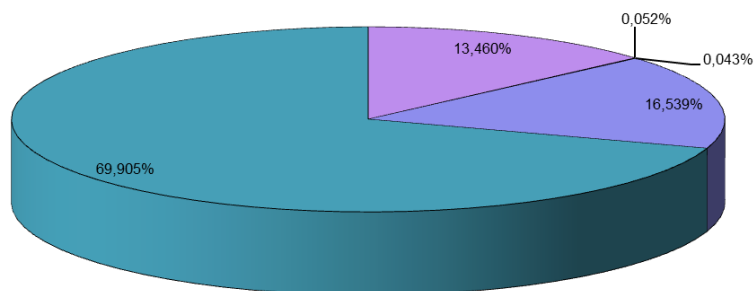
Aluguéis Recebidos	
Outubro 2021	R\$ 4.217.374,72

(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

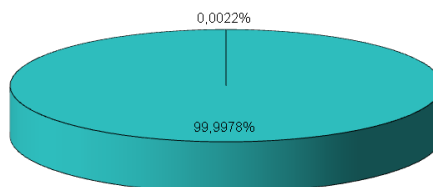
### PREVI-RIO



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\$ 8.994.753,75
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 34.898,24
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	R\$ 28.991,90
FI Caixa PCRJ RF	R\$ 11.052.001,94
Subtotal Valores Mobiliários Previ-Rio	R\$ 20.110.645,83
Imóveis	R\$ 46.714.291,97
<b>Total Carteira Previ-Rio</b>	<b>R\$ 66.824.937,80</b>

### FASS



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

Valor da Carteira	
FI CAIXA PCRJ RF	R\$ 45.508.397,27
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 1.001,62
<b>Total Carteira FASS</b>	<b>R\$ 45.509.398,89</b>

# Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

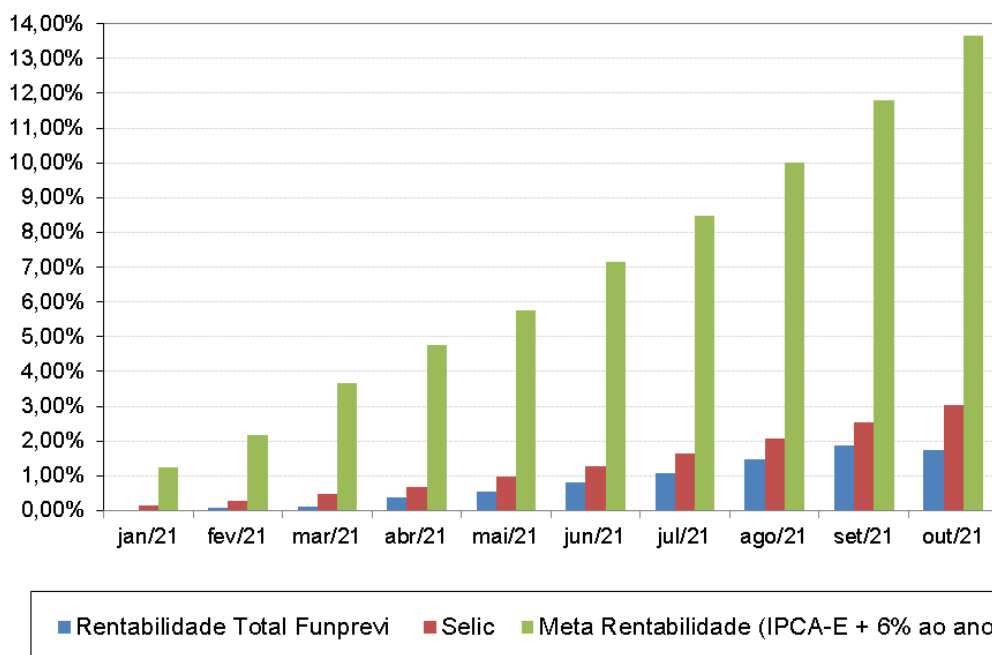
## FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	out/21	Acum. Ano	out/21	Acum. 2021	out/21	Acum. 2021
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,5028%	3,1697%	30,09%	23,20%	103,47%	104,88%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,3770%	2,1579%	22,56%	15,80%	77,58%	71,40%
FI Caixa Brasil TP RF LP	0,5204%	2,4040%	31,14%	27,05%	107,07%	100,77%
FI Caixa Aliança TP RF	0,4626%	2,2917%	27,68%	25,78%	95,19%	96,06%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	-0,5357%	1,0484%	-32,06%	7,68%	-110,22%	34,69%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Funprevi	-0,1178%	1,7519%	-7,05%	12,82%	-24,24%	57,97%
Meta Rentabilidade	1,6710%	13,6597%				
Selic	0,4860%	3,0222%				

### 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

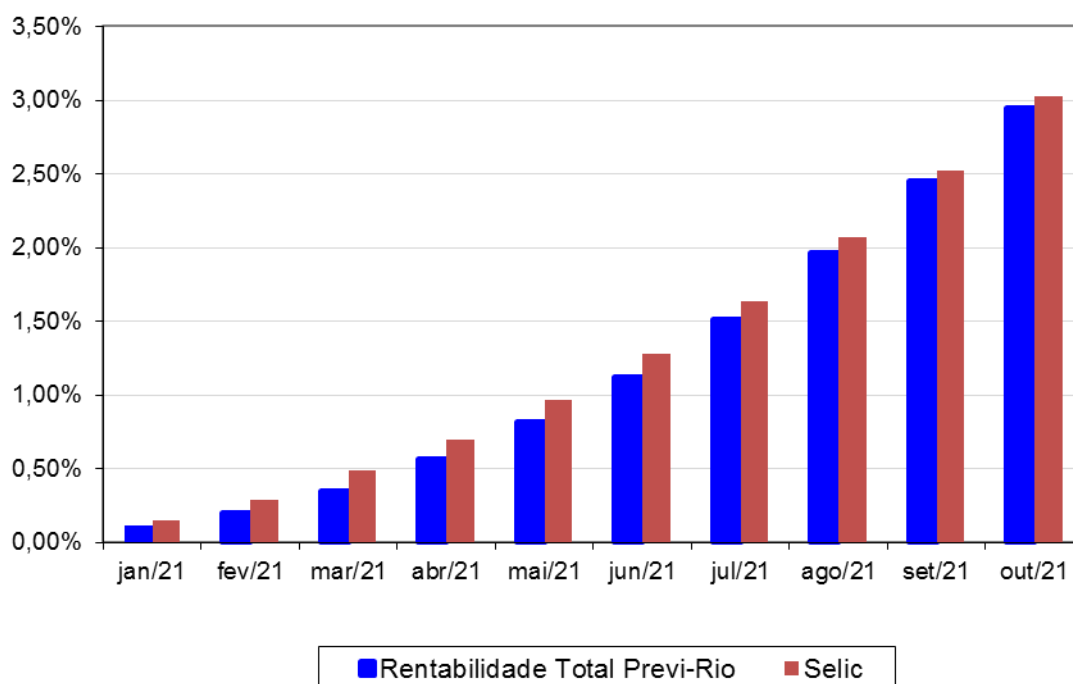
## PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	out/21	Acum. Ano	out/21	Acum. 2021
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,5028%	3,1697%	103,47%	104,88%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,3770%	2,1579%	77,58%	71,40%
FI Caixa PCRJ RF	0,4740%	2,9116%	97,53%	96,34%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	-0,5357%	1,0484%	-110,22%	34,69%
Rentabilidade Total Previ-Rio	0,4861%	2,9520%	100,02%	97,68%
Selic	0,4860%	3,0222%		

### OBSERVAÇÃO:

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

### Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



# Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

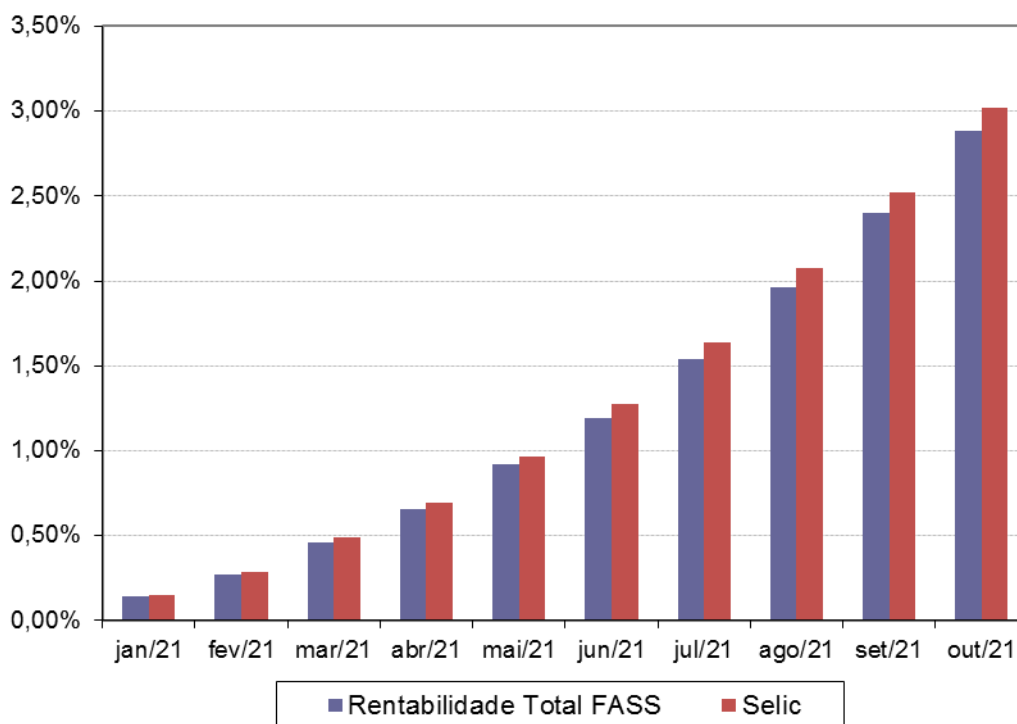
## FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	out/21	Acum. Ano	out/21	Acum. 2021
FI Caixa PCRJ RF	0,4740%	2,9116%	97,53%	96,34%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,3770%	2,1579%	77,58%	71,40%
Rentabilidade Total FASS	0,4740%	2,8863%	97,53%	95,51%
Selic	0,4860%	3,0222%		

### 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 outubro, rentabilidades em relação à meta de rentabilidade <sup>(1)</sup> de 22,56% (FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF), 30,09% (Caixa Brasil Referenciado DI LP), 31,14% (FI Caixa Brasil TP RF LP), 27,68% (FI Caixa Aliança TP RF) e -32,06% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal. Desta forma, a carteira registrou um desempenho no mês de -7,05% em relação à meta e de -24,24% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 12,82% e de 57,97% 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)