

Relatório Mensal

2021

Setembro

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

DIRETORIA DE
INVESTIMENTOS

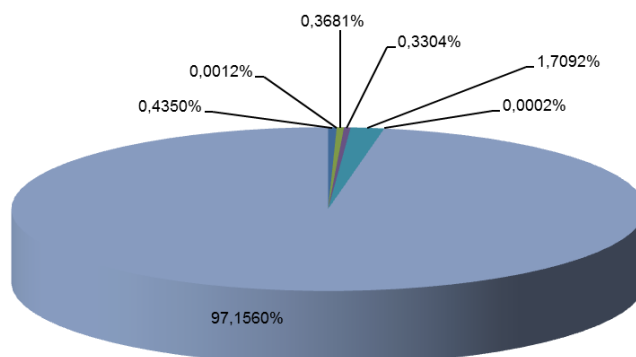
Composição da Carteira

Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)

Valor da Carteira pelo Mercado	
PREVI-RIO	R\$ 77.306.641,95
FUNPREVI	R\$ 782.065.467,23
FASS	R\$ 44.927.437,82

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\$ 3.401.765,88
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 9.227,04
FI Caixa Brasil TP RF LP	R\$ 2.878.507,37
FI Caixa Aliança TP RF	R\$ 2.583.999,82
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 13.367.051,12
Ações	R\$ 1.416,00
Subtotal Valores Mobiliários Funprevi	R\$ 22.241.967,23
Imóveis	R\$ 759.823.500,00
Total Carteira Funprevi	R\$ 782.065.467,23

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

Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos	
(Saldo Setembro 2021)	R\$ 296.392.122,38

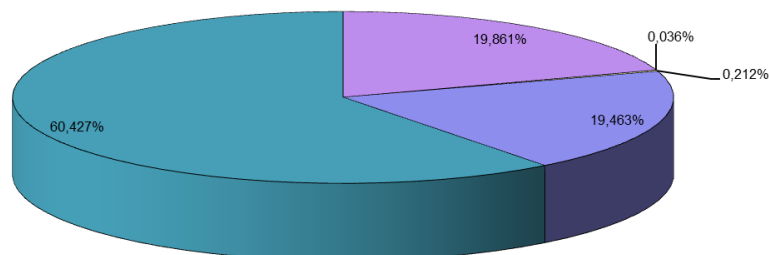
Aluguéis Recebidos	
Setembro 2021	R\$ 4.203.207,72

(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

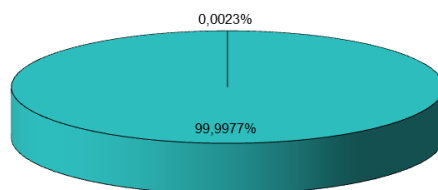
PREVI-RIO



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\$ 15.354.006,35
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 27.599,79
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	R\$ 164.209,49
FI Caixa PCRJ RF	R\$ 15.046.534,35
Subtotal Valores Mobiliários Previ-Rio	R\$ 30.592.349,98
Imóveis	R\$ 46.714.291,97
Total Carteira Previ-Rio	R\$ 77.306.641,95

FASS



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

Valor da Carteira	
FI CAIXA PCRJ RF	R\$ 44.926.426,27
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 1.011,55
Total Carteira FASS	R\$ 44.927.437,82

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

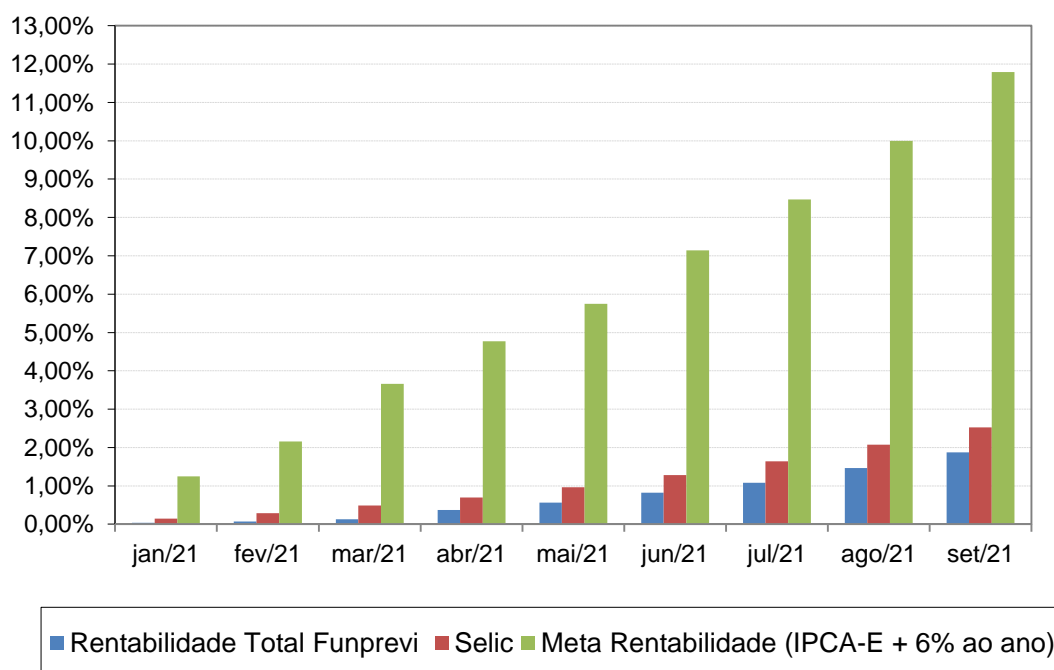
FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	set/21	Acum. Ano	set/21	Acum. 2021	set/21	Acum. 2021
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,5297%	2,6535%	32,41%	22,50%	119,85%	105,14%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,3345%	1,7742%	20,47%	15,05%	75,68%	70,30%
FI Caixa Brasil TP RF LP	0,4309%	1,8739%	26,37%	26,40%	97,49%	99,12%
FI Caixa Aliança TP RF	0,4183%	1,8207%	25,59%	25,65%	94,63%	96,30%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,3782%	1,5926%	23,14%	13,51%	85,57%	63,10%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Funprevi	0,4032%	1,8719%	24,67%	15,87%	91,23%	74,16%
Meta Rentabilidade	1,6343%	11,7917%				
Selic	0,4420%	2,5239%				

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

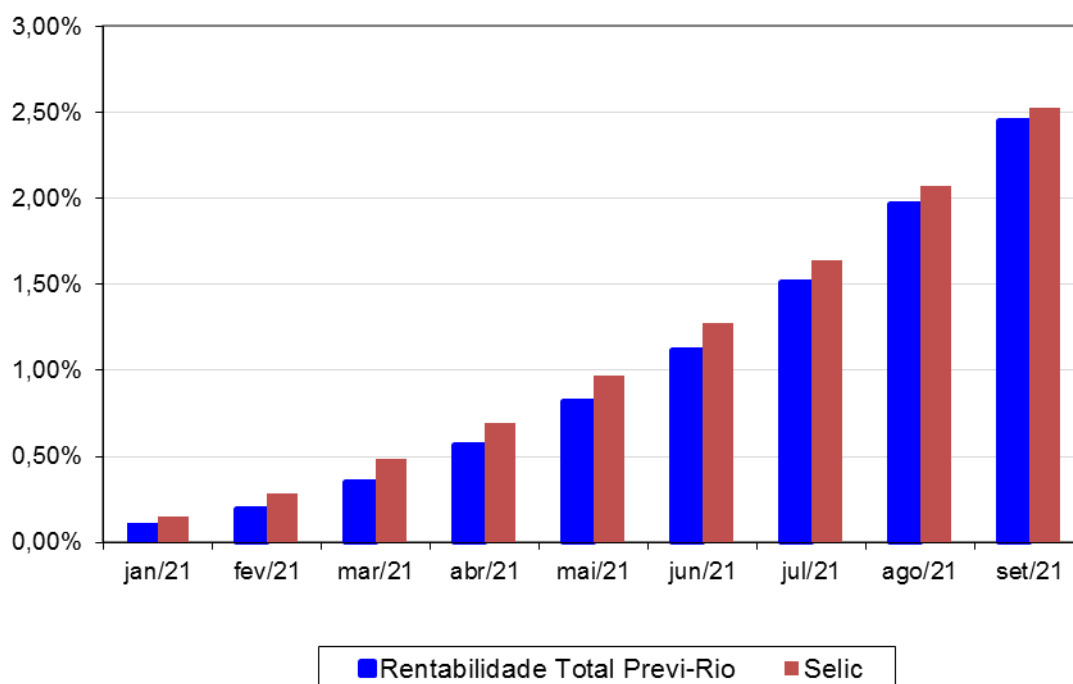
PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	set/21	Acum. Ano	set/21	Acum. 2021
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,5297%	2,6535%	119,85%	105,14%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,3345%	1,7742%	75,68%	70,30%
FI Caixa PCRJ RF	0,4324%	2,4261%	97,83%	96,12%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,3782%	1,5926%	85,57%	63,10%
Rentabilidade Total Previ-Rio	0,4802%	2,4540%	108,64%	97,23%
Selic	0,4420%	2,5239%		

OBSERVAÇÃO:

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

Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

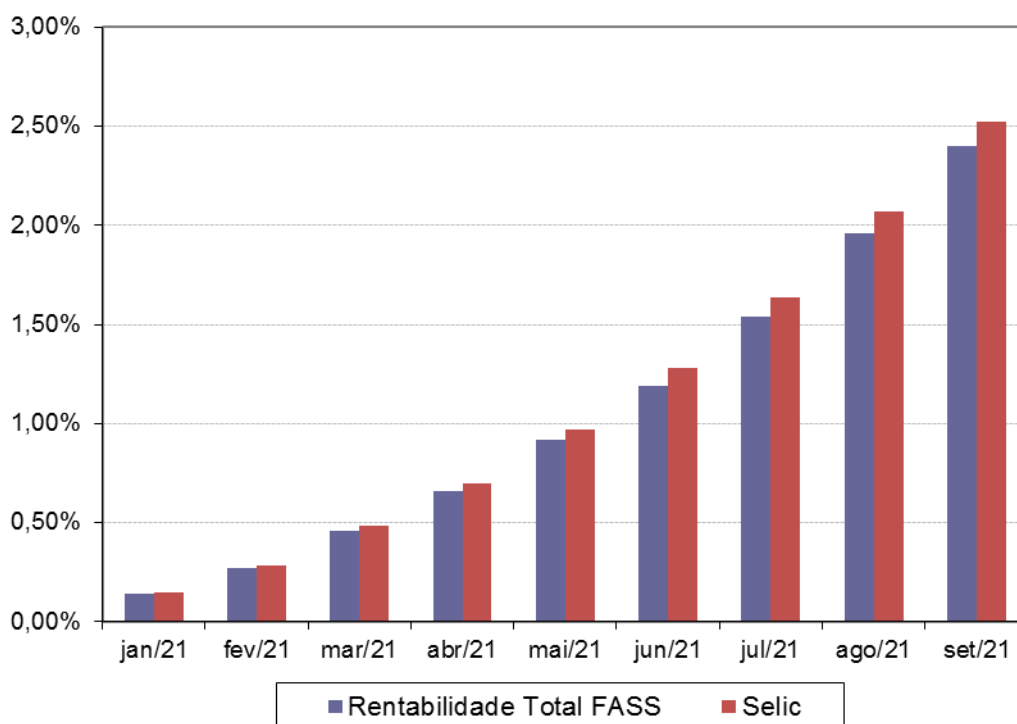
FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	set/21	Acum. Ano	set/21	Acum. 2021
FI Caixa PCRJ RF	0,4324%	2,4261%	97,83%	96,12%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,3345%	1,7742%	75,68%	70,30%
Rentabilidade Total FASS	0,4324%	2,4010%	97,83%	95,13%
Selic	0,4420%	2,5239%		

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 setembro, rentabilidades em relação à meta de rentabilidade ⁽¹⁾ de 20,47% (FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF), 32,41% (Caixa Brasil Referenciado DI LP), 26,37% (FI Caixa Brasil TP RF LP), 25,59% (FI Caixa Aliança TP RF) e 23,14% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal. Desta forma, a carteira registrou um desempenho no mês de 24,67% em relação à meta e de 91,23% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 15,87% e de 74,16% 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)