



FUNPREVI

Relatório Mensal de Investimentos

Valores Mobiliários

julho 2024

PREVI-RIO

AUTARQUIA GESTORA DO FUNPREVI

PRESIDENTE

MELISSA GARRIDO CABRAL

CHEFE DE GABIENTE

FERNANDA NUNES LEIROZ

DIRETOR DE INVESTIMENTOS

FABIO LUIZ LOPES FERREIRA

GERENTE DE ATIVOS MOBILIÁRIOS

**MARIA FERNANDA MARQUES
LIMA MURÇA**

EQUIPE DA GERÊNCIA DE ATIVOS
MOBILIÁRIOS (DIN/GAM)

**LÚCIA DE FÁTIMA MANSUR
TRINDADE DE ALMEIDA**

MÁRCIA FERREIRA FERRAZ

MÁRCIA SATIKO TOMARI

RICARDO JOSÉ PEREIRA ALVAREZ

COMITÊ DE INVESTIMENTOS

FÁBIO LUIZ LOPES FERREIRA

**JORGE EDMUNDO FERREIRA
FARAH**

**MANOEL ARISTIDES MONTEIRO
DO NASCIMENTO**

**MARIA FERNANDA MARQUES
LIMA MURÇA**

MELISSA GARRIDO CABRAL

OSWALDO LOUREIRO ROQUETTE

**VANESSA GONÇALVES QUINTINO
EVANGELISTA**

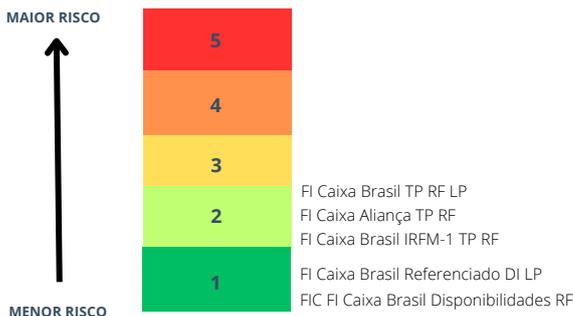


1. FUNDOS DE INVESTIMENTO

CARACTERÍSTICAS DOS FUNDOS DE INVESTIMENTO

FUNDO DE INVESTIMENTOS	LIQUIDEZ	VOLATILIDADE ¹	ENQUADRAMENTO (RES. CMN 4.963/21)
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	Diária	0,08%	Art. 7º, III, a
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	Diária	0,06%	Art. 7º, III, a
FI Caixa Brasil TP RF LP	Diária	0,10%	Art. 7º, I, b
FI Caixa Aliança TP RF	Diária	0,06%	Art. 7º, I, b
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	Diária	0,38%	Art. 7º, I, b

GRAU DE RISCO



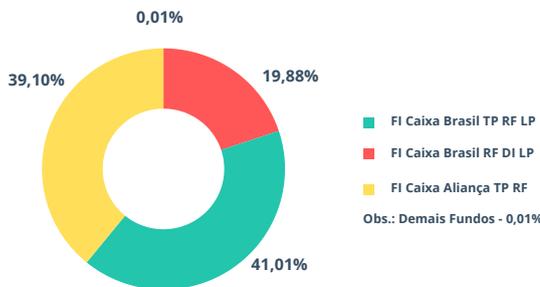
LIMITE PARA A APLICAÇÃO DE RECURSOS

SEGMENTO (RES. CMN 4.963/21)	LIMITE DE APLICAÇÃO	
	RES. CMN 4.963/21	P.A.I.?(ESTRATÉGIA)
Art. 7º, I, b	100 %	80%
Art. 7º, III, a	60 %	20%

2. CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - POSIÇÃO: 31/07/2024

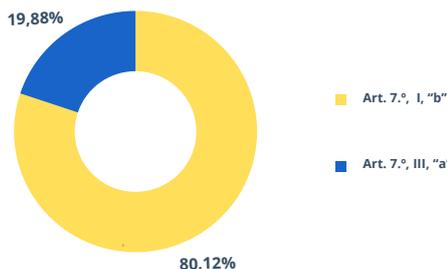
APLICAÇÕES POR FUNDO DE INVESTIMENTO

FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	R\$83.535.938,99
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 6.747,98
FI Caixa Brasil TP RF LP	R\$172.293.084,93
FI Caixa Aliança TP RF	R\$164.288.660,94
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 34.286,71
Total	R\$420.158.719,55



APLICAÇÕES POR ENQUADRAMENTO LEGAL RESOLUÇÃO CMN N.º 4.963/21

Art. 7º, inciso I, alínea "b"	R\$336.616.032,58
Art. 7º, inciso III, alínea "a"	R\$83.542.686,97
Total	R\$420.158.719,55



Nota:

- Volatilidade medida nos últimos 12 meses.
- P.A.I.: Política Anual de Investimentos, aprovada pelo Conselho de Administração do PREVI-RIO.

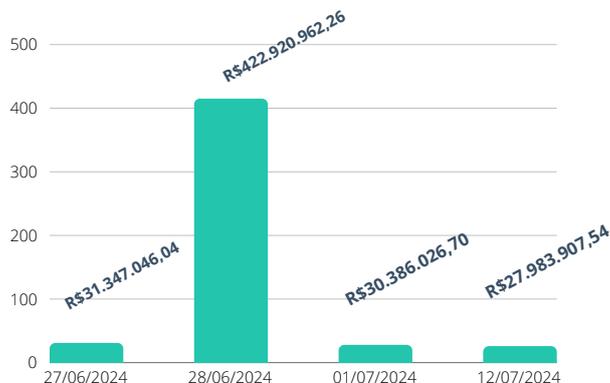
3. VALORES MOBILIÁRIOS - DE 27/06/2024 A 12/07/2024

27/06/2024 - Posição anterior a arrecadação das contribuições patronal e suplementar do mês junho/2024.

28/06/2024 - Posição após a arrecadação das contribuições patronal e suplementar do mês junho/2024

01/07/2024 - Posição após o resgate dos recursos necessários ao pagamento das folhas líquidas¹ de aposentadoria e de pensão

12/07/2024 - Posição após o Resgate dos recursos necessários ao pagamento dos valores das consignações, considerando as receitas arrecadadas até esta data.

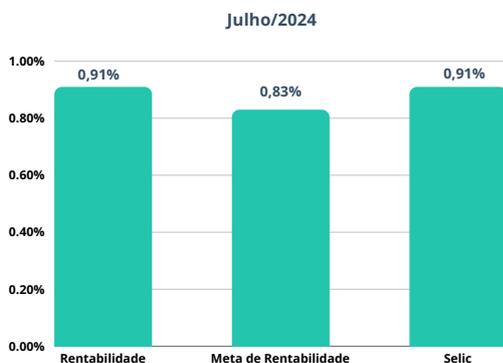


4. DESEMPENHO DOS FUNDOS

Julho/2024			
Ativo	Rentabilidade Nominal	% Meta	% Selic
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	0,9722%	117,05%	107,18%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF Simples	0,8144%	98,05%	89,78%
FI Caixa Brasil TP RF LP	0,9148%	110,13%	100,85%
FI Caixa Aliança TP RF	0,8859%	106,66%	97,66%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	0,9287%	111,81%	102,38%

Acumulado/2024			
Ativo	Rentabilidade Nominal	% Meta	% Selic
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	6,3878%	100,61%	103,51%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF Simples	5,5518%	87,44%	89,97%
FI Caixa Brasil TP RF LP	5,9596%	93,87%	96,57%
FI Caixa Aliança TP RF	6,0320%	95,01%	97,75%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	5,4551%	85,92%	88,40%

5. DESEMPENHO DA CARTEIRA



Nota:

1. Folha Líquida: é o resultado da subtração dos valores das consignações da folha bruta das aposentadorias e das pensões.

6. RATING DA ADMINISTRADORA DOS FUNDOS DE INVESTIMENTO

Os fundos de investimentos que compõem a carteira do FUNPREVI são administrados pela Caixa Econômica Federal e geridos pela Caixa Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários S.A. (Caixa DTVM), subsidiária da mencionada instituição financeira, e auditados pela Deloitte Touche Tohmatsu Auditores Independentes LTDA .

A Caixa Econômica é uma das mais antigas e sólidas instituições financeiras do Brasil, sendo uma das principais no que tange à gestão de ativos e poupança no Brasil.

As notas atribuídas à Caixa Econômica Federal pelas agências classificadoras de risco abaixo listadas avalizam a sua capacidade e disposição em honrar com suas obrigações tempestivamente.

É importante destacar que a Caixa Econômica Federal é instituição financeira associada à Associação Brasileira das Entidades dos Mercados Financeiro e de Capitais - ANBIMA, e segue as regras de conduta por ela estabelecida, as quais tem por objetivo garantir a sustentabilidade do mercado e a segurança do investidor.

Ratings Perspectiva	Escala Global				Escala Nacional	
	Moeda Local		Moeda Estrangeira		Longo Prazo	Curto Prazo
	Longo Prazo	Curto Prazo	Longo Prazo	Curto Prazo		
Fitch Ratings	BB (Estável)	B	BB (Estável)	B	AAA (bra) (Estável)	F1+ (bra)
Moody's	Ba2 (Positiva)	Not Prime	Ba2 (Positiva)	Not Prime	AAA.br (Estável)	ML A – 1.br
Standard Poor's	BB (Estável)	B	BB (Estável)	B	BrAAA (Estável)	brA-1 +

Fitch: último relatório 15/04/2024

Moody's Escala Global: último relatório 15/05/2024

Moody's Escala Nacional: último relatório 26/12/2023

S&P: último relatório 28/03/2024

7. COMENTÁRIOS

Os fundos de investimentos que compõem a carteira do FUNPREVI apresentaram, em julho, rentabilidades em relação à meta de rentabilidade¹ de 98,05% (FIC de FI Caixa Brasil Disponibilidades RF Simples), 117,05% (Caixa Brasil Referenciado DI LP), 110,13% (FI Caixa Brasil TP RF LP), 106,66% (FI Caixa Aliança TP RF) e 111,81% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal. Desta forma, a carteira registrou um desempenho no mês de 110,01% em relação à meta e de 100,73% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 95,61% e de 98,37% em relação à meta e à taxa Selic, respectivamente.

A despeito disso, a Diretoria de Investimentos sustenta que, em razão de os atuais fundos de investimento apresentarem baixa volatilidade e liquidez diária, ainda são os mais adequados ao atendimento das necessidades de caixa do FUNPREVI.

8. PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

Os membros do Comitê de Investimento declaram que os fundos que, atualmente, compõem a carteira do FUNPREVI são aderentes à Resolução CMN n.º 4.963/21 e à Política Anual de Investimentos para o exercício 2024, aprovada pelo Conselho de Administração do PREVI-RIO na 134ª Reunião Ordinária, ocorrida em 11/11/2023, e de baixo risco. Não obstante, é importante que se atente para o aspecto da rentabilidade, a qual vêm apresentando resultados abaixo das metas estabelecidas.

NOTAS:

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



PREVI-RIO

