



# FUNPREVI

Relatório Mensal de Investimentos

Valores Mobiliários

setembro 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**

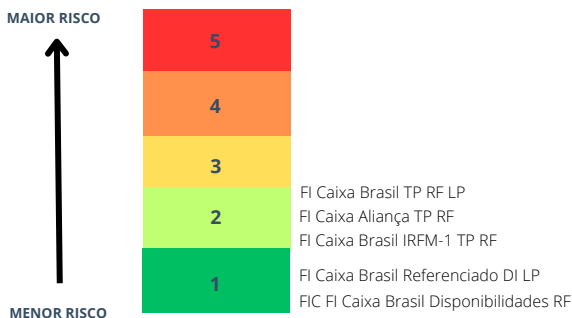


### 1. FUNDOS DE INVESTIMENTO

#### CARACTERÍSTICAS DOS FUNDOS DE INVESTIMENTO

FUNDO DE INVESTIMENTOS	LIQUIDEZ	VOLATILIDADE <sup>1</sup>	ENQUADRAMENTO (RES. CMN 4.963/21)
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	Diária	0,06%	Art. 7º, III, a
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	Diária	0,04%	Art. 7º, III, a
FI Caixa Brasil TP RF LP	Diária	0,10%	Art. 7º, I, b
FI Caixa Aliança TP RF	Diária	0,04%	Art. 7º, I, b
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	Diária	0,41%	Art. 7º, I, b

#### GRAU DE RISCO



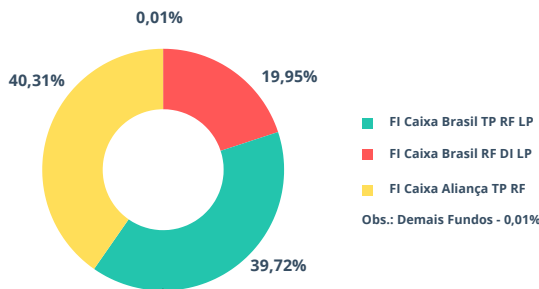
#### LIMITE PARA A APLICAÇÃO DE RECURSOS

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: 30/09/2024

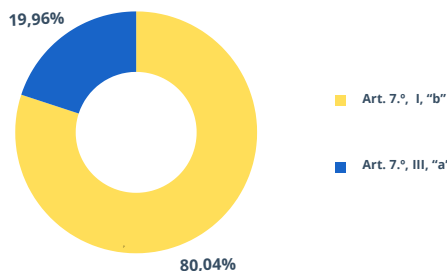
#### APLICAÇÕES POR FUNDO DE INVESTIMENTO

FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	R\$83.514.434,12
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 10.038,59
FI Caixa Brasil TP RF LP	R\$166.245.425,28
FI Caixa Aliança TP RF	R\$168.711.211,52
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 34.821,97
<b>Total</b>	<b>R\$418.515.931,48</b>



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

Art. 7º, inciso I, alínea "b"	R\$334.991.458,77
Art. 7º, inciso III, alínea "a"	R\$83.524.472,71
<b>Total</b>	<b>R\$418.515.931,48</b>



**Nota:**

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

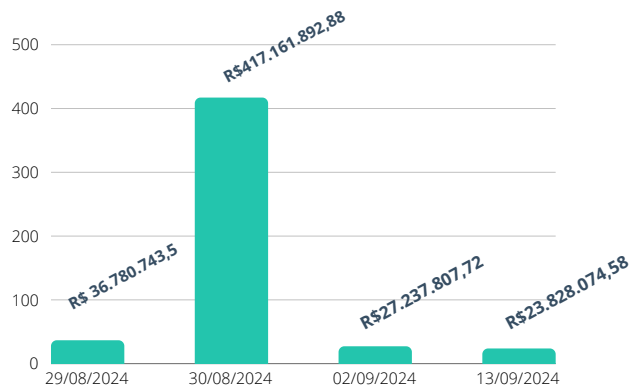
### 3. VALORES MOBILIÁRIOS - DE 29/08/2024 A 13/09/2024

**29/08/2024** - Posição anterior a arrecadação das contribuições patronal e suplementar do mês agosto/2024.

**30/08/2024** - Posição após a arrecadação das contribuições patronal e suplementar do mês agosto/2024

**02/09/2024** - Posição após o resgate dos recursos necessários ao pagamento das folhas líquidas<sup>1</sup> de aposentadoria e de pensão

**13/09/2024** - Posição após o Resgate dos recursos necessários ao pagamento dos valores das consignações, considerando as receitas arrecadadas até esta data.

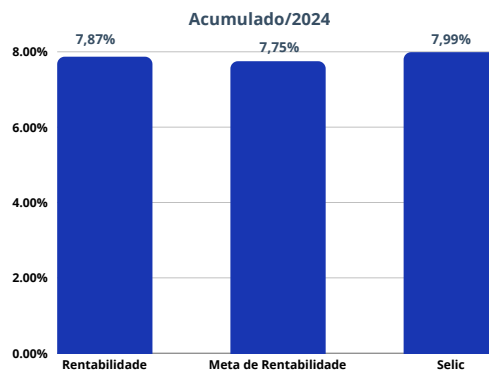
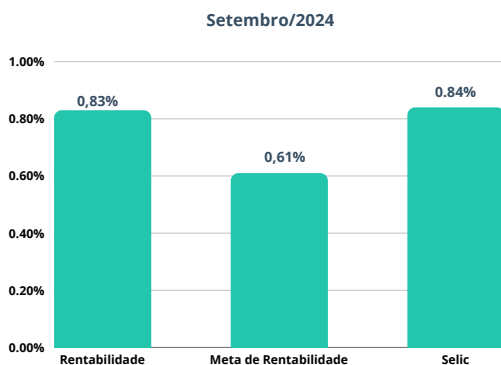


### 4. DESEMPENHO DOS FUNDOS

Setembro/2024			
Ativo	Rentabilidade Nominal	% Meta	% Selic
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	0,8552%	139,39%	102,41%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF Simples	0,7494%	122,15%	89,73%
FI Caixa Brasil TP RF LP	0,8329%	135,75%	99,73%
FI Caixa Aliança TP RF	0,8142%	132,70%	97,49%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	0,8067%	131,48%	96,59%

Acumulado/2024			
Ativo	Rentabilidade Nominal	% Meta	% Selic
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	8,2449%	106,42%	103,24%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF Simples	7,1694%	92,54%	89,77%
FI Caixa Brasil TP RF LP	7,7661%	100,24%	97,24%
FI Caixa Aliança TP RF	7,8008%	100,69%	97,68%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	7,1014%	91,66%	88,92%

### 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 setembro, rentabilidades em relação à meta de rentabilidade<sup>1</sup> de 122,15% (FIC de FI Caixa Brasil Disponibilidades RF Simples), 139,39% (Caixa Brasil Referenciado DI LP), 135,75% (FI Caixa Brasil TP RF LP), 132,70% (FI Caixa Aliança TP RF) e 131,48% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal. Desta forma, a carteira registrou um desempenho no mês de 135,27% em relação à meta e de 99,38% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 101,60% e de 98,56% em relação à meta e à taxa Selic, respectivamente.

## 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.

### NOTAS:

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



PREVI-RIO

