



FUNPREVI

Relatório Mensal de Investimentos

Valores Mobiliários

Dezembro 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	VOLATILIDADE¹	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	0,03%	Art. 7º, III, a
FI Caixa Brasil TP RF LP	Diária	0,10%	Art. 7º, I, b
FI Caixa Aliança TP RF	Diária	0,03%	Art. 7º, I, b
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	Diária	0,44%	Art. 7º, I, b

GRAU DE RISCO



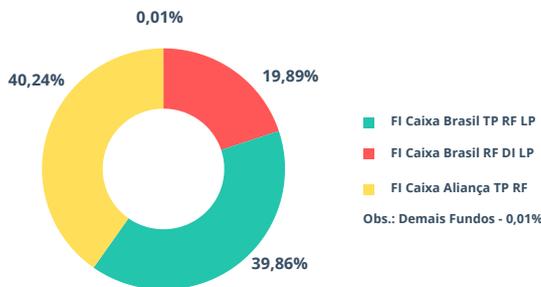
LIMITE PARA A APLICAÇÃO DE RECURSOS

SEGMENTO (RES. CMN 4.963/21)	LIMITE DE APLICAÇÃO	
	RES. CMN 4.963/21	P.A.I.²(ESTRATÉGIA)
Art. 7º, I, b	100 %	80%
Art. 7º, III, a	60 %	20%

2. CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - POSIÇÃO: 31/12/2024

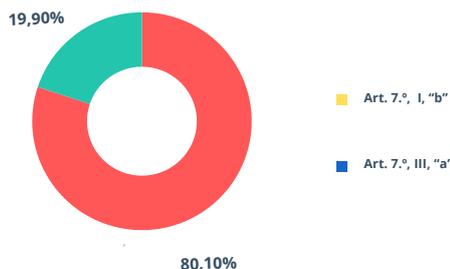
APLICAÇÕES POR FUNDO DE INVESTIMENTO

FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	R\$86.490.982,46
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 9.119,72
FI Caixa Brasil TP RF LP	R\$173.300.938,52
FI Caixa Aliança TP RF	R\$174.942.348,86
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 35.547,29
Total	R\$ 434.778.936,85



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

Art. 7º, inciso I, alínea "b"	R\$348.278.834,67
Art. 7º, inciso III, alínea "a"	R\$86.500.102,18
Total	R\$434.778.936,85



Nota:

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

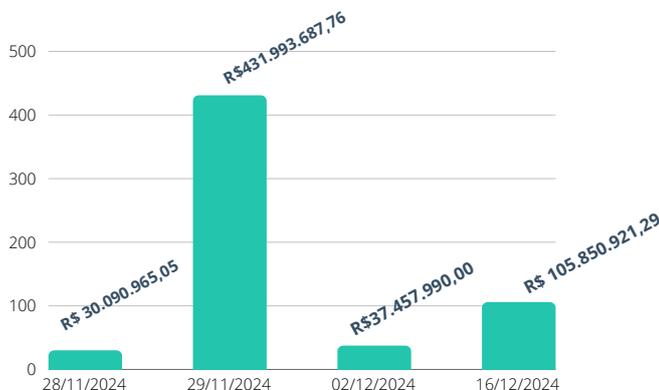
3. VALORES MOBILIÁRIOS - DE 28/11/2024 A 16/12/2024

28/11/2024 - Posição anterior a arrecadação das contribuições patronal e suplementar do mês novembro/2024.

29/11/2024 - Posição após a arrecadação das contribuições patronal e suplementar do mês novembro/2024

02/12/2024 - Posição após o resgate dos recursos necessários ao pagamento das folhas líquidas¹ de aposentadoria e de pensão

16/12/2024 - Posição após o Resgate dos recursos necessários ao pagamento dos valores das consignações, considerando as receitas arrecadadas até esta data.

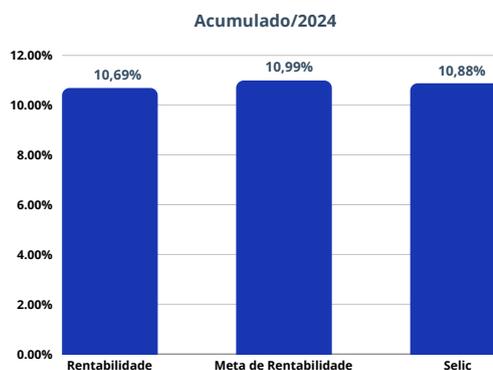


4. DESEMPENHO DOS FUNDOS

Dezembro/2024			
Ativo	Rentabilidade Nominal	% Meta	% Selic
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	0,8287%	100,27%	88,97%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF Simples	0,8418%	101,85%	90,37%
FI Caixa Brasil TP RF LP	0,8560%	103,57%	91,90%
FI Caixa Aliança TP RF	0,9082%	109,88%	97,50%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	0,6925%	83,79%	74,35%

Acumulado/2024			
Ativo	Rentabilidade Nominal	% Meta	% Selic
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	11,0284%	100,36%	101,40%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF Simples	9,7518%	88,74%	89,66%
FI Caixa Brasil TP RF LP	10,6117%	96,57%	97,57%
FI Caixa Aliança TP RF	10,6145%	96,59%	97,60%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	9,3323%	84,92%	85,81%

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	Ba1 (Positiva)	Not Prime	Ba1 (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 14/10/2024

Moody's Escala Nacional: último relatório 10/10/2024

S&P: último relatório 28/03/2024

7. COMENTÁRIOS

Os fundos de investimentos que compõem a carteira do FUNPREVI apresentaram, em dezembro, rentabilidades em relação à meta de rentabilidade¹ de 101,85% (FIC de FI Caixa Brasil Disponibilidades RF Simples), 100,27% (Caixa Brasil Referenciado DI LP), 103,57% (FI Caixa Brasil TP RF LP), 109,88% (FI Caixa Aliança TP RF) e 83,79% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal. Desta forma, a carteira registrou um desempenho no mês de 105,43% em relação à meta e de 93,55% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 97,30% e de 98,31% 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

