



# 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



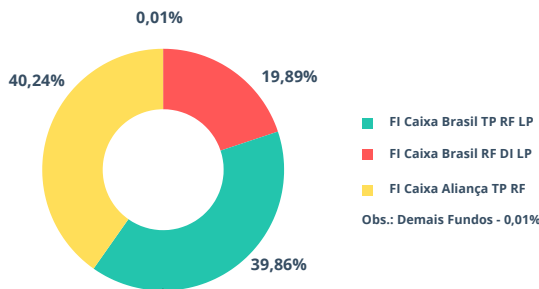
#### LIMITE PARA A APLICAÇÃO DE RECURSOS

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

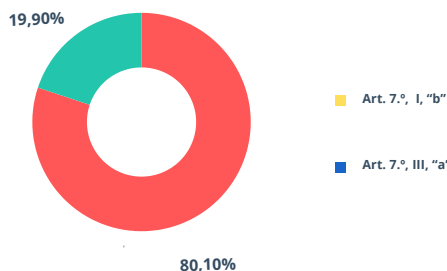
#### APLICAÇÕES POR FUNDO DE INVESTIMENTO

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
<b>Total</b>	<b>R\$ 434.778.936,85</b>



#### 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
<b>Total</b>	<b>R\$434.778.936,85</b>



**Nota:**

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

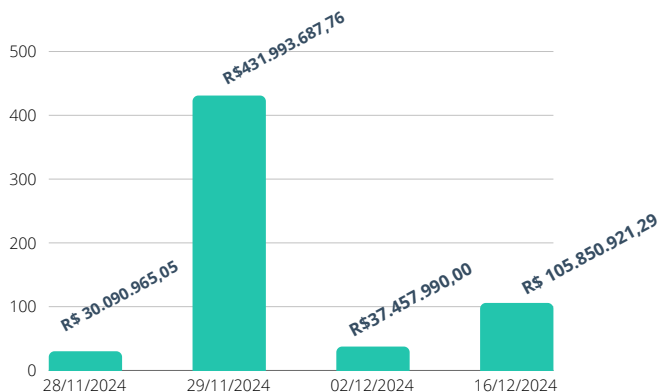
### 3. VALORES MOBILIÁRIOS - DE 28/11/2024 A 16/12/2024

**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 líquidas<sup>1</sup> 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.

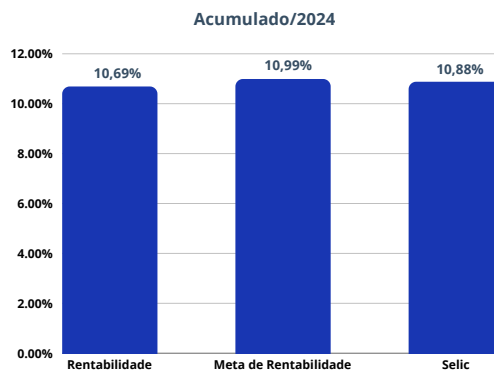
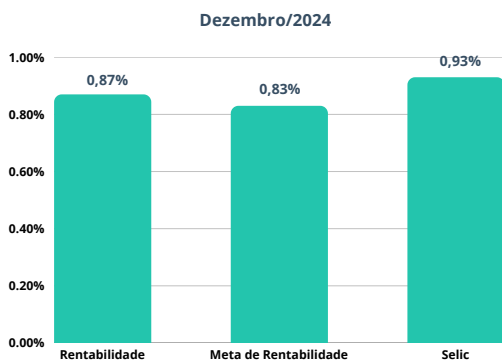


### 4. DESEMPENHO DOS FUNDOS

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 rentabilidade<sup>1</sup> 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

