

Relatório Mensal

2021

Maio

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

DIRETORIA DE
INVESTIMENTOS

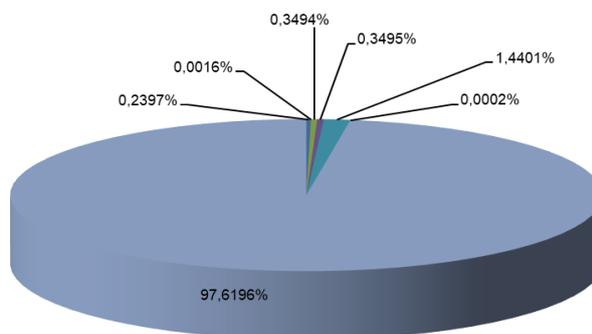
Composição da Carteira

Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)

Valor da Carteira pelo Mercado	
PREVI-RIO	R\$ 69.883.045,55
FUNPREVI	R\$ 786.588.456,45
FASS	R\$ 44.573.918,33

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\$ 1.885.345,38
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 12.327,87
FI Caixa Brasil TP RF LP	R\$ 2.748.185,06
FI Caixa Aliança TP RF	R\$ 2.748.909,14
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 11.327.773,00
Ações	R\$ 1.416,00
Subtotal Valores Mobiliários Funprevi	R\$ 18.723.956,45
Imóveis	R\$ 767.864.500,00
Total Carteira Funprevi	R\$ 786.588.456,45

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

Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos	
(Saldo Maio 2021)	R\$ 304.206.973,08

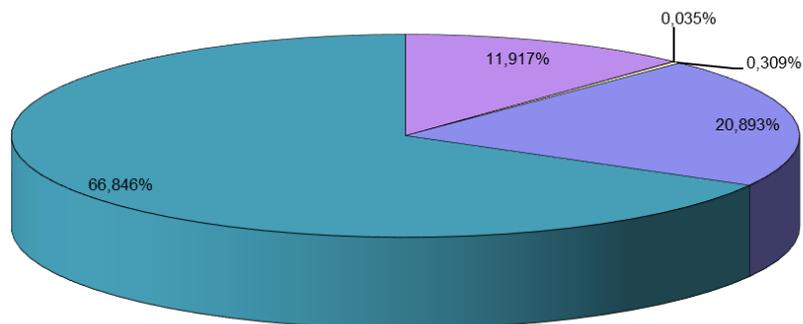
Aluguéis Recebidos	
Maio 2021	R\$ 4.203.207,72

(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

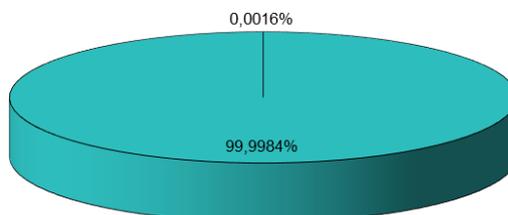
PREVI-RIO



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\$ 8.327.833,17
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 24.352,79
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	R\$ 216.139,73
FI Caixa PCRJ RF	R\$ 14.600.427,89
Subtotal Valores Mobiliários Previ-Rio	R\$ 23.168.753,58
Imóveis	R\$ 46.714.291,97
Total Carteira Previ-Rio	R\$ 69.883.045,55

FASS



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

Valor da Carteira	
FI CAIXA PCRJ RF	R\$ 44.573.213,77
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 704,56
Total Carteira FASS	R\$ 44.573.918,33

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

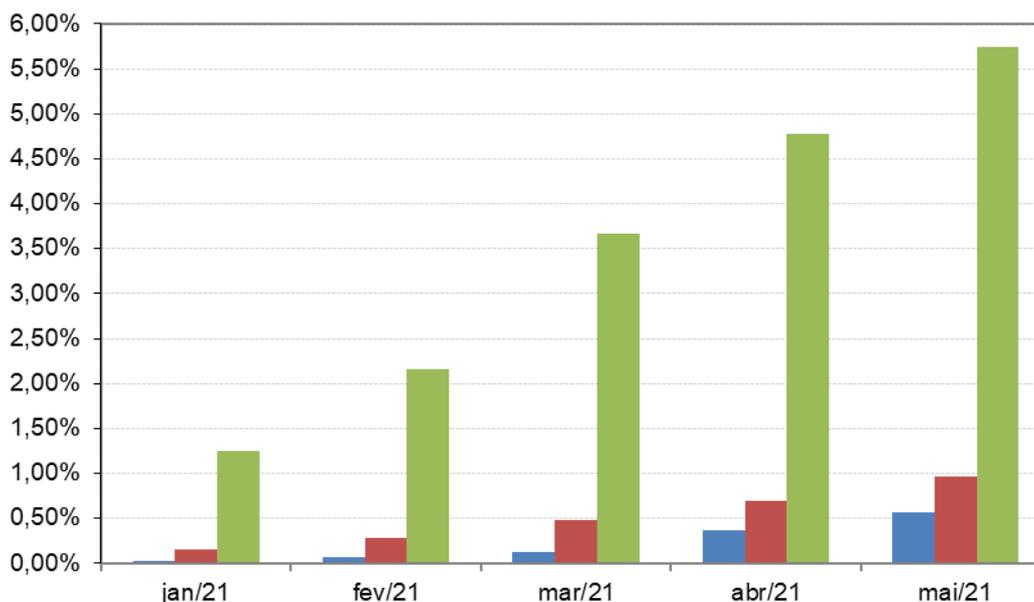
FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	mai/21	Acum. Ano	mai/21	Acum. 2021	mai/21	Acum. 2021
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,24%	0,85%	26,16%	14,77%	90,08%	87,75%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,20%	0,62%	21,20%	10,76%	72,99%	63,93%
FI Caixa Brasil TP RF LP	0,29%	0,34%	30,80%	25,76%	106,05%	98,11%
FI Caixa Aliança TP RF	0,28%	0,33%	29,84%	25,33%	102,74%	96,46%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,17%	0,51%	18,29%	8,80%	62,97%	52,32%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Funprevi	0,19%	0,56%	20,27%	9,74%	69,80%	57,89%
Meta Rentabilidade	0,93%	5,75%				
Selic	0,27%	0,97%				

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 Total Funprevi ■ Selic ■ Meta Rentabilidade (IPCA-E + 6% ao ano)

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

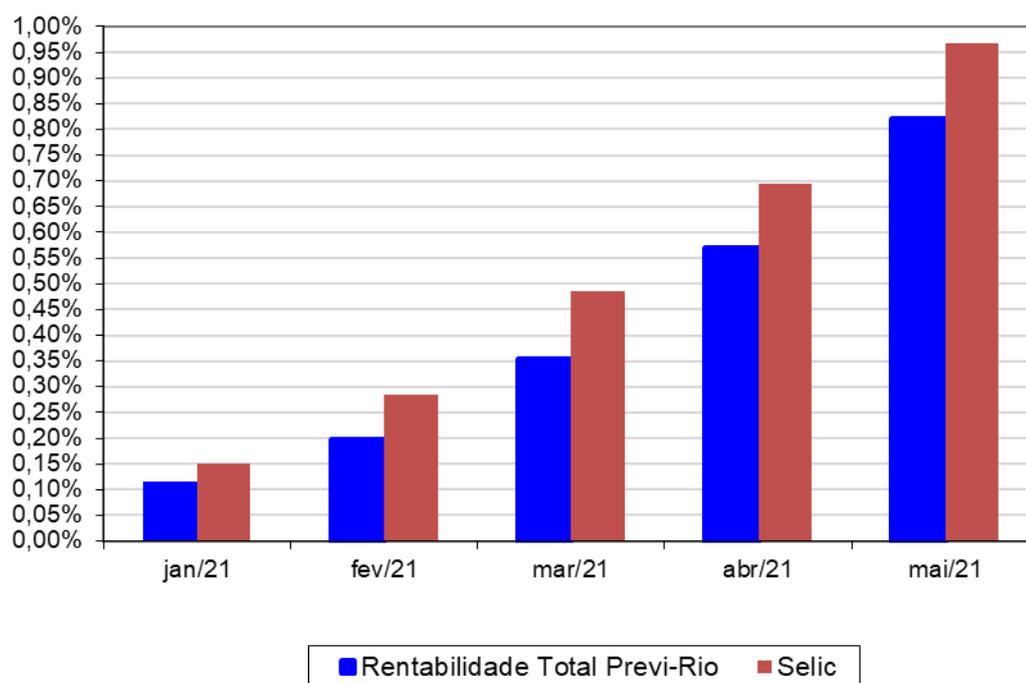
PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	mai/21	Acum. Ano	mai/21	Acum. 2021
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,24%	0,85%	90,08%	87,75%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,20%	0,62%	72,99%	63,93%
FI Caixa PCRJ RF	0,26%	0,92%	95,56%	94,82%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,17%	0,51%	62,97%	52,32%
Rentabilidade Total Previ-Rio	0,25%	0,82%	92,20%	84,92%
Selic	0,27%	0,97%		

OBSERVAÇÃO:

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

Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

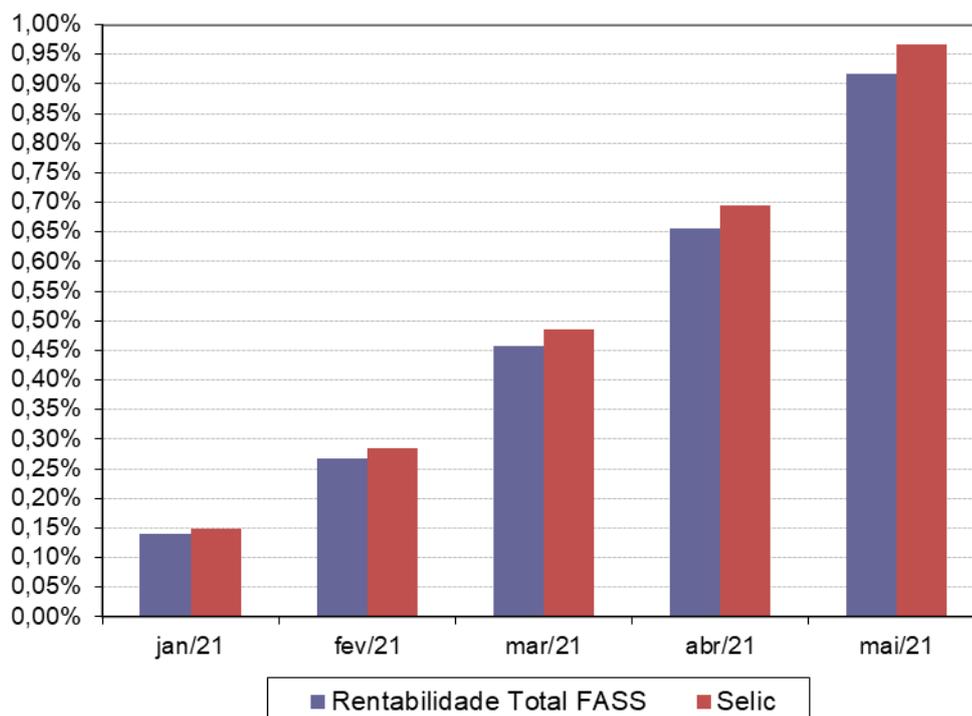
FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	mai/21	Acum. Ano	mai/21	Acum. 2021
FI Caixa PCRJ RF	0,26%	0,92%	95,56%	94,82%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,20%	0,62%	72,99%	63,93%
Rentabilidade Total FASS	0,26%	0,92%	95,56%	94,80%
Selic	0,27%	0,97%		

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 maio, rentabilidades em relação à meta de rentabilidade ⁽¹⁾ de 21,20% (FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF), 26,16% (Caixa Brasil Referenciado DI LP), 30,80% (FI Caixa Brasil TP RF LP), 29,84% (FI Caixa Aliança TP RF) e 18,29% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal. Desta forma, a carteira registrou um desempenho no mês de 20,27% em relação à meta e de 69,80% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 9,74% e de 57,89% 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)