

Relatório Mensal

2021

Julho

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

DIRETORIA DE
INVESTIMENTOS

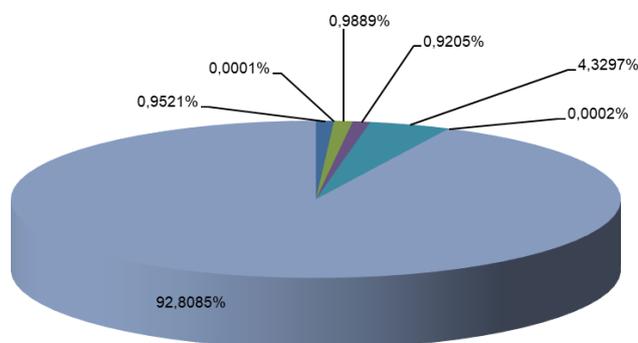
Composição da Carteira

Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)

Valor da Carteira pelo Mercado	
PREVI-RIO	R\$ 63.032.348,89
FUNPREVI	R\$ 825.145.926,97
FASS	R\$ 45.231.745,49

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\$ 7.856.479,80
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 1.072,87
FI Caixa Brasil TP RF LP	R\$ 8.159.737,93
FI Caixa Aliança TP RF	R\$ 7.595.706,51
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 35.726.013,86
Ações	R\$ 1.416,00
Subtotal Valores Mobiliários Funprevi	R\$ 59.340.426,97
Imóveis	R\$ 765.805.500,00
Total Carteira Funprevi	R\$ 825.145.926,97

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

Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos	
(Saldo Julho 2021)	R\$ 297.651.416,21

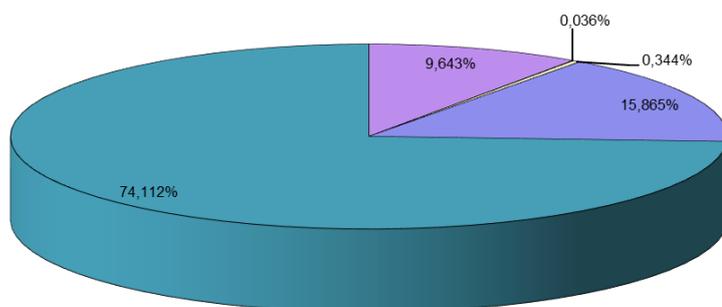
Aluguéis Recebidos	
Julho 2021	R\$ 4.203.207,72

(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

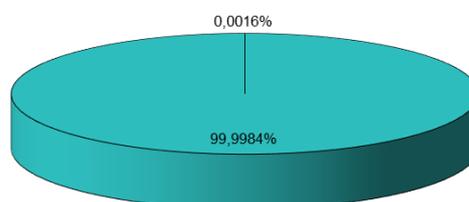
PREVI-RIO



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\$ 6.077.953,21
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 22.860,95
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	R\$ 216.907,91
FI Caixa PCRJ RF	R\$ 10.000.334,85
Subtotal Valores Mobiliários Previ-Rio	R\$ 16.318.056,92
Imóveis	R\$ 46.714.291,97
Total Carteira Previ-Rio	R\$ 63.032.348,89

FASS



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

Valor da Carteira	
FI CAIXA PCRJ RF	R\$ 45.231.029,30
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 716,19
Total Carteira FASS	R\$ 45.231.745,49

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

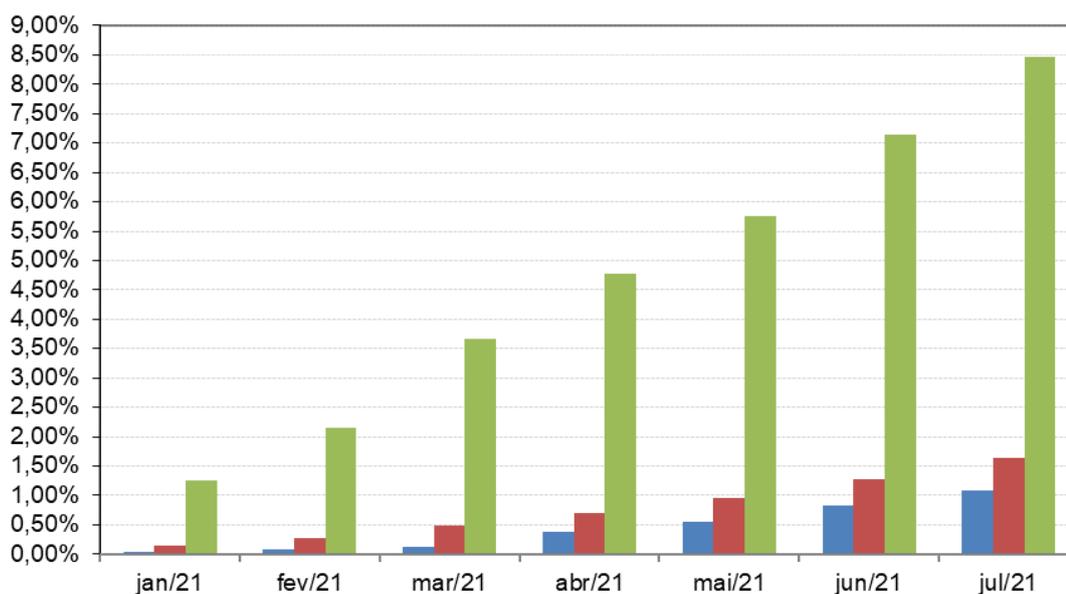
FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	jul/21	Acum. Ano	jul/21	Acum. 2021	jul/21	Acum. 2021
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,4517%	1,6138%	36,56%	19,06%	127,03%	98,54%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,2561%	1,1129%	20,72%	13,14%	72,02%	67,95%
FI Caixa Brasil TP RF LP	0,3796%	1,0302%	30,72%	26,31%	106,75%	102,00%
FI Caixa Aliança TP RF	0,3591%	0,9897%	29,06%	25,28%	100,98%	97,99%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,1665%	0,8631%	13,47%	10,19%	46,81%	52,70%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Funprevi	0,2532%	1,0783%	20,49%	12,73%	71,20%	65,84%
Meta Rentabilidade	1,2357%	8,4684%				
Selic	0,3556%	1,6378%				

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

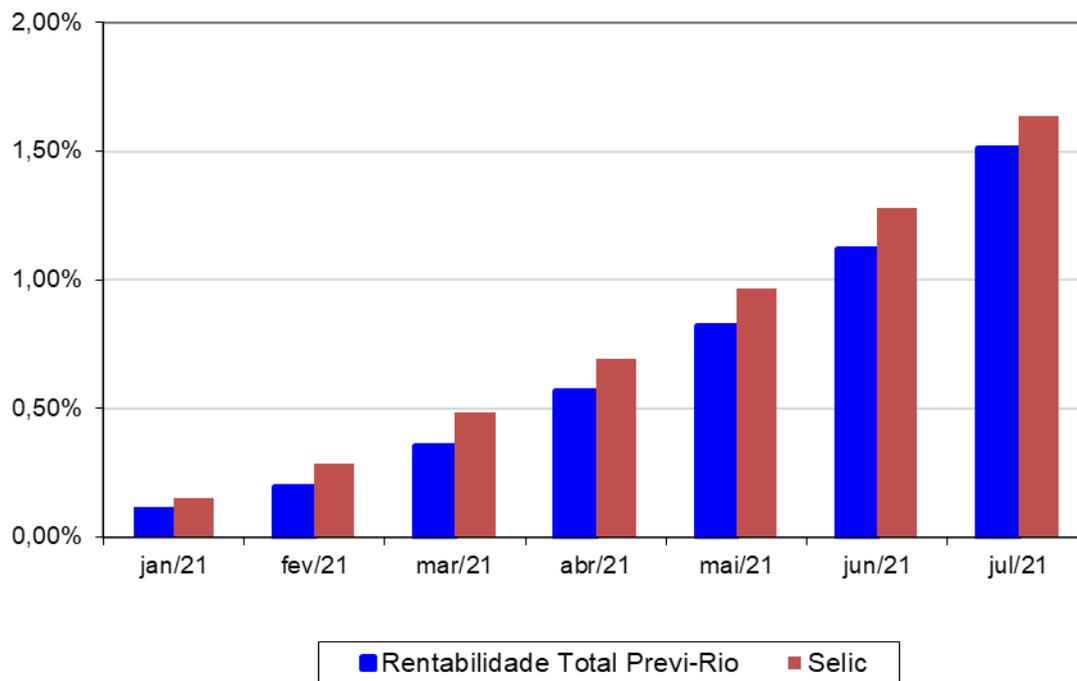
PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	jul/21	Acum. Ano	jul/21	Acum. 2021
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,4517%	1,6138%	127,03%	98,54%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,2561%	1,1129%	72,02%	67,95%
FI Caixa PCRJ RF	0,3451%	1,5648%	97,04%	95,54%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,1665%	0,8631%	46,81%	52,70%
Rentabilidade Total Previ-Rio	0,3862%	1,5123%	108,59%	92,34%
Selic	0,3556%	1,6378%		

OBSERVAÇÃO:

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

Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

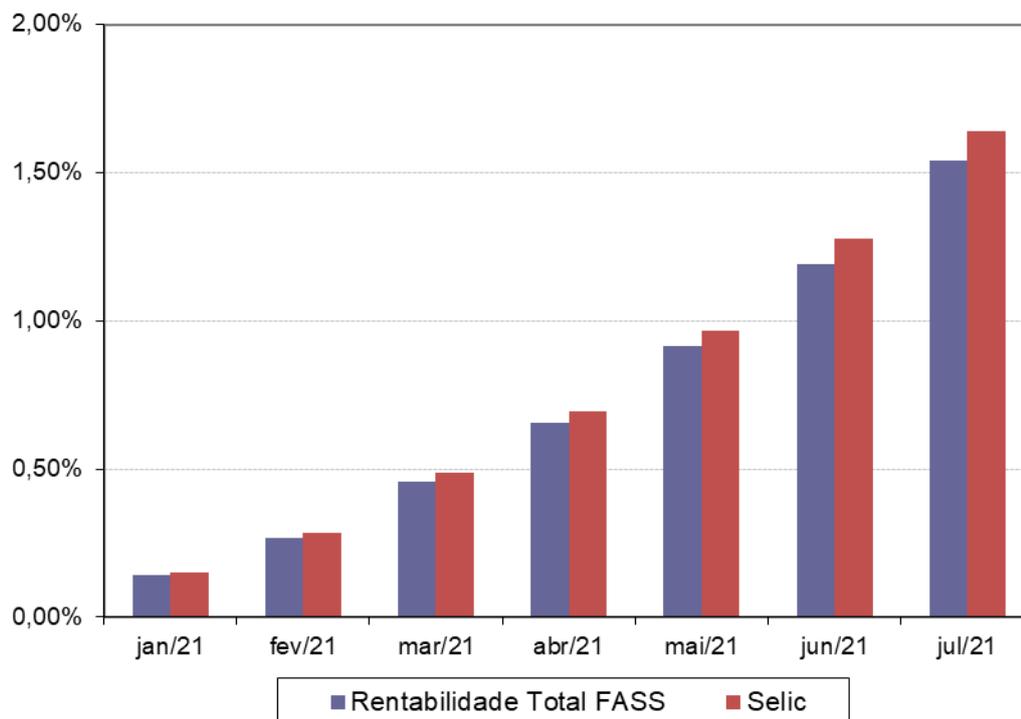
FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	jul/21	Acum. Ano	jul/21	Acum. 2021
FI Caixa PCRJ RF	0,3451%	1,5648%	97,04%	95,54%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,2561%	1,1129%	72,02%	67,95%
Rentabilidade Total FASS	0,3451%	1,5399%	97,04%	94,02%
Selic	0,3556%	1,6378%		

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 julho, rentabilidades em relação à meta de rentabilidade ⁽¹⁾ de 20,72% (FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF), 36,56% (Caixa Brasil Referenciado DI LP), 30,72% (FI Caixa Brasil TP RF LP), 29,06% (FI Caixa Aliança TP RF) e 13,47% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal. Desta forma, a carteira registrou um desempenho no mês de 20,49% em relação à meta e de 71,20% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 12,73% e de 65,84% 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)