

Relatório Mensal

2021

Agosto

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

DIRETORIA DE
INVESTIMENTOS

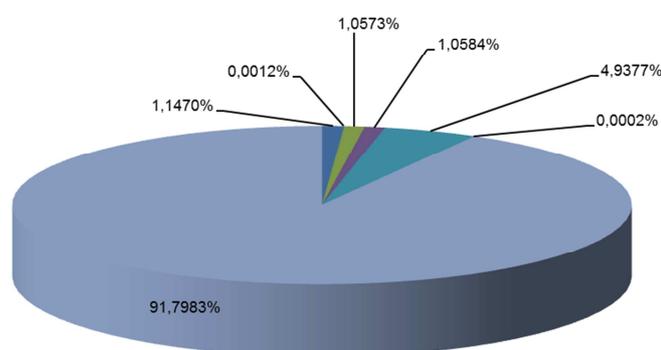
Composição da Carteira

Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)

Valor da Carteira pelo Mercado	
PREVI-RIO	R\$ 79.680.322,33
FUNPREVI	R\$ 829.013.000,85
FASS	R\$ 45.537.603,02

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\$ 9.508.579,42
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 10.254,69
FI Caixa Brasil TP RF LP	R\$ 8.764.810,00
FI Caixa Aliança TP RF	R\$ 8.773.983,03
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 40.934.457,71
Ações	R\$ 1.416,00
Subtotal Valores Mobiliários Funprevi	R\$ 67.993.500,85
Imóveis	R\$ 761.019.500,00
Total Carteira Funprevi	R\$ 829.013.000,85

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

Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos	
(Saldo Agosto 2021)	R\$ 297.515.044,27

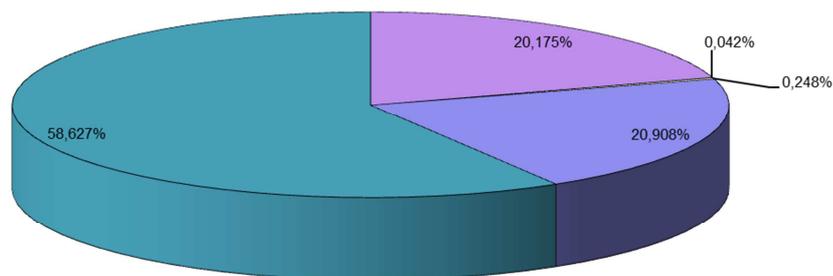
Aluguéis Recebidos	
Agosto 2021	R\$ 4.203.207,72

(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

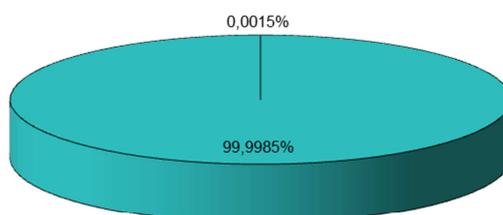
PREVI-RIO



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\$ 16.075.171,46
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 33.355,38
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	R\$ 197.649,92
FI Caixa PCRJ RF	R\$ 16.659.853,60
Subtotal Valores Mobiliários Previ-Rio	R\$ 32.966.030,36
Imóveis	R\$ 46.714.291,97
Total Carteira Previ-Rio	R\$ 79.680.322,33

FASS



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

Valor da Carteira	
FI CAIXA PCRJ RF	R\$ 45.536.900,59
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 702,43
Total Carteira FASS	R\$ 45.537.603,02

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

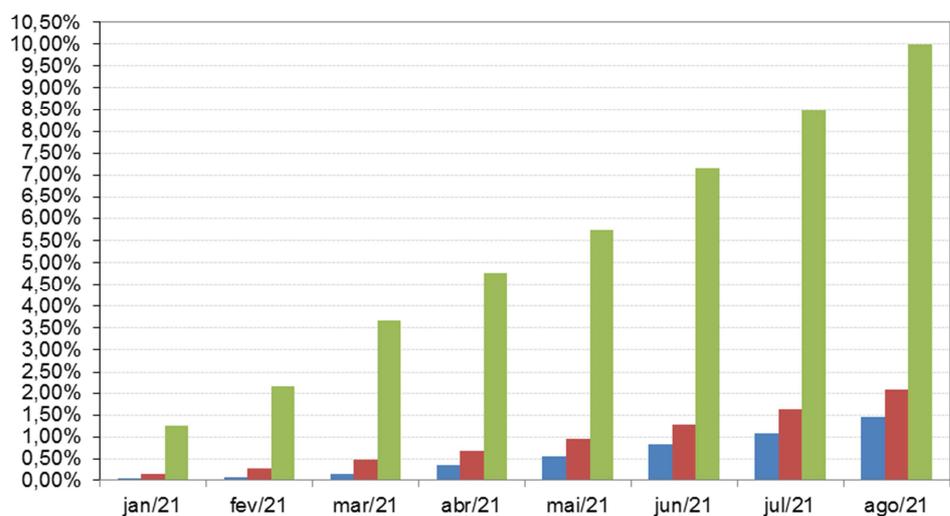
FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	ago/21	Acum. Ano	ago/21	Acum. 2021	ago/21	Acum. 2021
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,4908%	2,1126%	34,90%	21,14%	114,70%	101,92%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,3185%	1,4349%	22,64%	14,36%	74,42%	69,23%
FI Caixa Brasil TP RF LP	0,4025%	1,4368%	28,62%	26,72%	94,06%	99,63%
FI Caixa Aliança TP RF	0,4029%	1,3966%	28,65%	25,97%	94,16%	96,84%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,3438%	1,2098%	24,44%	12,11%	80,34%	58,37%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Funprevi	0,3803%	1,4627%	27,04%	14,64%	88,88%	70,57%
Meta Rentabilidade	1,4066%	9,9941%				
Selic	0,4279%	2,0728%				

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

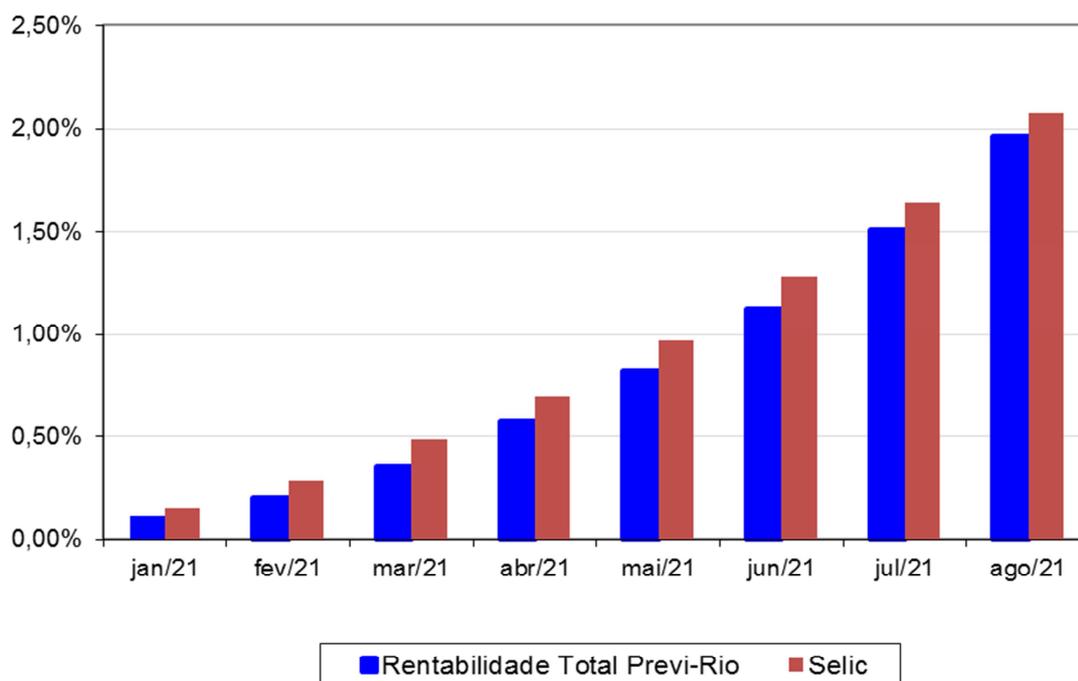
PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	ago/21	Acum. Ano	ago/21	Acum. 2021
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,4908%	2,1126%	114,70%	101,92%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,3185%	1,4349%	74,42%	69,23%
FI Caixa PCRJ RF	0,4139%	1,9851%	96,71%	95,77%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,3438%	1,2098%	80,34%	58,37%
Rentabilidade Total Previ-Rio	0,4453%	1,9644%	104,05%	94,77%
Selic	0,4279%	2,0728%		

OBSERVAÇÃO:

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

Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

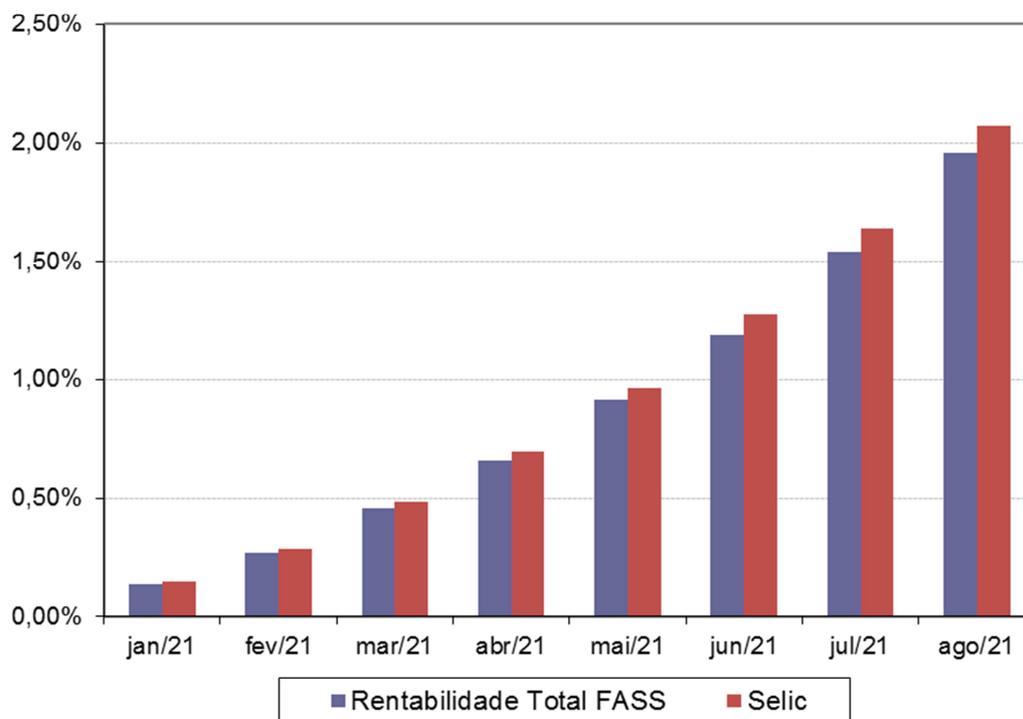
FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	ago/21	Acum. Ano	ago/21	Acum. 2021
FI Caixa PCRJ RF	0,4139%	1,9851%	96,71%	95,77%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,3185%	1,4349%	74,42%	69,23%
Rentabilidade Total FASS	0,4139%	1,9601%	96,71%	94,56%
Selic	0,4279%	2,0728%		

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 agosto, rentabilidades em relação à meta de rentabilidade ⁽¹⁾ de 22,64% (FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF), 34,90% (Caixa Brasil Referenciado DI LP), 28,62% (FI Caixa Brasil TP RF LP), 28,65% (FI Caixa Aliança TP RF) e 24,44% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal. Desta forma, a carteira registrou um desempenho no mês de 27,04% em relação à meta e de 88,88% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 14,64% e de 70,57% 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)