

# Relatório Mensal

2021

# Dezembro

---

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

DIRETORIA DE  
INVESTIMENTOS

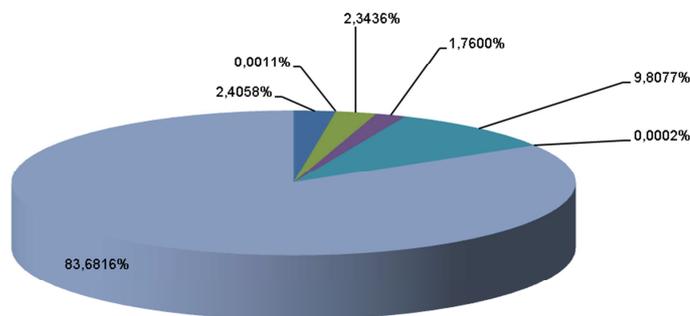
# Composição da Carteira

## Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

### TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)

Valor da Carteira pelo Mercado	
PREVI-RIO	R\$ 64.316.502,01
FUNPREVI	R\$ 914.980.927,38
FASS	R\$ 44.735.034,46

### 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\$ 22.012.792,56
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 10.274,24
FI Caixa Brasil TP RF LP	R\$ 21.443.181,34
FI Caixa Aliança TP RF	R\$ 16.104.014,50
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 89.738.725,37
Ações	R\$ 1.416,00
Subtotal Valores Mobiliários Funprevi	R\$ 149.310.404,01
Imóveis	R\$ 765.670.523,37
Total Carteira Funprevi	R\$ 914.980.927,38

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

Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos	
(Saldo Dezembro 2021)	R\$ 292.159.162,41

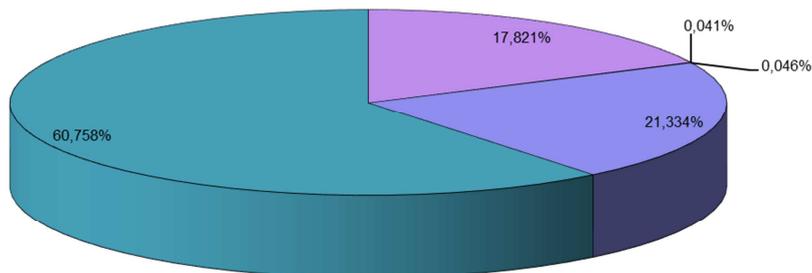
Aluguéis Recebidos	
Dezembro 2021	R\$ 4.203.207,72

(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

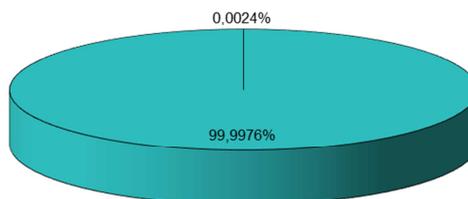
### PREVI-RIO



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\$ 11.462.159,20
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 26.427,59
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	R\$ 29.465,99
FI Caixa PCRJ RF	R\$ 13.721.180,63
Subtotal Valores Mobiliários Previ-Rio	R\$ 25.239.233,41
Imóveis	R\$ 39.077.268,60
<b>Total Carteira Previ-Rio</b>	<b>R\$ 64.316.502,01</b>

### FASS



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

Valor da Carteira	
FI CAIXA PCRJ RF	R\$ 44.733.960,88
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 1.073,58
<b>Total Carteira FASS</b>	<b>R\$ 44.735.034,46</b>

# Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

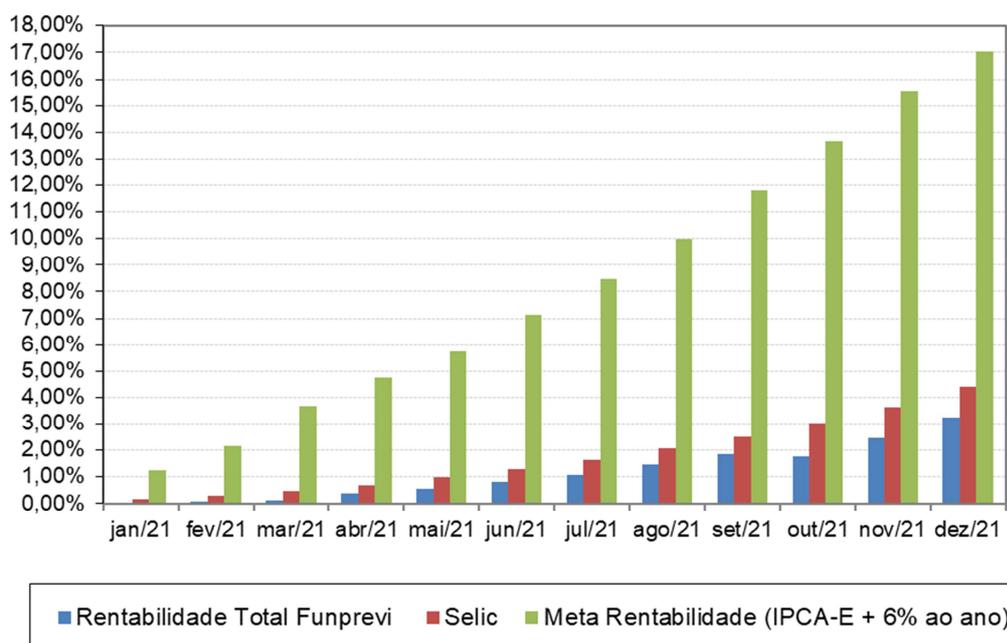
## FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	dez/21	Acum. Ano	dez/21	Acum. 2021	dez/21	Acum. 2021
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,7545%	4,5950%	57,18%	26,95%	98,10%	103,88%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,6293%	3,2889%	47,69%	19,29%	81,82%	74,35%
FI Caixa Brasil TP RF LP	0,7770%	3,8129%	58,88%	31,42%	101,03%	100,91%
FI Caixa Aliança TP RF	0,7416%	3,6406%	56,20%	30,00%	96,43%	96,35%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,8486%	2,7008%	64,31%	15,84%	110,33%	61,05%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
<b>Rentabilidade Total Funprevi</b>	<b>0,7947%</b>	<b>3,2544%</b>	<b>60,23%</b>	<b>19,09%</b>	<b>103,33%</b>	<b>73,57%</b>
Meta Rentabilidade	1,3195%	17,0491%				
Selic	0,7691%	4,4236%				

### 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 da Carteira de Ativos Mobiliários

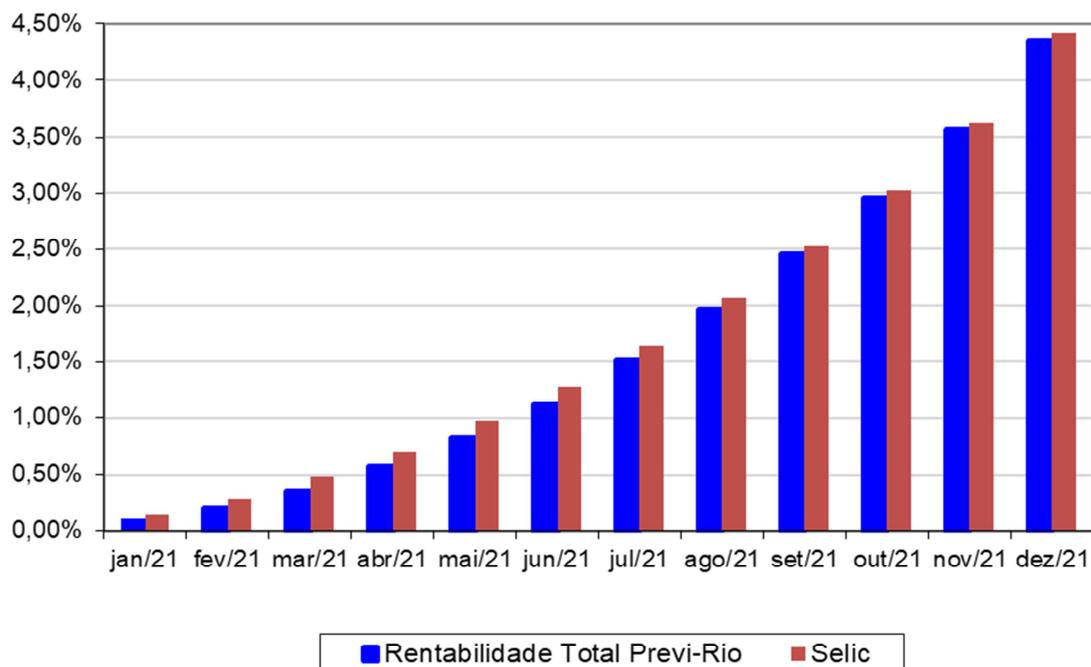
## PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	dez/21	Acum. Ano	dez/21	Acum. 2021
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,7545%	4,5950%	98,10%	103,88%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,6293%	3,2889%	81,82%	74,35%
FI Caixa PCRJ RF	0,7573%	4,2919%	98,46%	97,02%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,8486%	2,7008%	110,33%	61,05%
Rentabilidade Total Previ-Rio	0,7557%	4,3511%	98,25%	98,36%
Selic	0,7691%	4,4236%		

OBSERVAÇÃO:

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

### Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



# Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

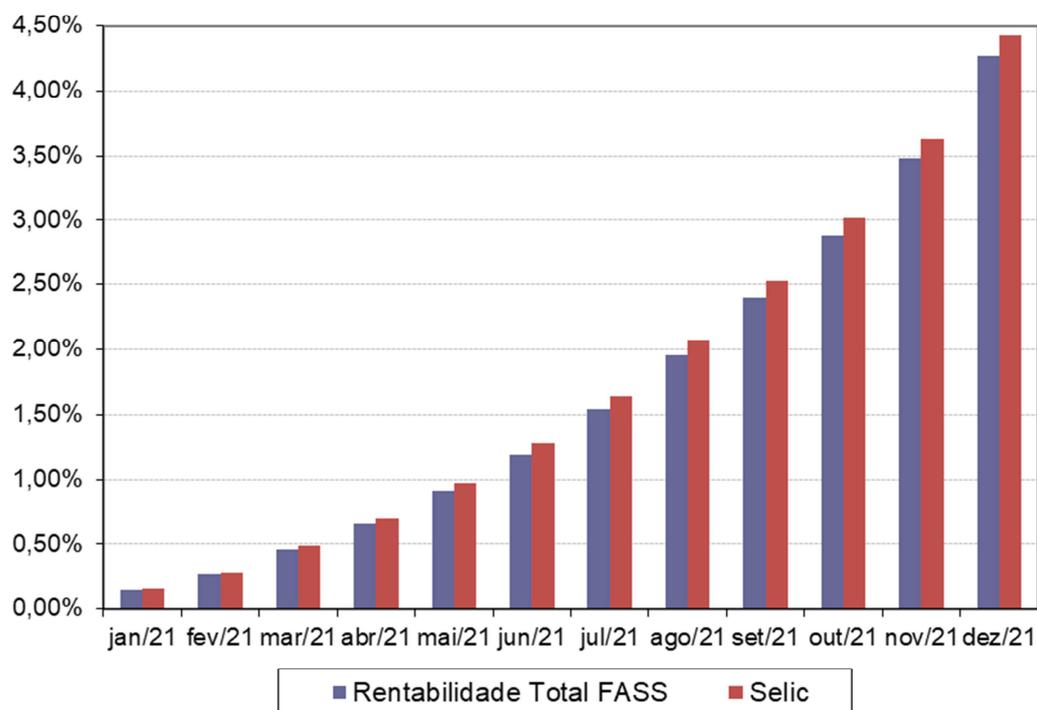
## FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	dez/21	Acum. Ano	dez/21	Acum. 2021
FI Caixa PCRJ RF	0,7573%	4,2919%	98,46%	97,02%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,6293%	3,2889%	81,82%	74,35%
Rentabilidade Total FASS	0,7573%	4,2663%	98,46%	96,44%
Selic	0,7691%	4,4236%		

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 dezembro, rentabilidades em relação à meta de rentabilidade <sup>(1)</sup> de 47,69% (FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF), 57,18% (Caixa Brasil Referenciado DI LP), 58,88% (FI Caixa Brasil TP RF LP), 56,20% (FI Caixa Aliança TP RF) e 64,31% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal. Desta forma, a carteira registrou um desempenho no mês de 60,23% em relação à meta e de 103,33% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 19,09% e de 73,57% 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)