

Relatório Mensal

2021

Março

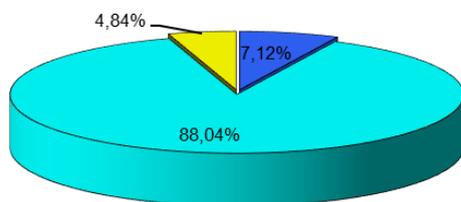
Instituto de Previdência e Assistência do Município do
Rio de Janeiro - PREVI-RIO

DIRETORIA DE
INVESTIMENTOS

Composição da Carteira

Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

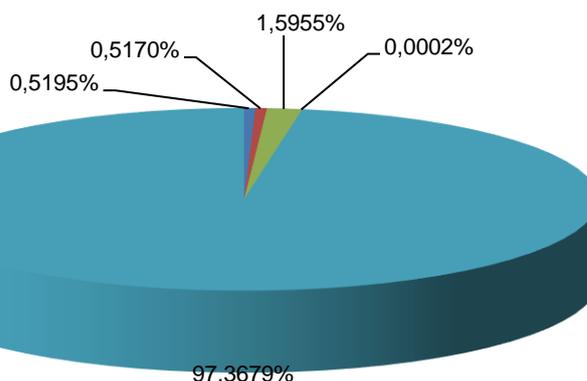
TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)



Valor da Carteira pelo Mercado	
PREVI-RIO	R\$ 63.804.730,46
FUNPREVI	R\$ 788.621.772,25
FASS	R\$ 43.309.773,82



FUNPREVI



Valor por Tipo de Ativo pelo Mercado	
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	R\$ 4.096.529,47
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 4.077.180,65
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 12.582.146,13
Ações	R\$ 1.416,00
Subtotal Valores Mobiliários Funprevi	R\$ 20.757.272,25
Imóveis	R\$ 767.864.500,00
Total Carteira Funprevi	R\$ 788.621.772,25

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

Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos	
(Saldo Março 2021)	R\$ 311.205.700,62

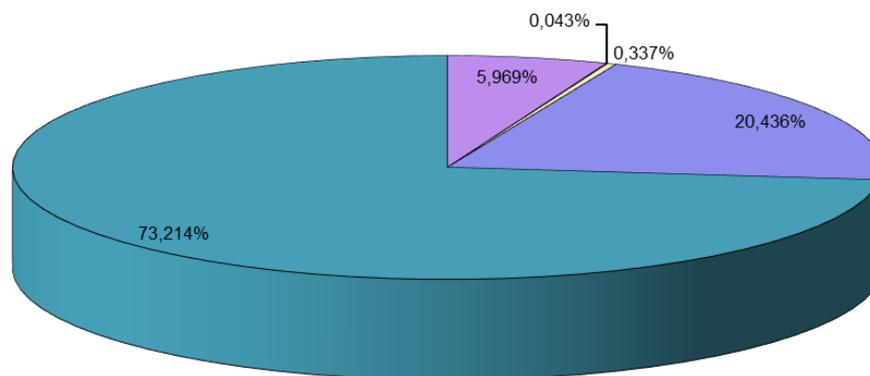
Aluguéis Recebidos	
Março 2021	R\$ 8.524.169,43

(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

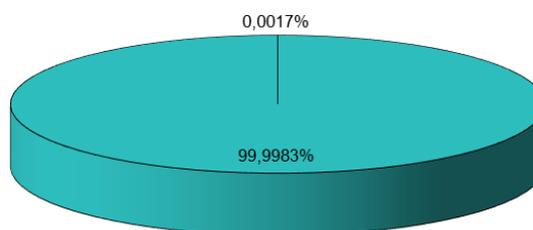
PREVI-RIO



■ 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\$ 3.808.462,36
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 27.643,58
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	R\$ 215.164,72
FI Caixa PCRJ RF	R\$ 13.039.167,83
Subtotal Valores Mobiliários Previ-Rio	R\$ 17.090.438,49
Imóveis	R\$ 46.714.291,97
Total Carteira Previ-Rio	R\$ 63.804.730,46

FASS



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

Valor da Carteira	
FI CAIXA PCRJ RF	R\$ 43.309.024,50
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 749,32
Total Carteira FASS	R\$ 43.309.773,82

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

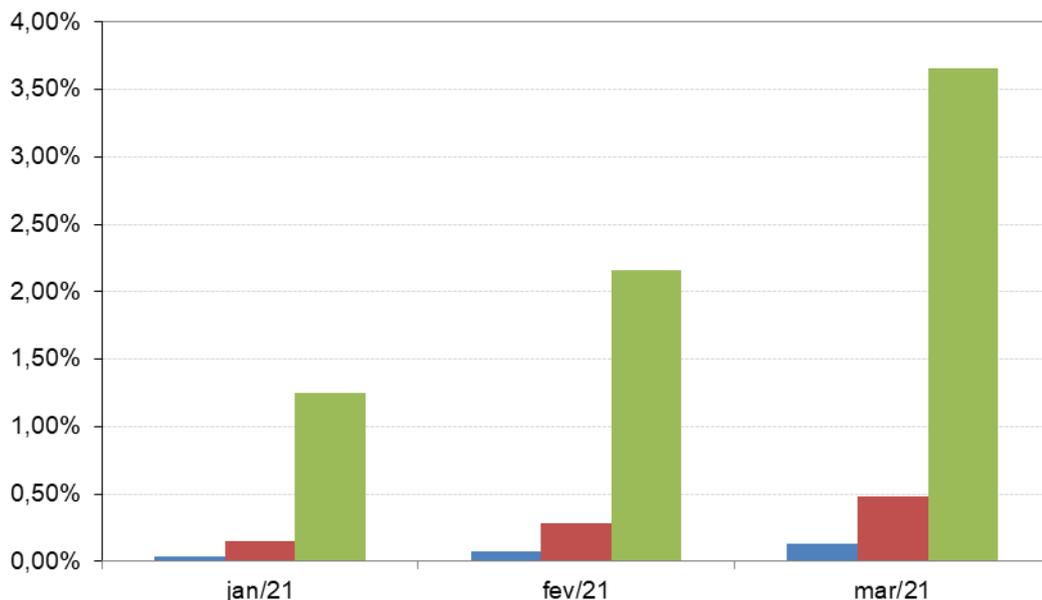
FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	mar/21	Acum. Ano	mar/21	Acum. 2021	mar/21	Acum. 2021
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,10%	0,34%	6,73%	9,25%	49,18%	69,73%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,12%	0,28%	8,31%	7,61%	60,75%	57,34%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,01%	0,05%	0,62%	1,43%	4,57%	10,80%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Funprevi	0,06%	0,13%	3,90%	3,52%	28,48%	26,54%
Meta Rentabilidade	1,47%	3,66%				
Selic	0,20%	0,49%				

OBSERVAÇÃO:

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

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

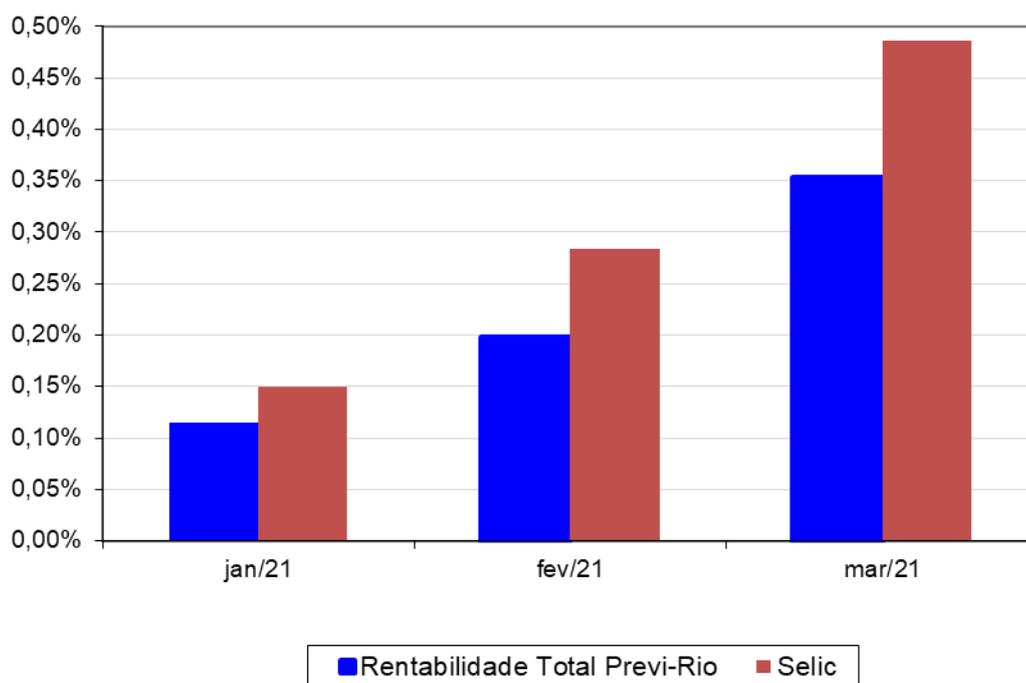
PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	mar/21	Acum. Ano	mar/21	Acum. 2021
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,10%	0,34%	49,18%	69,73%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,12%	0,28%	60,75%	57,34%
FI Caixa PCRJ RF	0,19%	0,46%	93,82%	93,97%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,01%	0,05%	4,57%	10,80%
Rentabilidade Total Previ-Rio	0,15%	0,35%	76,70%	72,64%
Selic	0,20%	0,49%		

OBSERVAÇÃO:

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

Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

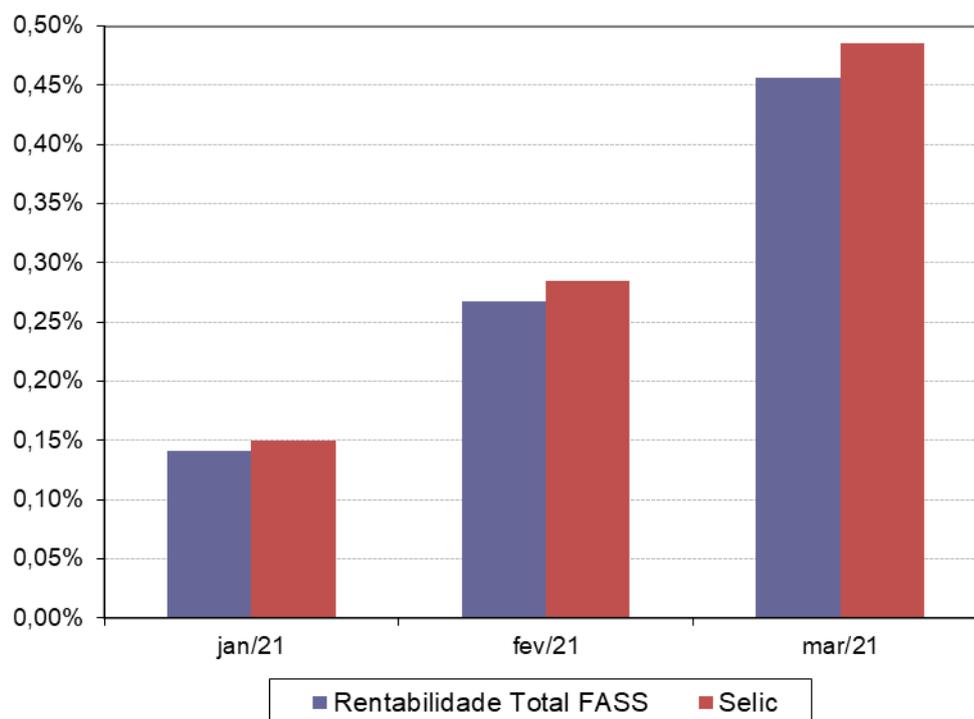
FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	mar/21	Acum. Ano	mar/21	Acum. 2021
FI Caixa PCRJ RF	0,19%	0,46%	93,82%	93,97%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,12%	0,28%	60,75%	57,34%
Rentabilidade Total FASS	0,19%	0,46%	93,82%	93,95%
Selic	0,20%	0,49%		

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 março, rentabilidades em relação à meta de rentabilidade ⁽¹⁾ de 8,31% (FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF), 6,73% (Caixa Brasil Referenciado DI LP) e 0,62% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal. Desta forma, a carteira registrou um desempenho no mês de 3,90% em relação à meta e de 28,48% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 3,52% e de 26,54% 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)