

Relatório Mensal

2022

Junho

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

DIRETORIA DE
INVESTIMENTOS

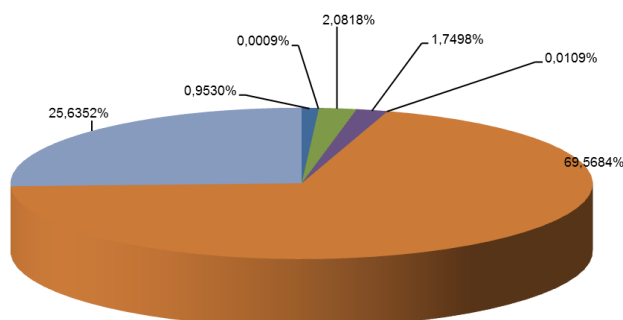
Composição da Carteira

Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)

Valor da Carteira pelo Mercado	
PREVI-RIO	R\$ 73.573.117,72
FUNPREVI	R\$ 1.100.607.803,02
FASS	R\$ 48.742.762,62

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	■ Imóveis
■ Empréstimos e Financiamentos (Saldo Devedor-jun/22)	

Valor por Tipo de Ativo pelo Mercado	
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	R\$ 10.489.035,40
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 9.410,61
FI Caixa Brasil TP RF LP	R\$ 22.912.984,62
FI Caixa Aliança TP RF	R\$ 19.258.660,15
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 119.584,29
Subtotal Valores Mobiliários Funprevi	R\$ 52.789.675,07
Imóveis ⁽¹⁾	R\$ 765.674.823,37
Empréstimos e Financiamentos (Saldo Devedor-jun/22)	R\$ 282.143.304,58
Total Carteira Funprevi	R\$ 1.100.607.803,02

Valor Presente dos Recebíveis de Royalties	
Valor Presente (31/12/2021) ⁽²⁾	R\$ 7.805.056.488,81

Aluguéis Recebidos	
Junho/2022	R\$ 4.863.020,74

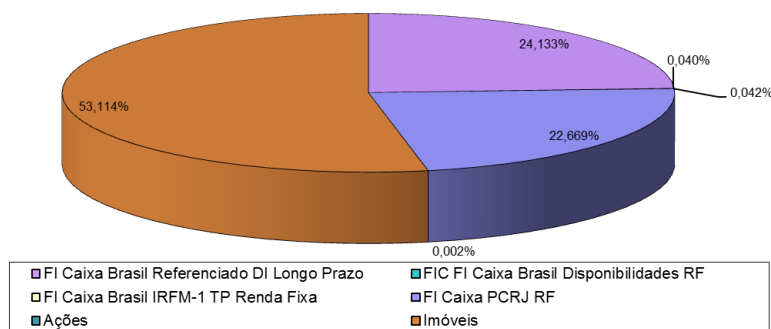
(1) Fonte: Balancete de verificação de junho/2022 emitido em 27/07/2022.

(2) 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

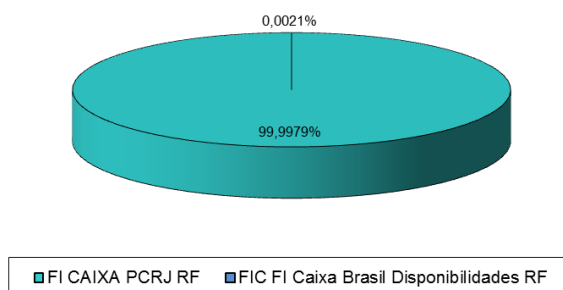
PREVI-RIO



Valor da Carteira	
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R\$ 17.755.118,79
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 29.704,20
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	R\$ 30.896,91
FI Caixa PCRJ RF	R\$ 16.678.600,52
Ações	R\$ 1.528,70
Subtotal Valores Mobiliários Previ-Rio	R\$ 34.495.849,12
Imóveis ⁽¹⁾	R\$ 39.077.268,60
Total Carteira Previ-Rio	R\$ 73.573.117,72

(1) Fonte: Balancete de verificação de junho/2022 emitido em 27/07/2022.

FASS



Valor da Carteira	
FI CAIXA PCRJ RF	R\$ 48.741.757,91
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 1.004,71
Total Carteira FASS	R\$ 48.742.762,62

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

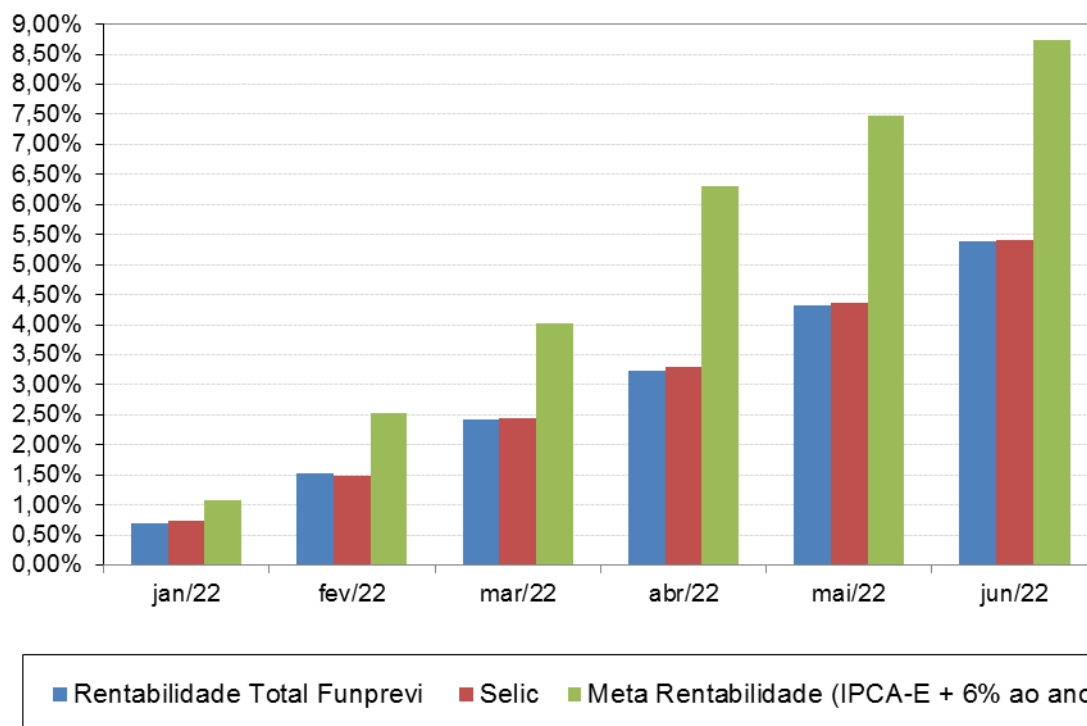
FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	jun/22	Acum. Ano	jun/22	Acum. 2022	jun/22	Acum. 2022
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	1,0606%	5,5966%	89,72%	64,04%	104,46%	103,32%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,8755%	4,5918%	74,06%	52,54%	86,23%	84,77%
FI Caixa Brasil TP RF LP	1,0234%	5,5186%	86,58%	63,14%	100,80%	101,88%
FI Caixa Aliança TP RF	0,9939%	5,2796%	84,08%	60,41%	97,89%	97,47%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,9100%	4,8562%	76,98%	55,56%	89,62%	89,65%
Rentabilidade Total Funprevi	1,0193%	5,3806%	86,23%	61,56%	100,39%	99,34%
Meta Rentabilidade	1,1821%	8,7397%				
Selic	1,0153%	5,4165%				

OBSERVAÇÃO:

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

Rentabilidade Acumulada - Funprevi x Meta Rentabilidade x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

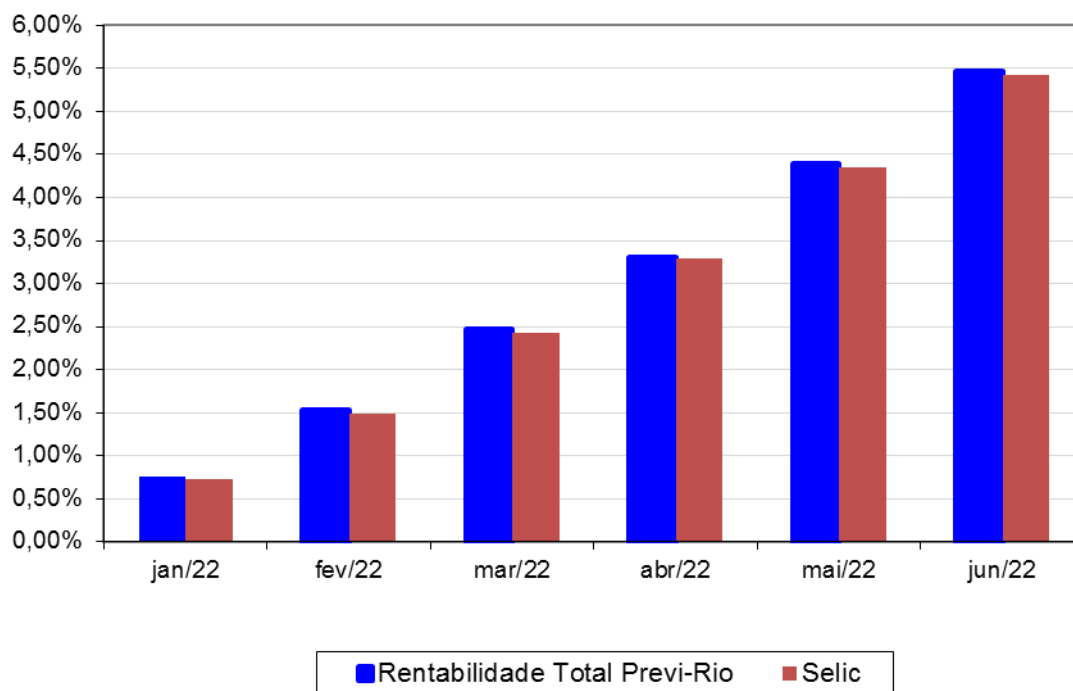
PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	jun/22	Acum. Ano	jun/22	Acum. 2022
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	1,0606%	5,5966%	104,46%	103,32%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,8755%	4,5918%	86,23%	84,77%
FI Caixa PCRJ RF	1,0088%	5,3703%	99,36%	99,15%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,9100%	4,8562%	89,62%	89,65%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Previ-Rio	1,0342%	5,4757%	101,86%	101,09%
Selic	1,0153%	5,4165%		

OBSERVAÇÃO:

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

Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

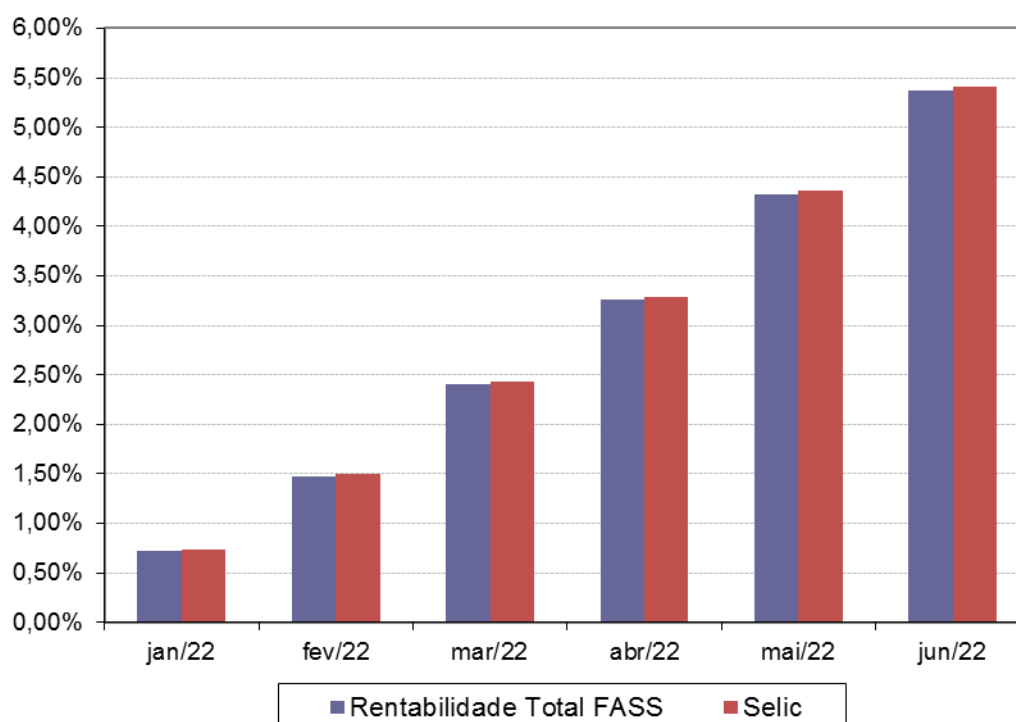
FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	jun/22	Acum. Ano	jun/22	Acum. 2022
FI Caixa PCRJ RF	1,0088%	5,3703%	99,36%	99,15%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,8755%	4,5918%	86,23%	84,77%
Rentabilidade Total FASS	1,0088%	5,3691%	99,36%	99,12%
Selic	1,0153%	5,4165%		

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 junho, rentabilidades em relação à meta de rentabilidade ⁽¹⁾ de 74,06% (FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF), 89,72% (Caixa Brasil Referenciado DI LP), 86,58% (FI Caixa Brasil TP RF LP), 84,08% (FI Caixa Aliança TP RF) e 76,98% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal. Desta forma, a carteira registrou um desempenho no mês de 86,23% em relação à meta e de 100,39% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 61,56% e de 99,34% 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)