

# Relatório Mensal

2022

# Agosto

---

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

DIRETORIA DE  
INVESTIMENTOS

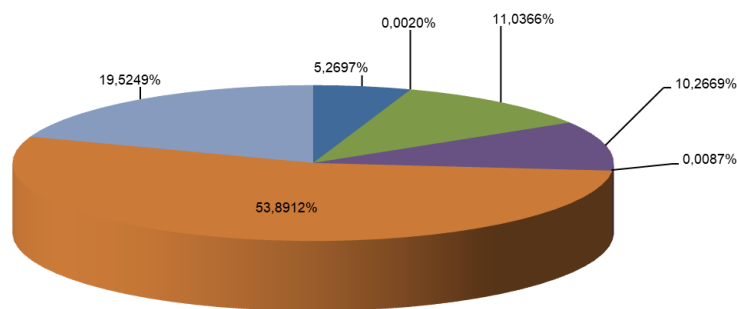
# Composição da Carteira

## Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

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

Valor da Carteira pelo Mercado	
PREVI-RIO	R\$ 79.378.681,77
FUNPREVI	R\$ 1.398.744.077,75
FASS	R\$ 51.782.872,95

### 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-ago/22)	

Valor por Tipo de Ativo pelo Mercado	
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	R\$ 73.709.649,52
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 27.975,74
FI Caixa Brasil TP RF LP	R\$ 154.374.167,29
FI Caixa Aliança TP RF	R\$ 143.607.176,49
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 122.280,74
Subtotal Valores Mobiliários Funprevi	R\$ 371.841.249,78
Imóveis	R\$ 753.799.823,37
Empréstimos e Financiamentos (Saldo Devedor-ago/22)	R\$ 273.103.004,60
Total Carteira Funprevi	R\$ 1.398.744.077,75

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

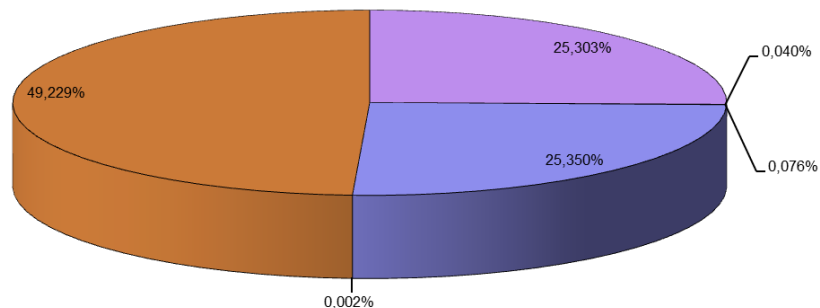
Aluguéis Recebidos	
Agosto/2022	R\$ 143.053,26

(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

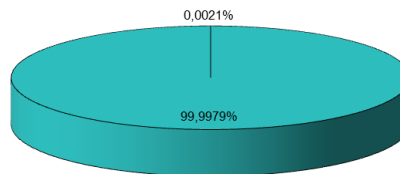
### PREVI-RIO



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
Ações	Imóveis

Valor da Carteira	
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R\$ 20.085.422,98
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 60.364,49
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	R\$ 31.593,59
FI Caixa PCRJ RF	R\$ 20.122.503,41
Ações	R\$ 1.528,70
Subtotal Valores Mobiliários Previ-Rio	R\$ 40.301.413,17
Imóveis	R\$ 39.077.268,60
<b>Total Carteira Previ-Rio</b>	<b>R\$ 79.378.681,77</b>

### FASS



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

Valor da Carteira	
FI CAIXA PCRJ RF	R\$ 51.781.797,03
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 1.075,92
<b>Total Carteira FASS</b>	<b>R\$ 51.782.872,95</b>

# Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

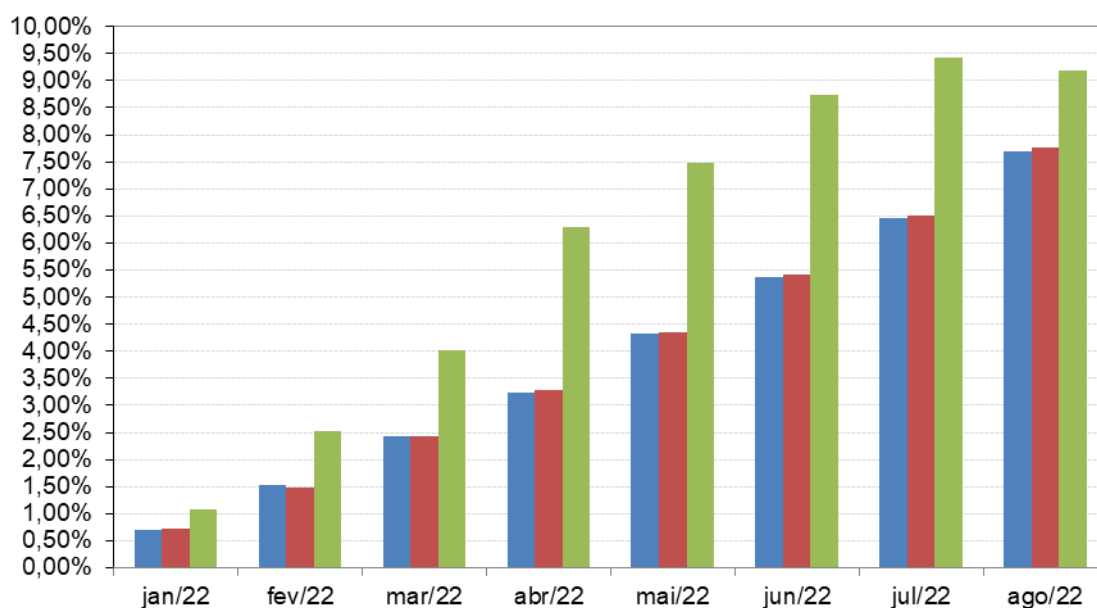
## FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	ago/22	Acum. Ano	ago/22	Acum. 2022	ago/22	Acum. 2022
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	1,1872%	7,9261%	597,97%	86,19%	101,53%	102,23%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	1,0198%	6,6135%	513,66%	71,92%	87,21%	85,30%
FI Caixa Brasil TP RF LP	1,1742%	7,8487%	591,43%	85,35%	100,42%	101,24%
FI Caixa Aliança TP RF	1,1463%	7,5680%	577,37%	82,30%	98,03%	97,61%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	1,2107%	7,2205%	609,79%	78,52%	103,53%	93,13%
Rentabilidade Total Funprevi	1,1660%	7,6935%	587,28%	83,66%	99,71%	99,23%
Meta Rentabilidade	-0,1985%	9,1960%				
Selic	1,1694%	7,7529%				

### 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

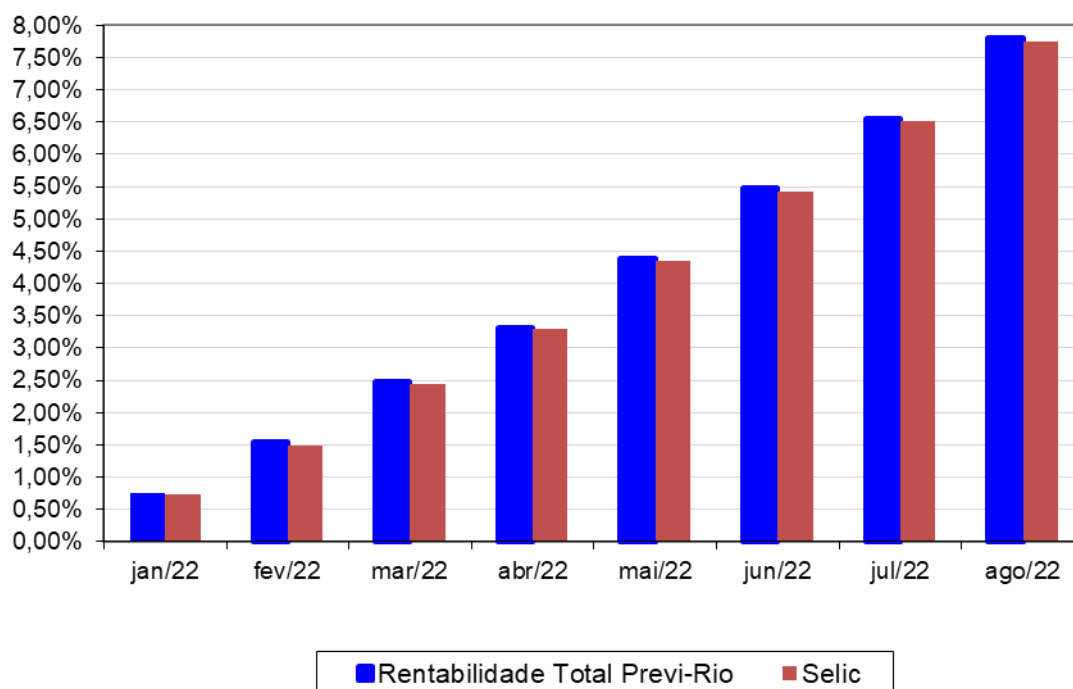
## PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	ago/22	Acum. Ano	ago/22	Acum. 2022
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	1,1872%	7,9261%	101,53%	102,23%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	1,0198%	6,6135%	87,21%	85,30%
FI Caixa PCRJ RF	1,1623%	7,6930%	99,39%	99,23%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	1,2107%	7,2205%	103,53%	93,13%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Previ-Rio	1,1746%	7,8012%	100,44%	100,62%
Selic	1,1694%	7,7529%		

### OBSERVAÇÃO:

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

### Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



# Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

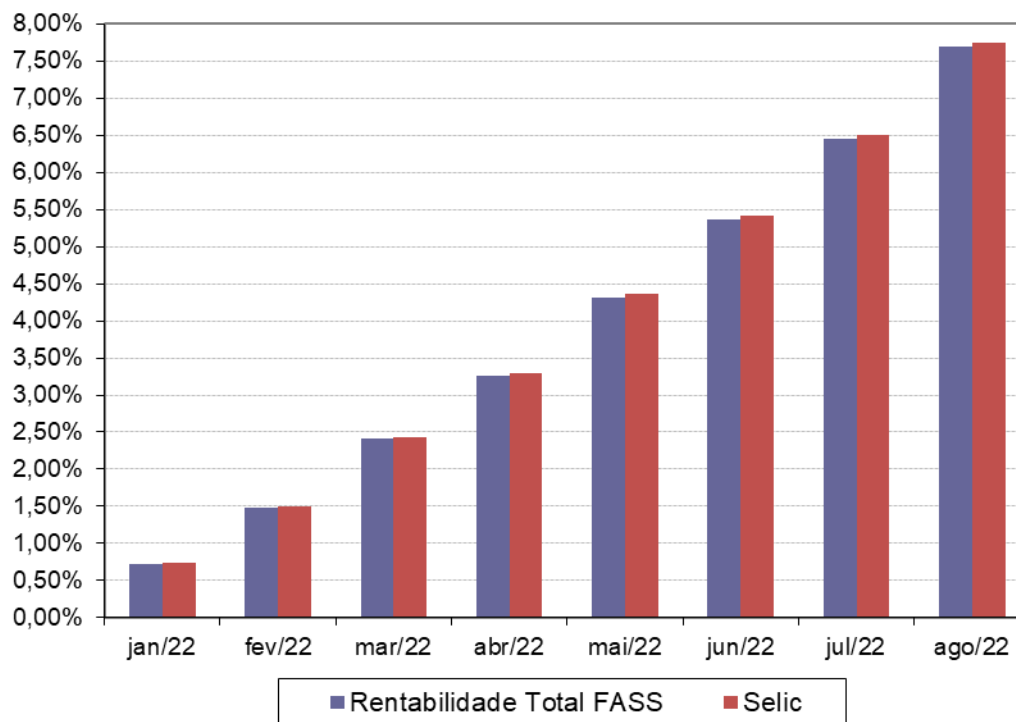
## FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	ago/22	Acum. Ano	ago/22	Acum. 2022
FI Caixa PCRJ RF	1,1623%	7,6930%	99,39%	99,23%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	1,0198%	6,6135%	87,21%	85,30%
Rentabilidade Total FASS	1,1623%	7,6918%	99,39%	99,21%
Selic	1,1694%	7,7529%		

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 <sup>(1)</sup> de 513,66% (FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF), 597,97% (Caixa Brasil Referenciado DI LP), 591,43% (FI Caixa Brasil TP RF LP), 577,37% (FI Caixa Aliança TP RF) e 609,79% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal. Desta forma, a carteira registrou um desempenho no mês de 587,28% em relação à meta e de 99,71% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 83,66% e de 99,23% 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)