

Relatório Mensal

2022

Setembro

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

DIRETORIA DE
INVESTIMENTOS

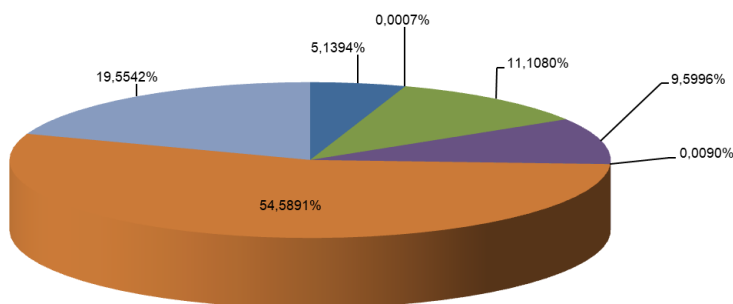
Composição da Carteira

Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)

Valor da Carteira pelo Mercado	
PREVI-RIO	R\$ 72.607.154,54
FUNPREVI	R\$ 1.374.473.855,93
FASS	R\$ 51.786.162,46

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

Valor por Tipo de Ativo pelo Mercado	
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	R\$ 70.639.562,89
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 10.276,11
FI Caixa Brasil TP RF LP	R\$ 152.676.613,56
FI Caixa Aliança TP RF	R\$ 131.943.404,30
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 123.610,97
Subtotal Valores Mobiliários Funprevi	R\$ 355.393.467,83
Imóveis ⁽¹⁾	R\$ 750.312.823,37
Empréstimos e Financiamentos (Saldo Devedor-set/22)	R\$ 268.767.564,73
Total Carteira Funprevi	R\$ 1.374.473.855,93

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

Aluguéis Recebidos	
Setembro/2022	R\$ 9.593.647,90

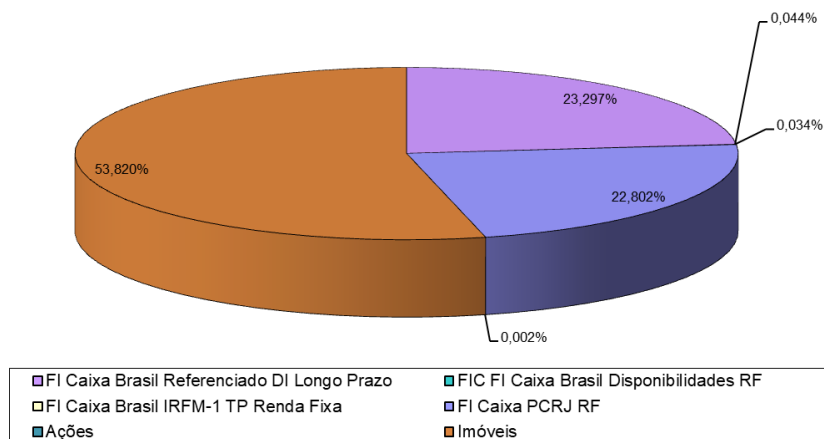
(1) Fonte: Balancete de verificação de setembro/2022 emitido em 27/10/2022.

(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

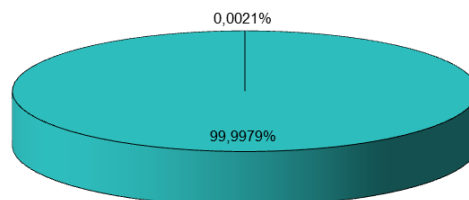
PREVI-RIO



Valor da Carteira	
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R\$ 16.915.401,14
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 24.940,12
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	R\$ 31.937,28
FI Caixa PCRJ RF	R\$ 16.556.078,70
Ações	R\$ 1.528,70
Subtotal Valores Mobiliários Previ-Rio	R\$ 33.529.885,94
Imóveis ⁽¹⁾	R\$ 39.077.268,60
Total Carteira Previ-Rio	R\$ 72.607.154,54

(1) Fonte: Balancete de verificação de setembro/2022 emitido em 27/10/2022.

FASS



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

Valor da Carteira	
FI CAIXA PCRJ RF	R\$ 51.785.086,55
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 1.075,91
Total Carteira FASS	R\$ 51.786.162,46

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

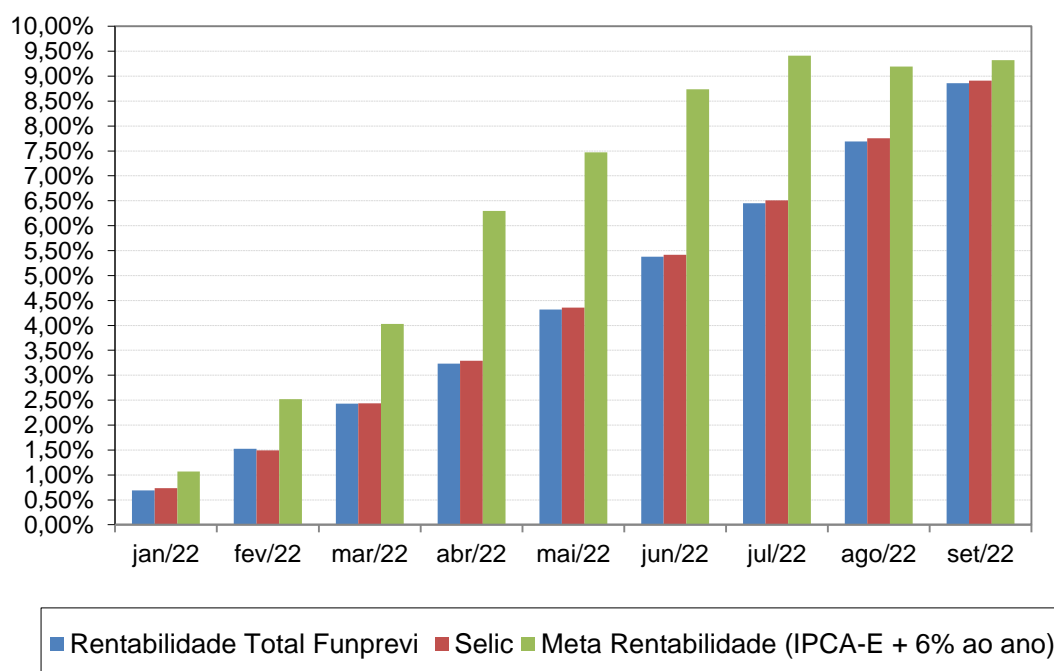
FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	set/22	Acum. Ano	set/22	Acum. 2022	set/22	Acum. 2022
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	1,1051%	9,1188%	945,45%	97,80%	103,09%	102,37%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,9344%	7,6097%	799,38%	81,62%	87,17%	85,43%
FI Caixa Brasil TP RF LP	1,0930%	9,0275%	935,02%	96,82%	101,96%	101,34%
FI Caixa Aliança TP RF	1,0522%	8,6998%	900,16%	93,31%	98,16%	97,66%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	1,0879%	8,3869%	930,67%	89,95%	101,48%	94,15%
Rentabilidade Total Funprevi	1,0799%	8,8564%	923,83%	94,99%	100,74%	99,42%
Meta Rentabilidade	0,1169%	9,3236%				
Selic	1,0720%	8,9080%				

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

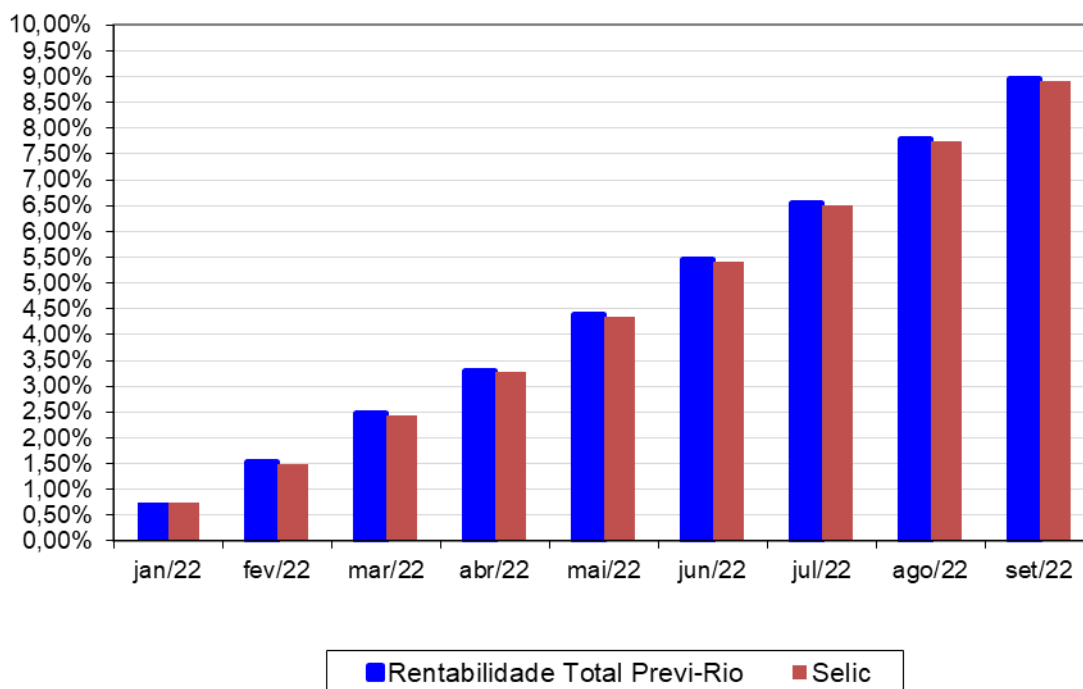
PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	set/22	Acum. Ano	set/22	Acum. 2022
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	1,1051%	9,1188%	103,09%	102,37%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,9344%	7,6097%	87,17%	85,43%
FI Caixa PCRJ RF	1,0667%	8,8417%	99,51%	99,26%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	1,0879%	8,3869%	101,48%	94,15%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Previ-Rio	1,0842%	8,9699%	101,14%	100,69%
Selic	1,0720%	8,9080%		

OBSERVAÇÃO:

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

Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

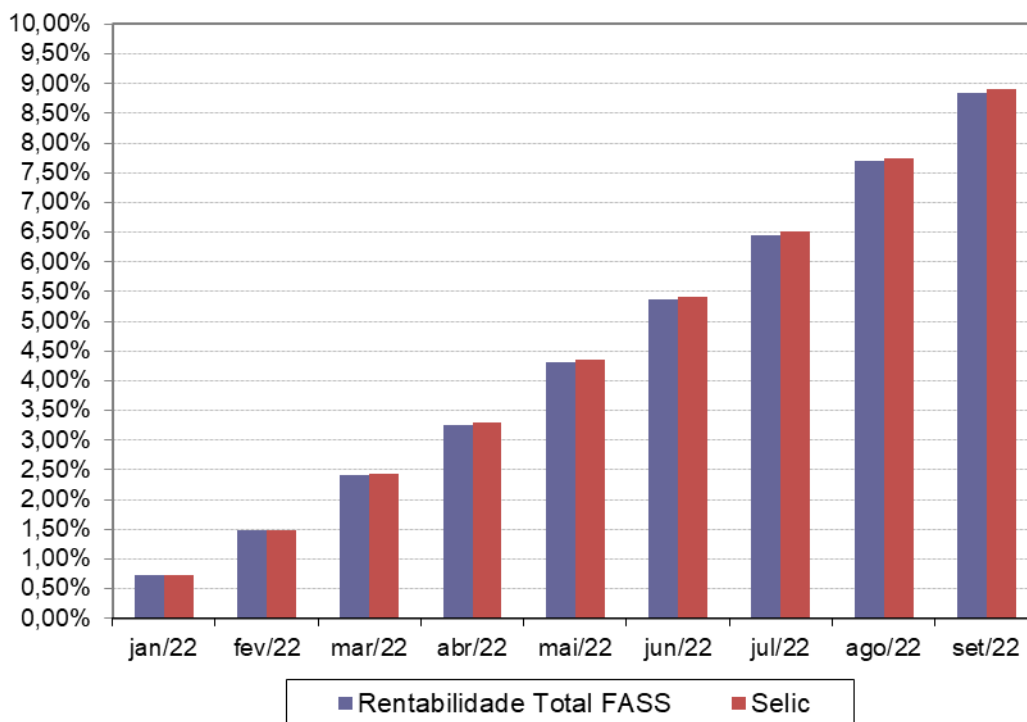
FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	set/22	Acum. Ano	set/22	Acum. 2022
FI Caixa PCRJ RF	1,0667%	8,8417%	99,51%	99,26%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,9344%	7,6097%	87,17%	85,43%
Rentabilidade Total FASS	1,0667%	8,8405%	99,51%	99,24%
Selic	1,0720%	8,9080%		

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 setembro, rentabilidades em relação à meta de rentabilidade ⁽¹⁾ de 799,38% (FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF), 945,45% (Caixa Brasil Referenciado DI LP), 935,02% (FI Caixa Brasil TP RF LP), 900,16% (FI Caixa Aliança TP RF) e 930,67% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal. Desta forma, a carteira registrou um desempenho no mês de 923,83% em relação à meta e de 100,74% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 94,99% e de 99,42% 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)