

Relatório Mensal

2022

Abril

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

DIRETORIA DE
INVESTIMENTOS

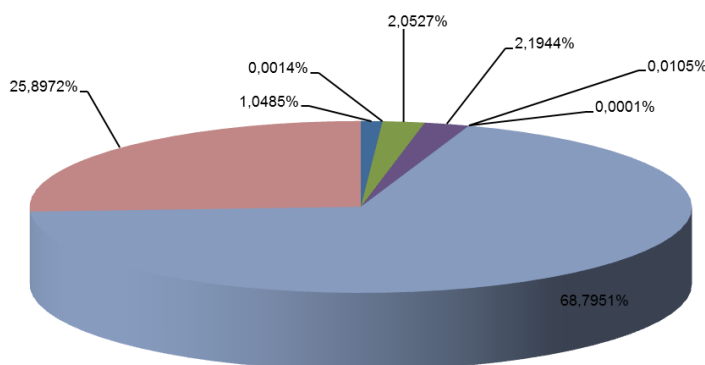
Composição da Carteira

Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)

Valor da Carteira pelo Mercado	
PREVI-RIO	R\$ 55.926.374,27
FUNPREVI	R\$ 1.112.971.802,34
FASS	R\$ 50.639.296,16

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	■ Empréstimos e Financiamentos (Saldo Devedor - abr/22)

Valor por Tipo de Ativo pelo Mercado	
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	R\$ 11.669.476,83
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 15.513,60
FI Caixa Brasil TP RF LP	R\$ 22.846.149,62
FI Caixa Aliança TP RF	R\$ 24.423.122,39
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 117.416,19
Ações	R\$ 1.416,00
Subtotal Valores Mobiliários Funprevi	R\$ 59.073.094,63
Imóveis ⁽¹⁾	R\$ 765.670.523,37
Empréstimos e Financiamentos (Saldo Devedor - abr/22)	R\$ 288.228.184,34
Total Carteira Funprevi	R\$ 1.112.971.802,34

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

Aluguéis Recebidos	
Abril/2022	R\$ 4.863.020,74

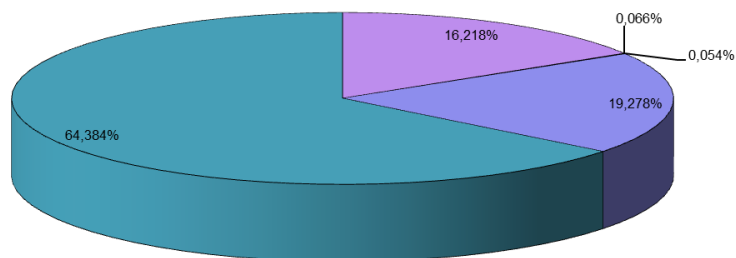
(1) Fonte: Balancete de verificação de abril/2022 emitido em 24/05/2022.

(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

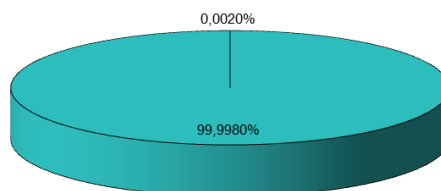


FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	FI Caixa PCRJ RF
Imóveis	

Valor da Carteira	
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R\$ 9.070.054,38
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 37.112,57
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	R\$ 30.336,74
FI Caixa PCRJ RF	R\$ 10.781.207,95
Subtotal Valores Mobiliários Previ-Rio	R\$ 19.918.711,64
Imóveis ⁽¹⁾	R\$ 36.007.662,63
Total Carteira Previ-Rio	R\$ 55.926.374,27

(1) Fonte: Balancete de verificação de abril/2022 emitido em 24/05/2022.

FASS



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

Valor da Carteira	
FI CAIXA PCRJ RF	R\$ 50.638.291,60
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 1.004,56
Total Carteira FASS	R\$ 50.639.296,16

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

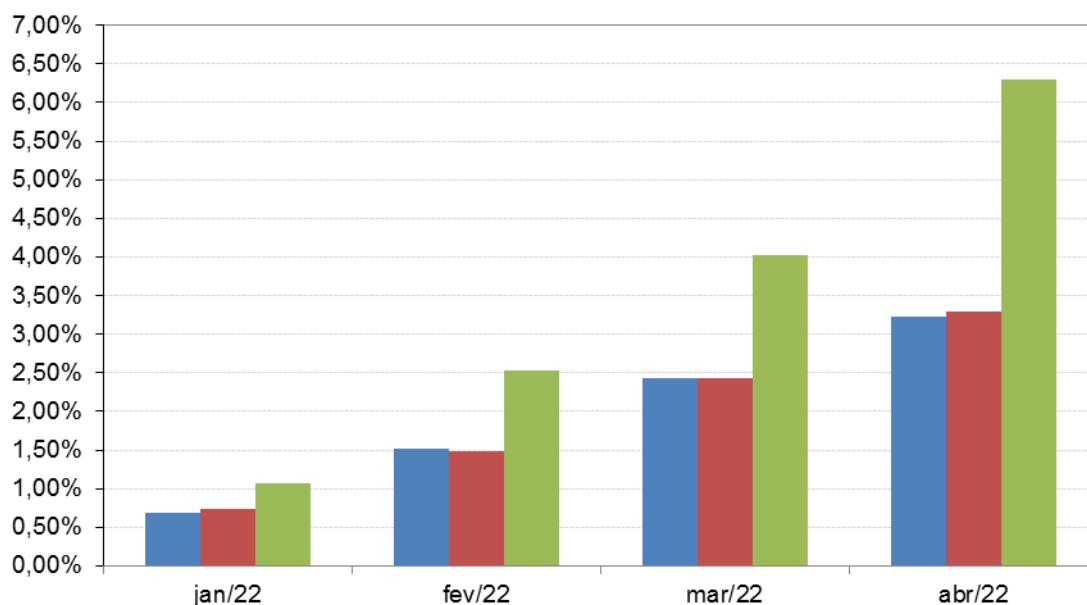
FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	abr/22	Acum. Ano	abr/22	Acum. 2022	abr/22	Acum. 2022
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,8001%	3,3755%	36,71%	53,62%	95,90%	102,65%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,7149%	2,7714%	32,80%	44,03%	85,68%	84,28%
FI Caixa Brasil TP RF LP	0,7469%	3,3400%	34,26%	53,06%	89,52%	101,57%
FI Caixa Aliança TP RF	0,8167%	3,2009%	37,47%	50,85%	97,89%	97,34%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,7235%	2,9551%	33,19%	46,95%	86,72%	89,87%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Funprevi	0,7851%	3,2345%	36,02%	51,38%	94,10%	98,36%
Meta Rentabilidade	2,1797%	6,2947%				
Selic	0,8343%	3,2884%				

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

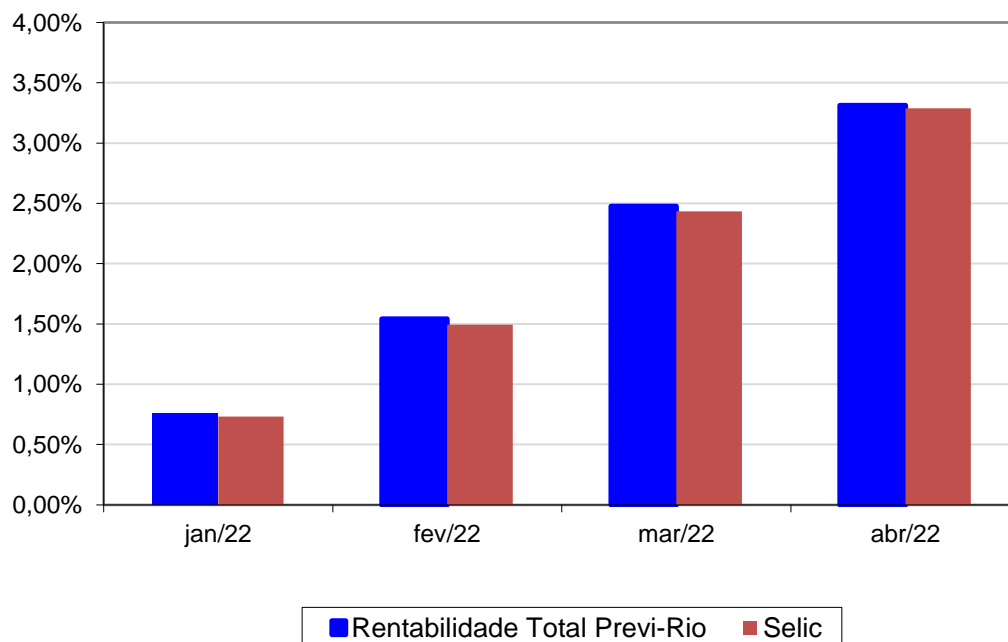
PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	abr/22	Acum. Ano	abr/22	Acum. 2022
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,8001%	3,3755%	95,90%	102,65%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,7149%	2,7714%	85,68%	84,28%
FI Caixa PCRJ RF	0,8299%	3,2584%	99,47%	99,09%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,7235%	2,9551%	86,72%	89,87%
Rentabilidade Total Previ-Rio	0,8155%	3,3125%	97,74%	100,73%
Selic	0,8343%	3,2884%		

OBSERVAÇÃO:

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

Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

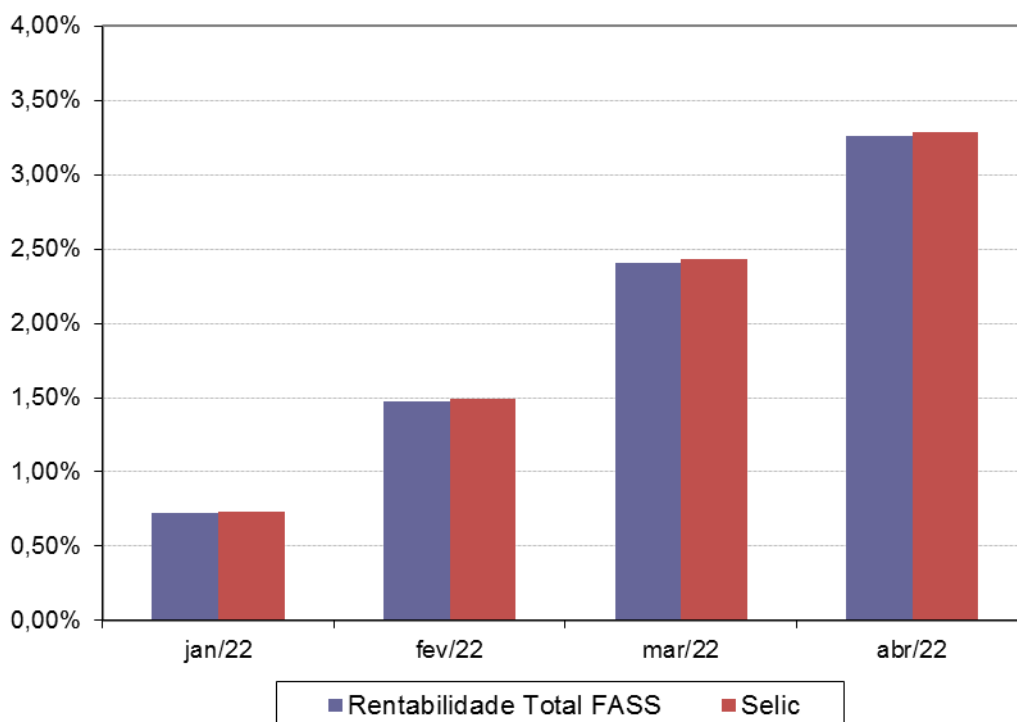
FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	abr/22	Acum. Ano	abr/22	Acum. 2022
FI Caixa PCRJ RF	0,8299%	3,2584%	99,47%	99,09%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,7149%	2,7714%	85,68%	84,28%
Rentabilidade Total FASS	0,8299%	3,2572%	99,47%	99,05%
Selic	0,8343%	3,2884%		

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 abril, rentabilidades em relação à meta de rentabilidade ⁽¹⁾ de 32,80% (FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF), 36,71% (Caixa Brasil Referenciado DI LP), 34,26% (FI Caixa Brasil TP RF LP), 37,47% (FI Caixa Aliança TP RF) e 33,19% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal. Desta forma, a carteira registrou um desempenho no mês de 36,02% em relação à meta e de 94,10% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 51,38% e de 98,36% 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)