

Relatório Mensal

2022

Janeiro

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

DIRETORIA DE
INVESTIMENTOS

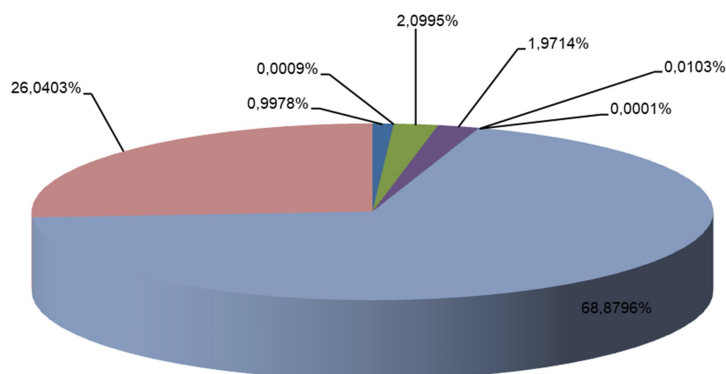
Composição da Carteira

Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)

Valor da Carteira pelo Mercado	
PREVI-RIO	R\$ 63.389.313,63
FUNPREVI	R\$ 822.140.606,00
FASS	R\$ 45.857.655,39

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 - jan/22)

Valor por Tipo de Ativo pelo Mercado	
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	R\$ 11.091.758,89
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 10.275,90
FI Caixa Brasil TP RF LP	R\$ 23.338.193,58
FI Caixa Aliança TP RF	R\$ 21.913.697,71
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 114.740,55
Ações	R\$ 1.416,00
Subtotal Valores Mobiliários Funprevi	R\$ 56.470.082,63
Imóveis	R\$ 765.670.523,37
Empréstimos e Financiamentos (Saldo Devedor - jan/22)	R\$ 289.466.099,66
Total Carteira Funprevi	R\$ 1.111.606.705,66

Valor Presente dos Recebíveis de Royalties	
Valor Presente (31/12/2021) ⁽¹⁾	R\$ 7.805.056.488,81

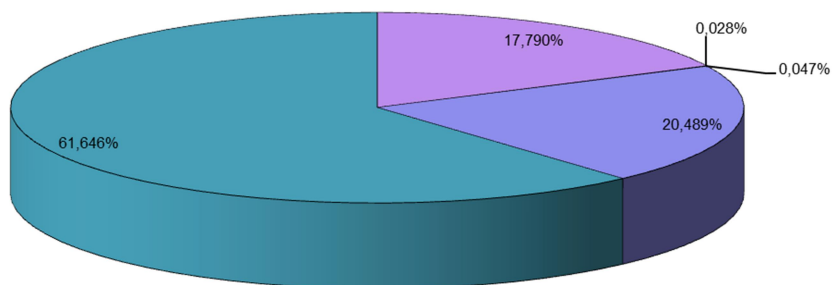
Aluguéis Recebidos	
Janeiro 2022	R\$ 4.324.755,55

(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

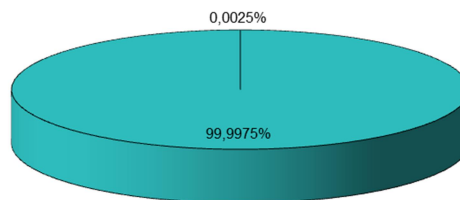
PREVI-RIO



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\$ 11.276.796,67
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 17.645,22
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	R\$ 29.645,44
FI Caixa PCRJ RF	R\$ 12.987.957,70
Subtotal Valores Mobiliários Previ-Rio	R\$ 24.312.045,03
Imóveis	R\$ 39.077.268,60
Total Carteira Previ-Rio	R\$ 63.389.313,63

FASS



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

Valor da Carteira	
FI CAIXA PCRJ RF	R\$ 45.856.524,99
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 1.130,40
Total Carteira FASS	R\$ 45.857.655,39

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

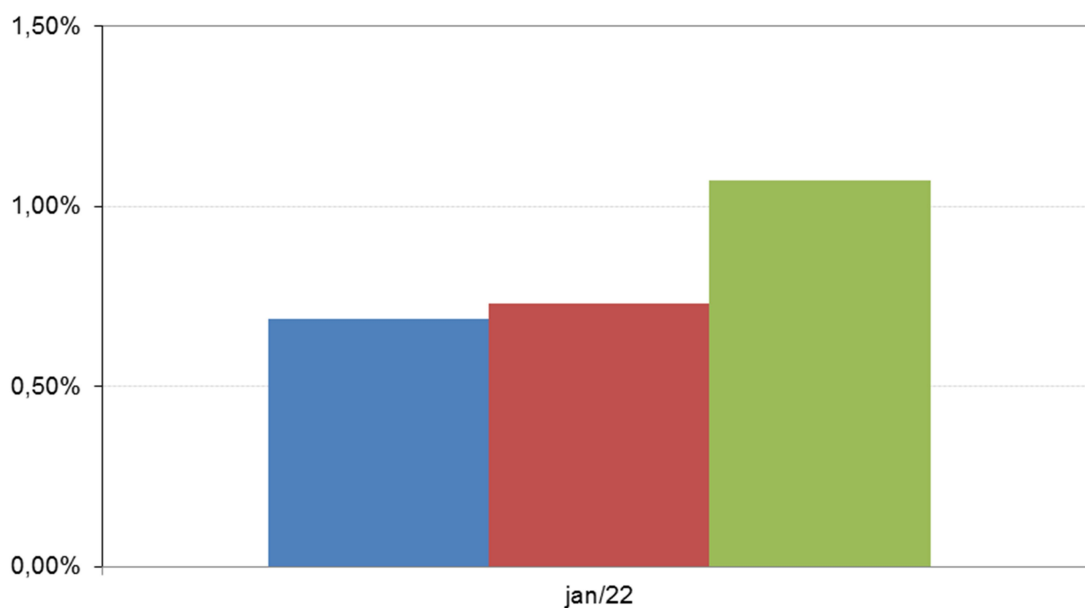
FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	jan/22	Acum. Ano	jan/22	Acum. 2022	jan/22	Acum. 2022
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,7869%	0,7869%	73,44%	73,44%	107,46%	107,46%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,6081%	0,6081%	56,75%	56,75%	83,05%	83,05%
FI Caixa Brasil TP RF LP	0,7941%	0,7941%	74,11%	74,11%	108,44%	108,44%
FI Caixa Aliança TP RF	0,7123%	0,7123%	66,47%	66,47%	97,27%	97,27%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,6090%	0,6090%	56,83%	56,83%	83,17%	83,17%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Funprevi	0,6895%	0,6895%	64,35%	64,35%	94,16%	94,16%
Meta Rentabilidade	1,0715%	1,0715%				
Selic	0,7323%	0,7323%				

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

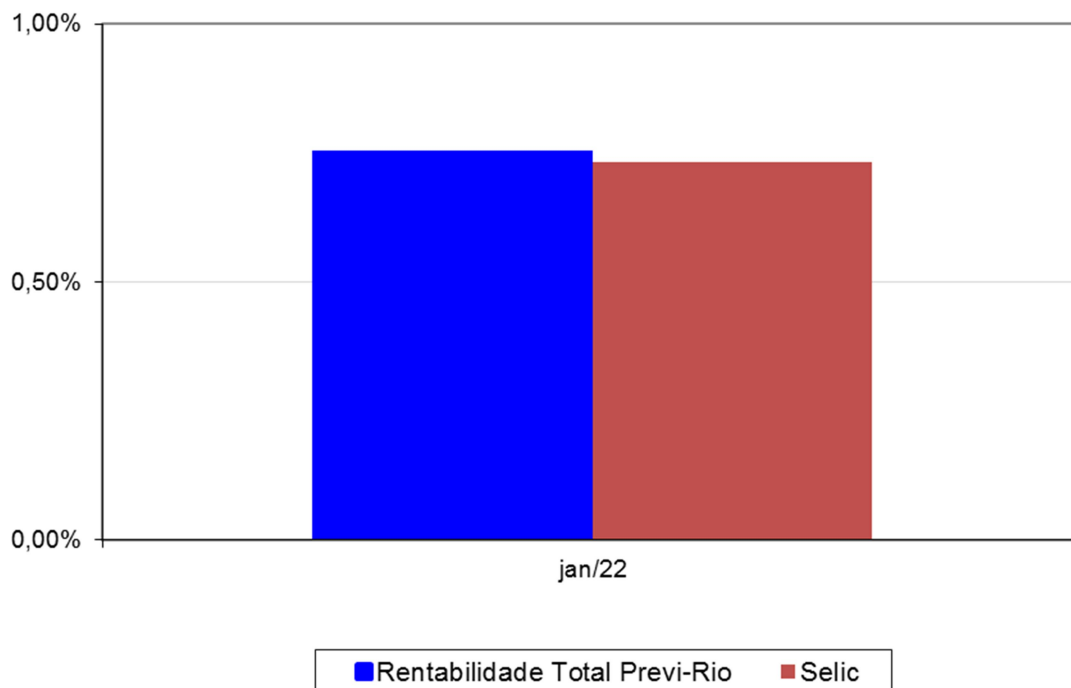
PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	jan/22	Acum. Ano	jan/22	Acum. 2022
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,7869%	0,7869%	107,46%	107,46%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,6081%	0,6081%	83,05%	83,05%
FI Caixa PCRJ RF	0,7270%	0,7270%	99,27%	99,27%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,6090%	0,6090%	83,17%	83,17%
Rentabilidade Total Previ-Rio	0,7545%	0,7545%	103,03%	103,03%
Selic	0,7323%	0,7323%		

OBSERVAÇÃO:

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

Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

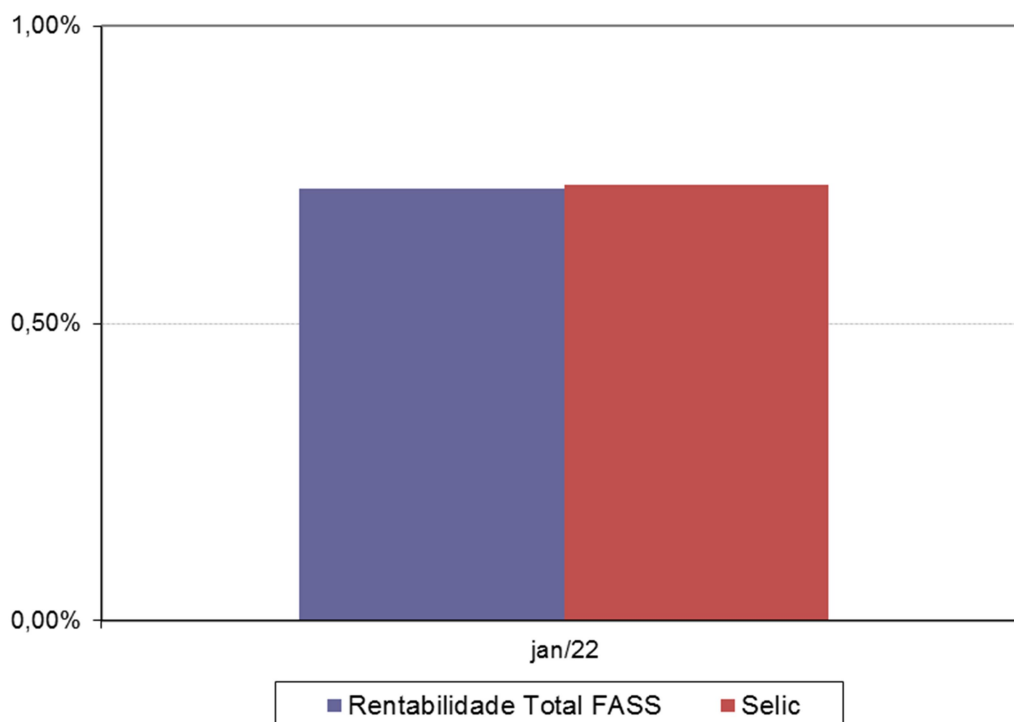
FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	jan/22	Acum. Ano	jan/22	Acum. 2022
FI Caixa PCRJ RF	0,7270%	0,7270%	99,27%	99,27%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,6081%	0,6081%	83,05%	83,05%
Rentabilidade Total FASS	0,7258%	0,7258%	99,12%	99,12%
Selic	0,7323%	0,7323%		

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 janeiro, rentabilidades em relação à meta de rentabilidade ⁽¹⁾ de 56,75% (FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF), 73,44% (Caixa Brasil Referenciado DI LP), 74,11% (FI Caixa Brasil TP RF LP), 66,47% (FI Caixa Aliança TP RF) e 56,83% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal. Desta forma, a carteira registrou um desempenho no mês de 64,35% em relação à meta e de 94,16% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 64,35% e de 94,16% 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)