

# Relatório Mensal

2022

# Março

---

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

DIRETORIA DE  
INVESTIMENTOS

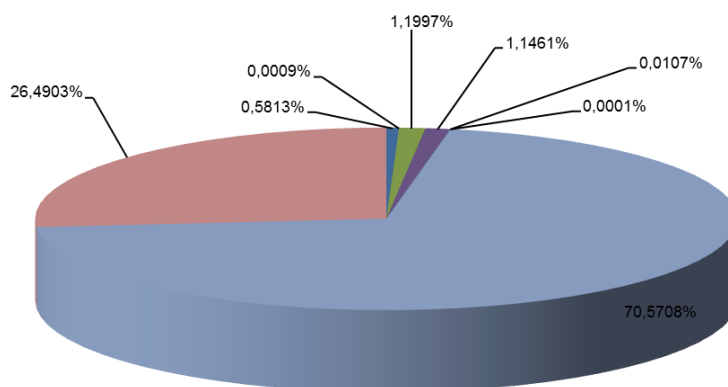
# Composição da Carteira

## Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

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

Valor da Carteira pelo Mercado	
PREVI-RIO	R\$ 62.233.534,27
FUNPREVI	R\$ 1.084.967.835,36
FASS	R\$ 48.946.855,14

### 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 - mar/22)

Valor por Tipo de Ativo pelo Mercado	
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	R\$ 6.306.702,64
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 10.239,89
FI Caixa Brasil TP RF LP	R\$ 13.016.245,98
FI Caixa Aliança TP RF	R\$ 12.434.561,90
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 116.572,78
Ações	R\$ 1.416,00
Subtotal Valores Mobiliários Funprevi	R\$ 31.885.739,19
Imóveis	R\$ 765.670.523,37
Empréstimos e Financiamentos (Saldo Devedor - mar/22)	R\$ 287.411.572,80
Total Carteira Funprevi	R\$ 1.084.967.835,36

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

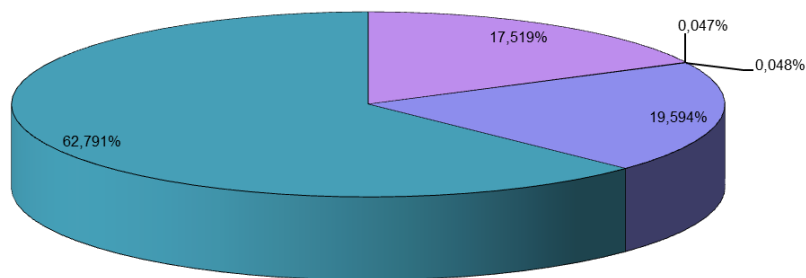
Aluguéis Recebidos	
Março/2022	R\$ 4.869.340,25

(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

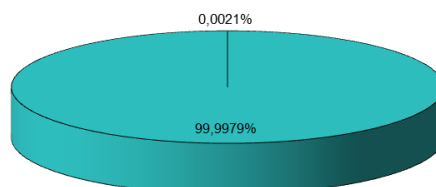
### PREVI-RIO



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\$ 10.902.518,65
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 29.535,13
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	R\$ 30.118,83
FI Caixa PCRJ RF	R\$ 12.194.093,06
<b>Subtotal Valores Mobiliários Previ-Rio</b>	<b>R\$ 23.156.265,67</b>
Imóveis	R\$ 39.077.268,60
<b>Total Carteira Previ-Rio</b>	<b>R\$ 62.233.534,27</b>

### FASS



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

Valor da Carteira	
FI CAIXA PCRJ RF	R\$ 48.945.842,53
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 1.012,61
<b>Total Carteira FASS</b>	<b>R\$ 48.946.855,14</b>

# Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

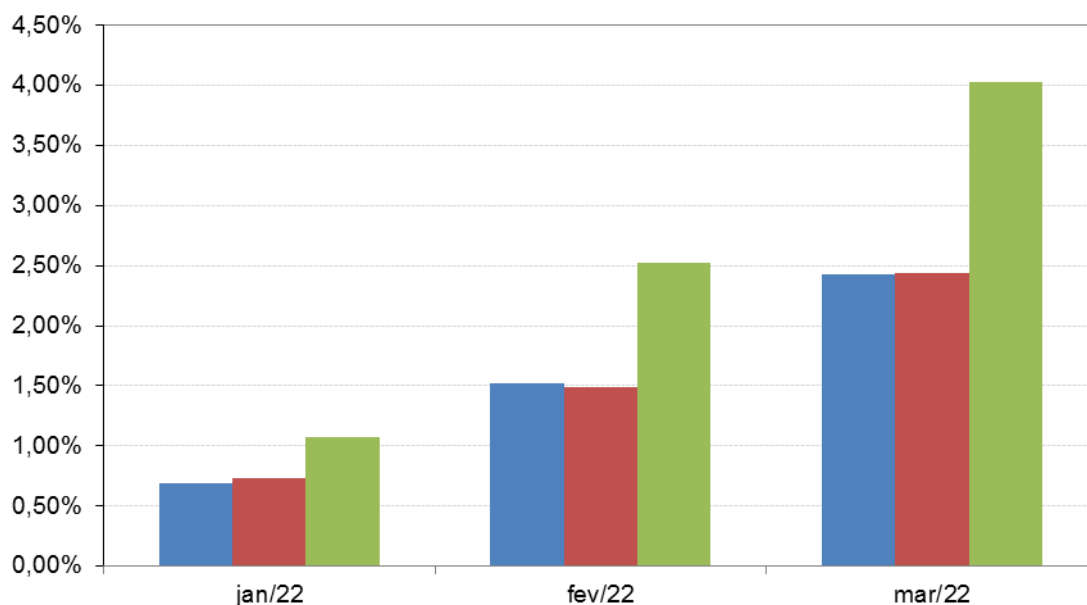
## FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	mar/22	Acum. Ano	mar/22	Acum. 2022	mar/22	Acum. 2022
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,9276%	2,5550%	63,23%	63,44%	100,05%	104,98%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,7860%	2,0419%	53,58%	50,70%	84,78%	83,90%
FI Caixa Brasil TP RF LP	0,8810%	2,5739%	60,06%	63,91%	95,03%	105,76%
FI Caixa Aliança TP RF	0,9028%	2,3649%	61,54%	58,72%	97,38%	97,17%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,8658%	2,2156%	59,02%	55,01%	93,39%	91,04%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Funprevi	0,8949%	2,4303%	61,01%	60,35%	96,53%	99,86%
Meta Rentabilidade	1,4669%	4,0273%				
Selic	0,9271%	2,4337%				

### 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

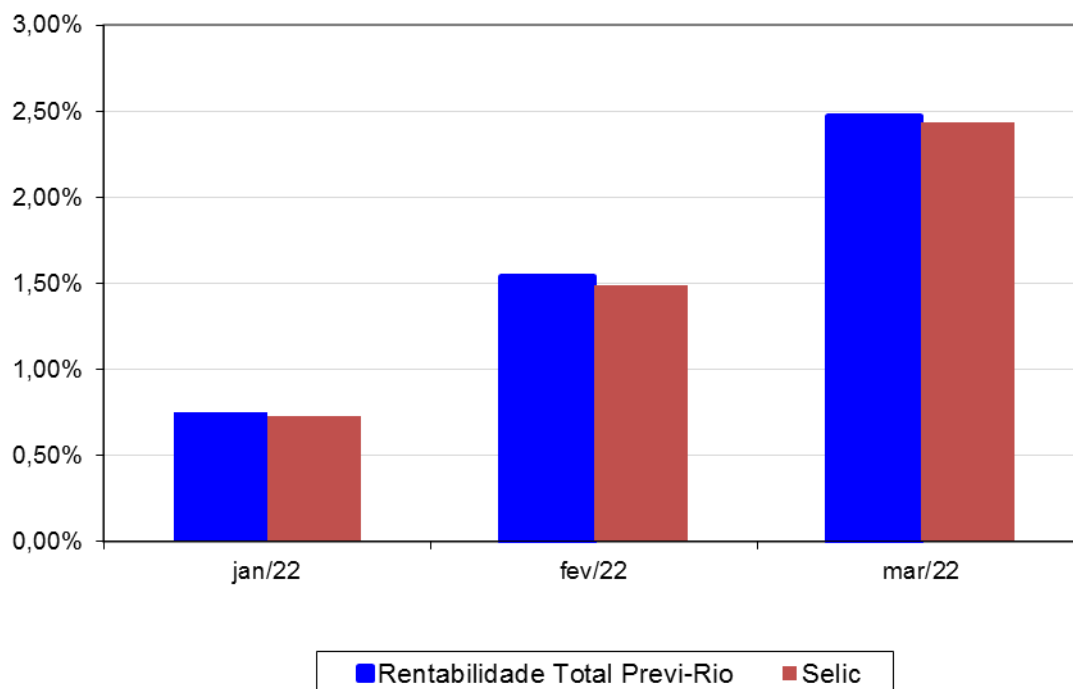
## PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	mar/22	Acum. Ano	mar/22	Acum. 2022
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,9276%	2,5550%	100,05%	104,98%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,7860%	2,0419%	84,78%	83,90%
FI Caixa PCRJ RF	0,9183%	2,4085%	99,06%	98,96%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,8658%	2,2156%	93,39%	91,04%
Rentabilidade Total Previ-Rio	0,9219%	2,4768%	99,44%	101,77%
Selic	0,9271%	2,4337%		

OBSERVAÇÃO:

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

### Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



# Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

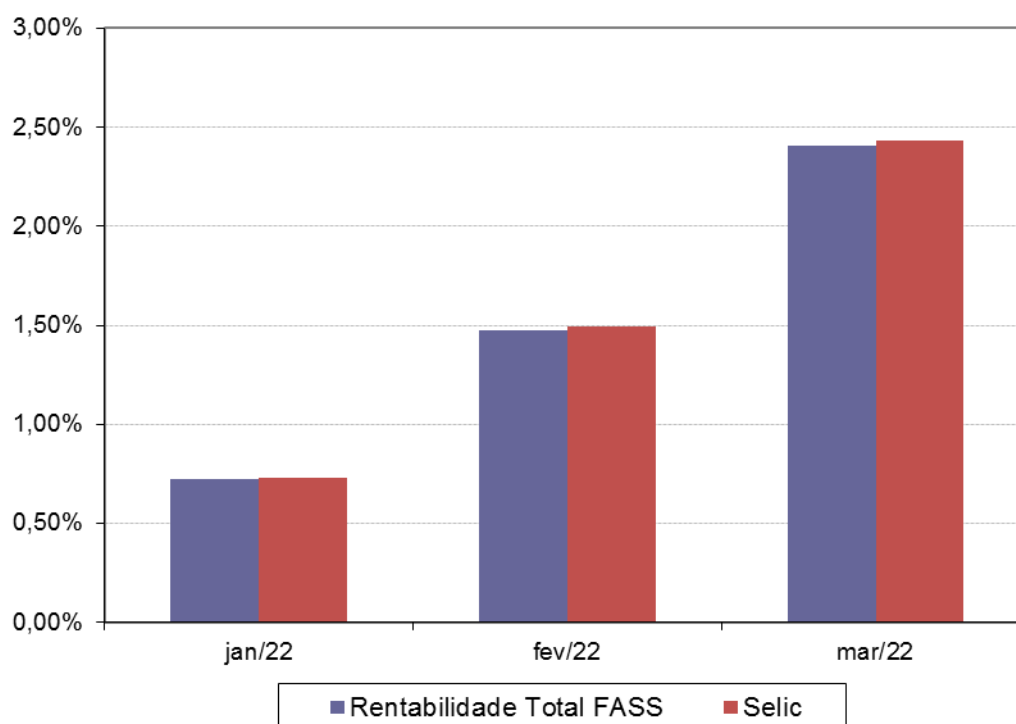
## FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	mar/22	Acum. Ano	mar/22	Acum. 2022
FI Caixa PCRJ RF	0,9183%	2,4085%	99,06%	98,96%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,7860%	2,0419%	84,78%	83,90%
Rentabilidade Total FASS	0,9183%	2,4073%	99,06%	98,92%
Selic	0,9271%	2,4337%		

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 março, rentabilidades em relação à meta de rentabilidade <sup>(1)</sup> de 53,58% (FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF), 63,23% (Caixa Brasil Referenciado DI LP), 60,06% (FI Caixa Brasil TP RF LP), 61,54% (FI Caixa Aliança TP RF) e 59,02% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal. Desta forma, a carteira registrou um desempenho no mês de 61,01% em relação à meta e de 96,53% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 60,35% e de 99,86% 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)