

Relatório Mensal

2022

Outubro

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

DIRETORIA DE
INVESTIMENTOS

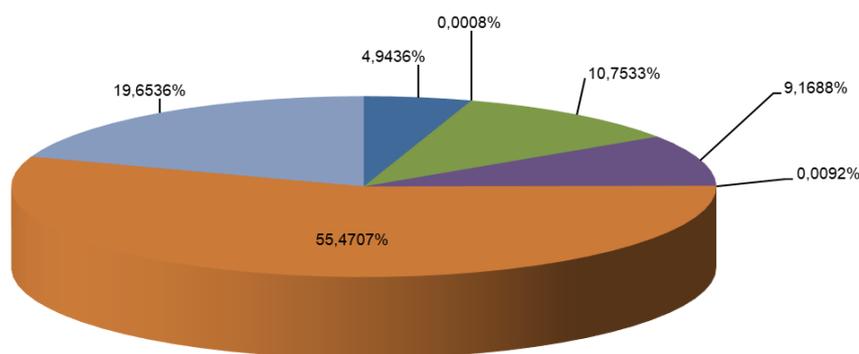
Composição da Carteira

Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)

Valor da Carteira pelo Mercado	
PREVI-RIO	R\$ 72.348.374,12
FUNPREVI	R\$ 1.352.629.097,61
FASS	R\$ 51.783.082,58

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-out/22)	

Valor por Tipo de Ativo pelo Mercado	
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	R\$ 66.868.290,45
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 10.280,13
FI Caixa Brasil TP RF LP	R\$ 145.451.723,78
FI Caixa Aliança TP RF	R\$ 124.020.469,21
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 124.828,54
Subtotal Valores Mobiliários Funprevi	R\$ 336.475.592,11
Imóveis ⁽¹⁾	R\$ 750.312.823,37
Empréstimos e Financiamentos (Saldo Devedor-out/22)	R\$ 265.840.682,13
Total Carteira Funprevi	R\$ 1.352.629.097,61

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

Aluguéis Recebidos	
Outubro/2022	R\$ 4.863.020,74

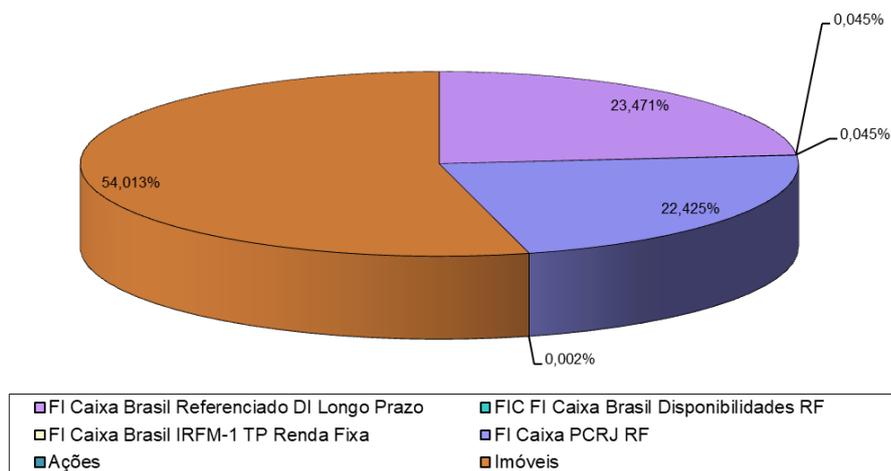
(1) Fonte: Balancete de verificação de outubro/2022 emitido em 29/11/2022.

(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

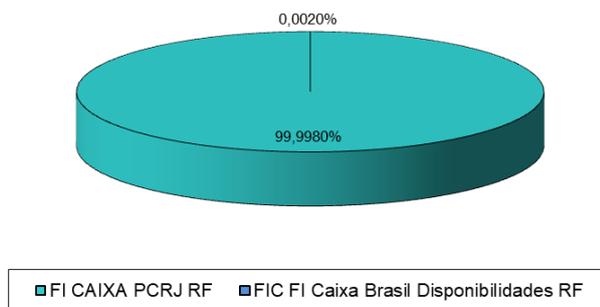
PREVI-RIO



Valor da Carteira	
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R\$ 16.980.941,53
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 32.241,32
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	R\$ 32.251,87
FI Caixa PCRJ RF	R\$ 16.224.142,10
Ações	R\$ 1.528,70
Subtotal Valores Mobiliários Previ-Rio	R\$ 33.271.105,52
Imóveis	R\$ 39.077.268,60
Total Carteira Previ-Rio	R\$ 72.348.374,12

1) Fonte: Balancete de verificação de outubro/2022 emitido em 29/11/2022.

FASS



Valor da Carteira	
FI CAIXA PCRJ RF	R\$ 51.782.068,03
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 1.014,55
Total Carteira FASS	R\$ 51.783.082,58

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

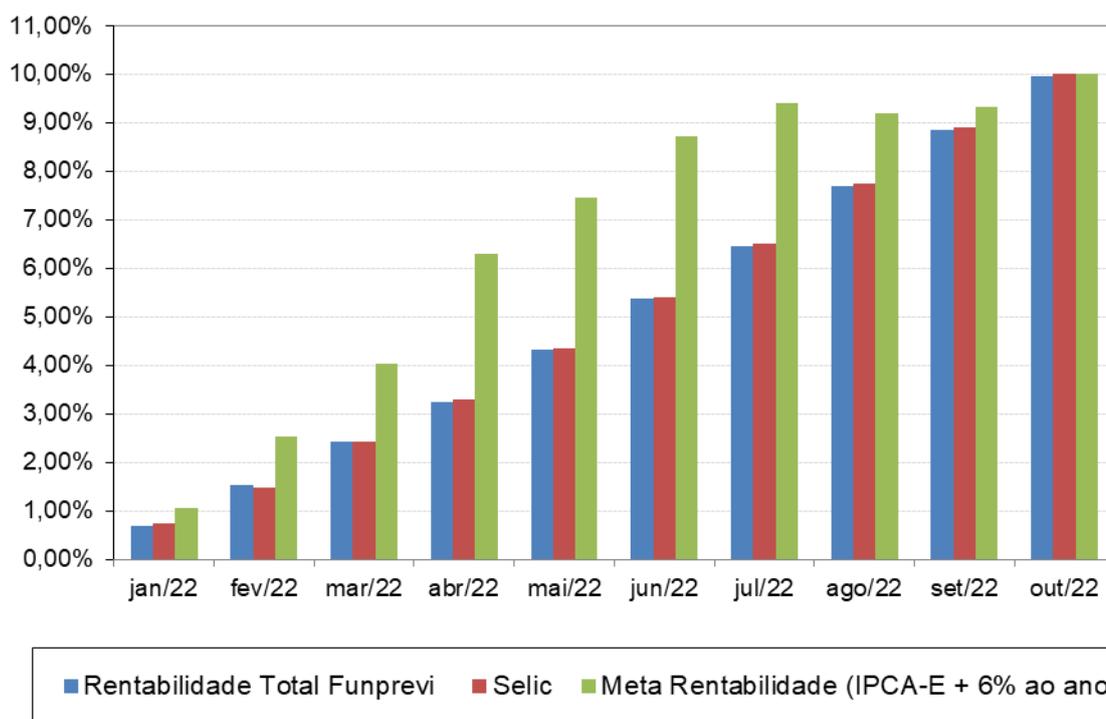
FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	out/22	Acum. Ano	out/22	Acum. 2022	out/22	Acum. 2022
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	1,0322%	10,2452%	164,86%	102,37%	101,13%	102,25%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,8861%	8,5633%	141,52%	85,56%	86,82%	85,47%
FI Caixa Brasil TP RF LP	1,0130%	10,1320%	161,80%	101,24%	99,25%	101,12%
FI Caixa Aliança TP RF	1,0021%	9,7891%	160,05%	97,81%	98,18%	97,70%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,9850%	9,4545%	157,32%	94,47%	96,50%	94,36%
Rentabilidade Total Funprevi	1,0128%	9,9589%	161,76%	99,51%	99,23%	99,39%
Meta Rentabilidade	0,6261%	10,0081%				
Selic	1,0207%	10,0196%				

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

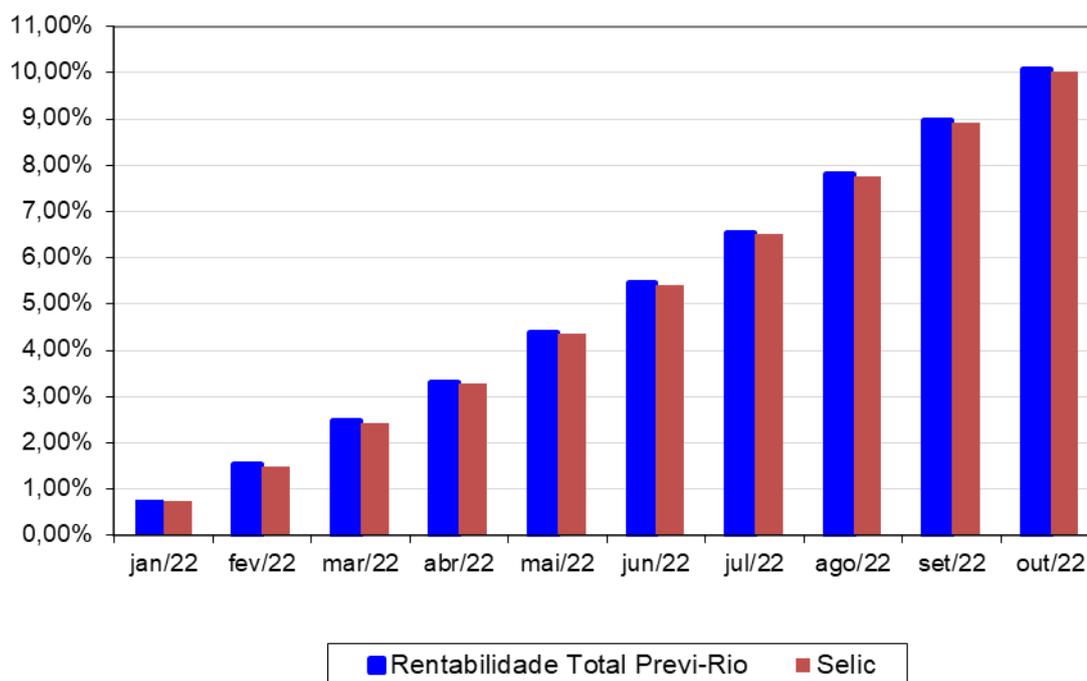
PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	out/22	Acum. Ano	out/22	Acum. 2022
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	1,0322%	10,2452%	101,13%	102,25%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,8861%	8,5633%	86,82%	85,47%
FI Caixa PCRJ RF	1,0160%	9,9476%	99,54%	99,28%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,9850%	9,4545%	96,50%	94,36%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Previ-Rio	1,0240%	10,0858%	100,33%	100,66%
Selic	1,0207%	10,0196%		

OBSERVAÇÃO:

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

Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

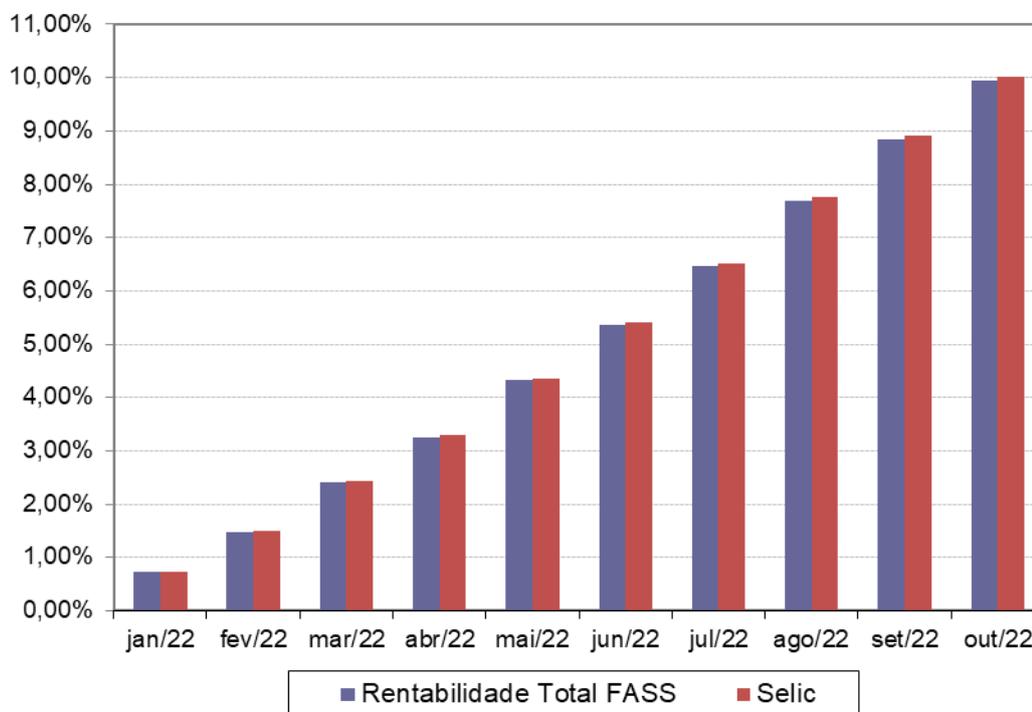
FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	out/22	Acum. Ano	out/22	Acum. 2022
FI Caixa PCRJ RF	1,0160%	9,9476%	99,54%	99,28%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,8861%	8,5633%	86,82%	85,47%
Rentabilidade Total FASS	1,0160%	9,9463%	99,54%	99,27%
Selic	1,0207%	10,0196%		

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 outubro, rentabilidades em relação à meta de rentabilidade ⁽¹⁾ de 141,52% (FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF), 164,86% (Caixa Brasil Referenciado DI LP), 161,80% (FI Caixa Brasil TP RF LP), 160,05% (FI Caixa Aliança TP RF) e 157,32% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal. Desta forma, a carteira registrou um desempenho no mês de 161,76% em relação à meta e de 99,23% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 99,51% e de 99,39% 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)