

# Relatório Mensal

2022

# Novembro

---

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

DIRETORIA DE  
INVESTIMENTOS

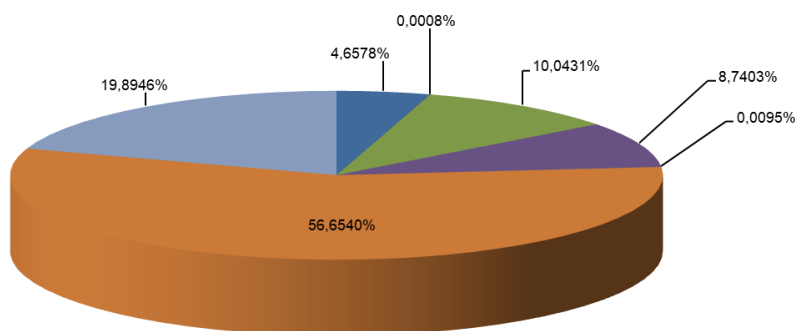
# Composição da Carteira

## Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

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

Valor da Carteira pelo Mercado	
PREVI-RIO	R\$ 77.644.171,50
FUNPREVI	R\$ 1.324.965.518,08
FASS	R\$ 52.351.946,54

### 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-nov/22)	

Valor por Tipo de Ativo pelo Mercado	
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	R\$ 61.713.879,14
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 10.255,19
FI Caixa Brasil TP RF LP	R\$ 133.067.151,96
FI Caixa Aliança TP RF	R\$ 115.806.004,49
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 125.979,02
Subtotal Valores Mobiliários Funprevi	R\$ 310.723.269,80
Imóveis	R\$ 750.645.823,37
Empréstimos e Financiamentos (Saldo Devedor-nov/22)	R\$ 263.596.424,91
<b>Total Carteira Funprevi</b>	<b>R\$ 1.324.965.518,08</b>

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

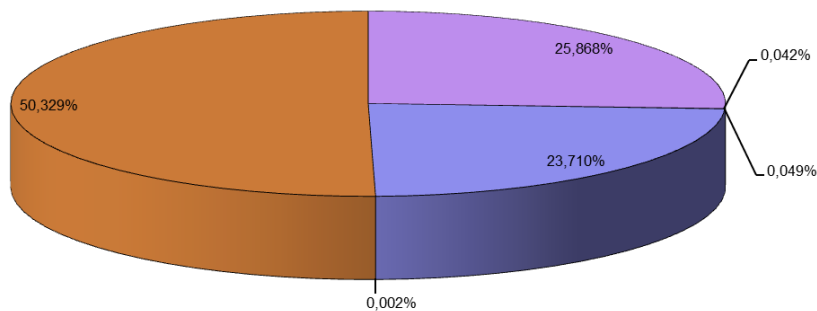
Aluguéis Recebidos	
Novembro/2022	R\$ 4.863.020,74

(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

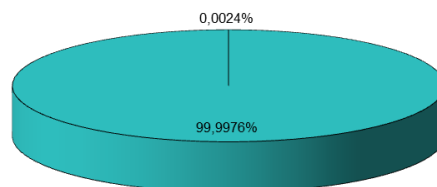
### PREVI-RIO



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
Ações	Imóveis

Valor da Carteira	
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R\$ 20.085.259,38
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 38.295,49
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	R\$ 32.549,12
FI Caixa PCRJ RF	R\$ 18.409.270,21
Ações	R\$ 1.528,70
<b>Subtotal Valores Mobiliários Previ-Rio</b>	<b>R\$ 38.566.902,90</b>
Imóveis	R\$ 39.077.268,60
<b>Total Carteira Previ-Rio</b>	<b>R\$ 77.644.171,50</b>

### FASS



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

Valor da Carteira	
FI CAIXA PCRJ RF	R\$ 52.350.687,33
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 1.259,21
<b>Total Carteira FASS</b>	<b>R\$ 52.351.946,54</b>

# Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

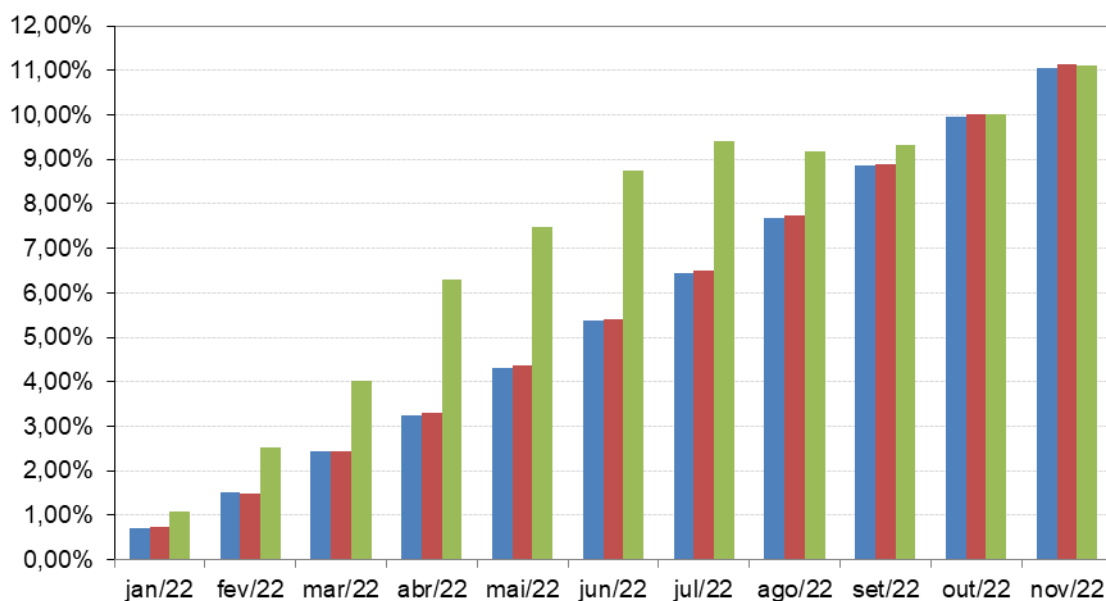
## FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	nov/22	Acum. Ano	nov/22	Acum. 2022	nov/22	Acum. 2022
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	1,0381%	11,3896%	104,03%	102,56%	101,71%	102,22%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,8832%	9,5220%	88,51%	85,74%	86,53%	85,46%
FI Caixa Brasil TP RF LP	0,9776%	11,2087%	97,98%	100,93%	95,78%	100,59%
FI Caixa Aliança TP RF	1,0019%	10,8892%	100,41%	98,05%	98,16%	97,73%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,9217%	10,4633%	92,37%	94,22%	90,30%	93,90%
Rentabilidade Total Funprevi	0,9985%	11,0569%	100,07%	99,56%	97,83%	99,23%
Meta Rentabilidade	0,9978%	11,1058%				
Selic	1,0207%	11,1425%				

### 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

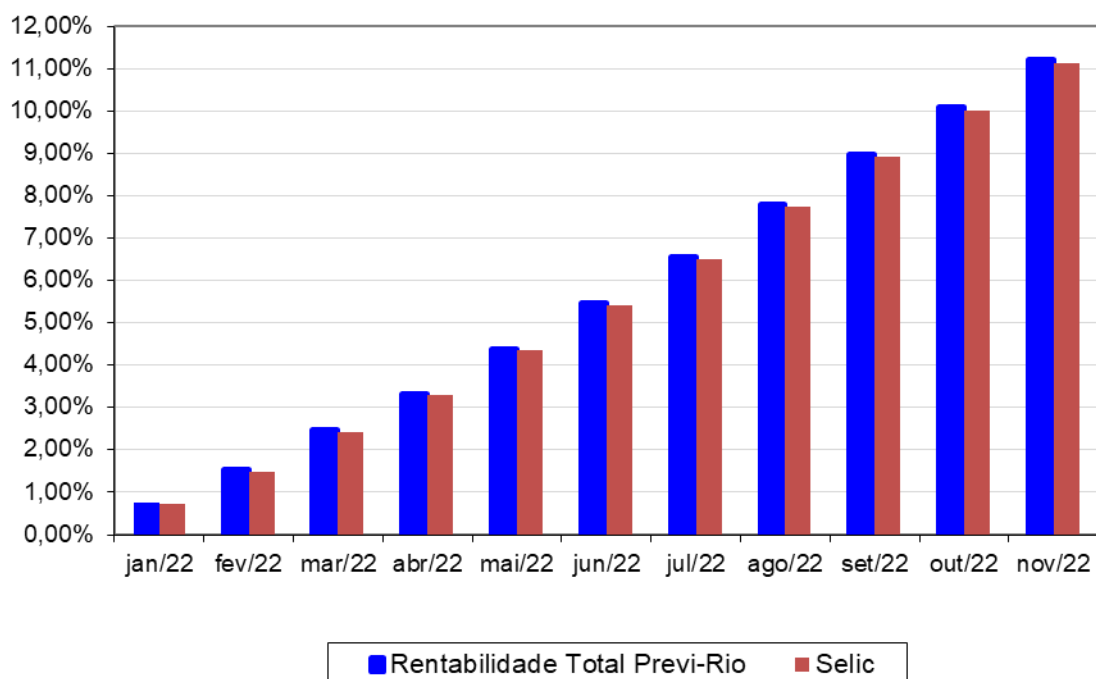
## PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	nov/22	Acum. Ano	nov/22	Acum. 2022
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	1,0381%	11,3896%	101,71%	102,22%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,8832%	9,5220%	86,53%	85,46%
FI Caixa PCRJ RF	1,0194%	11,0683%	99,87%	99,33%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,9217%	10,4633%	90,30%	93,90%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Previ-Rio	1,0286%	11,2181%	100,78%	100,68%
Selic	1,0207%	11,1425%		

### OBSERVAÇÃO:

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

### Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



# Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

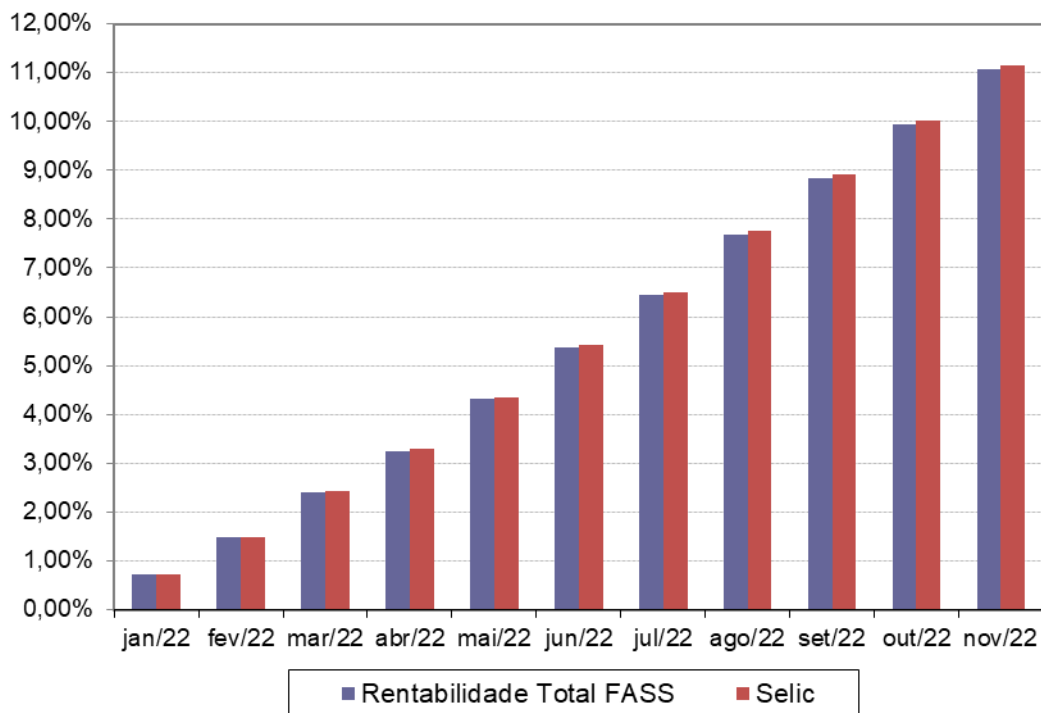
## FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	nov/22	Acum. Ano	nov/22	Acum. 2022
FI Caixa PCRJ RF	1,0194%	11,0683%	99,87%	99,33%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,8832%	9,5220%	86,53%	85,46%
Rentabilidade Total FASS	1,0193%	11,0671%	99,87%	99,32%
Selic	1,0207%	11,1425%		

### 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 novembro, rentabilidades em relação à meta de rentabilidade <sup>(1)</sup> de 88,51% (FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF), 104,03% (Caixa Brasil Referenciado DI LP), 97,98% (FI Caixa Brasil TP RF LP), 100,41% (FI Caixa Aliança TP RF) e 92,37% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal. Desta forma, a carteira registrou um desempenho no mês de 100,07% em relação à meta e de 97,83% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 99,56% e de 99,23% 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)