

Relatório Mensal

2022

Dezembro

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

DIRETORIA DE
INVESTIMENTOS

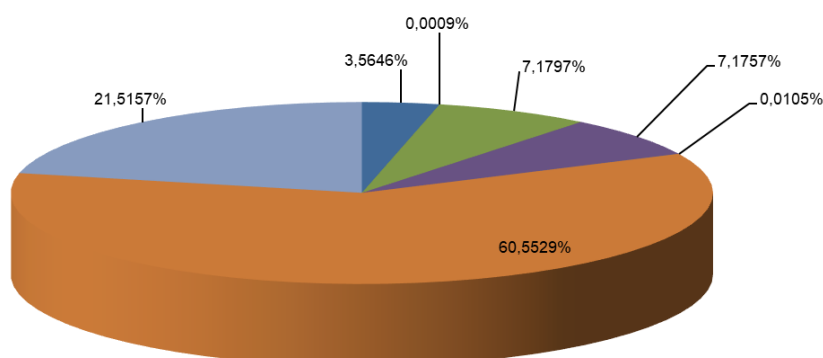
Composição da Carteira

Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)

Valor da Carteira pelo Mercado	
PREVI-RIO	R\$ 74.647.290,10
FUNPREVI	R\$ 1.213.645.895,40
FASS	R\$ 52.929.281,95

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-dez/22)	

Valor por Tipo de Ativo pelo Mercado	
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	R\$ 43.261.915,06
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 10.326,51
FI Caixa Brasil TP RF LP	R\$ 87.136.721,81
FI Caixa Aliança TP RF	R\$ 87.087.134,66
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 127.433,55
Subtotal Valores Mobiliários Funprevi	R\$ 217.623.531,59
Imóveis	R\$ 734.898.323,37
Empréstimos e Financiamentos (Saldo Devedor-dez/22)	R\$ 261.124.040,44
Total Carteira Funprevi	R\$ 1.213.645.895,40

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

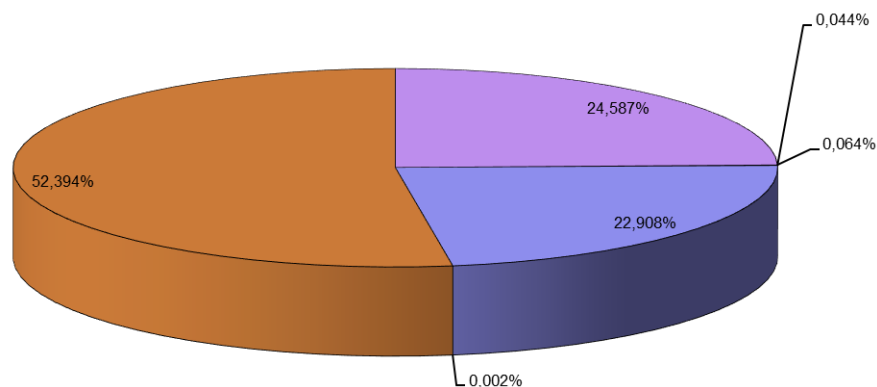
Aluguéis Recebidos	
Dezembro/2022	R\$ 4.863.020,74

(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

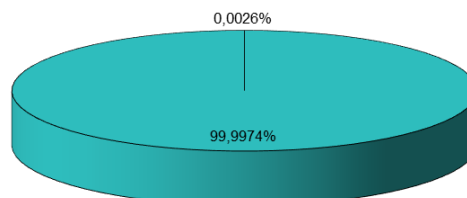
PREVI-RIO



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\$ 18.353.878,28
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 47.818,33
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	R\$ 32.924,92
FI Caixa PCRJ RF	R\$ 17.100.171,27
Ações	R\$ 1.528,70
Subtotal Valores Mobiliários Previ-Rio	R\$ 35.536.321,50
Imóveis	R\$ 39.110.968,60
Total Carteira Previ-Rio	R\$ 74.647.290,10

FASS



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

Valor da Carteira	
FI CAIXA PCRJ RF	R\$ 52.927.903,16
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 1.378,79
Total Carteira FASS	R\$ 52.929.281,95

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

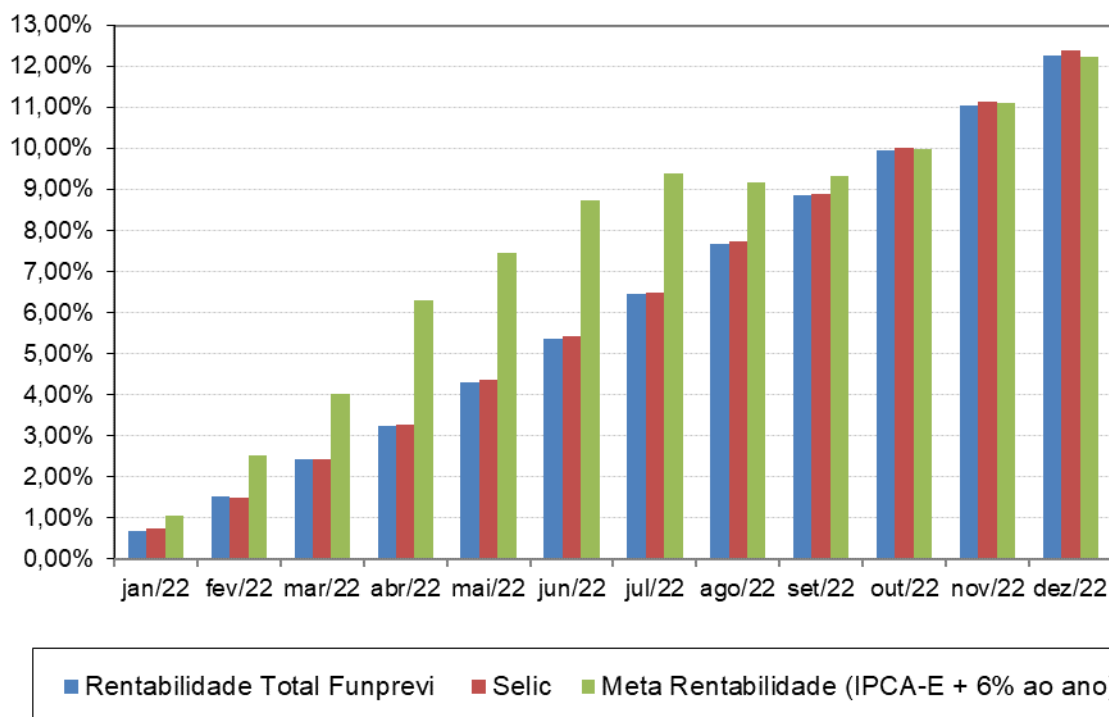
FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	dez/22	Acum. Ano	dez/22	Acum. 2022	dez/22	Acum. 2022
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	1,1497%	12,6702%	111,11%	103,38%	102,35%	102,25%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,9634%	10,5772%	93,11%	86,31%	85,76%	85,36%
FI Caixa Brasil TP RF LP	1,0942%	12,4255%	105,75%	101,39%	97,41%	100,28%
FI Caixa Aliança TP RF	1,1025%	12,1117%	106,55%	98,83%	98,14%	97,75%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	1,1546%	11,7387%	111,59%	95,78%	102,78%	94,74%
Rentabilidade Total Funprevi	1,1083%	12,2878%	107,12%	100,26%	98,67%	99,17%
Meta Rentabilidade	1,0347%	12,2554%				
Selic	1,1233%	12,3910%				

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

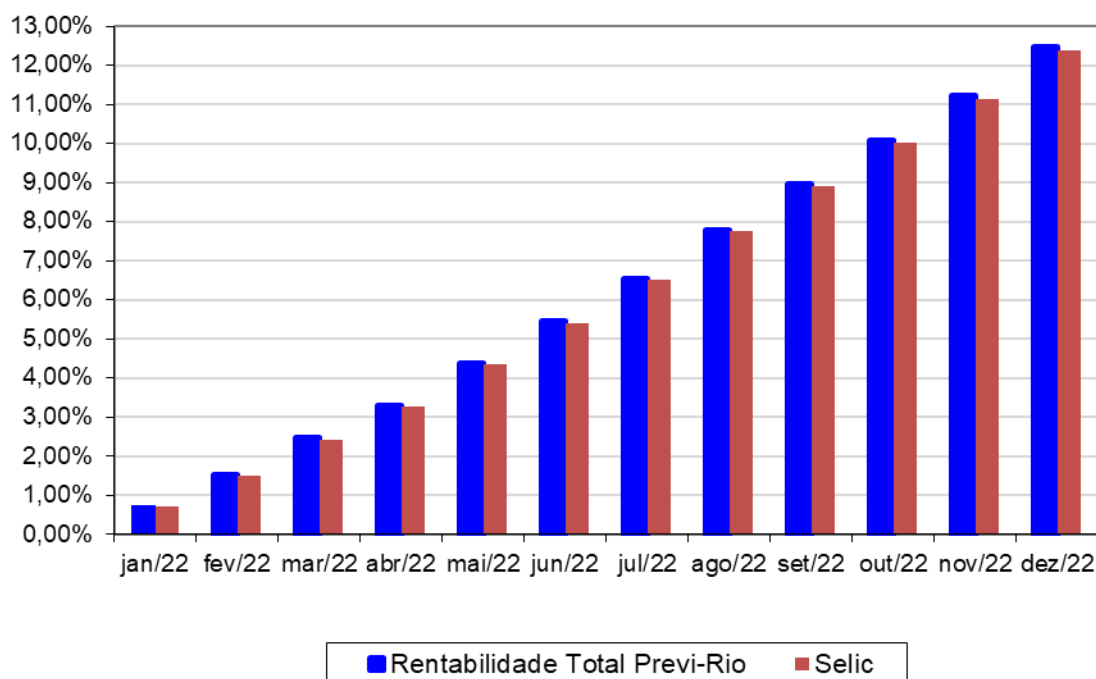
PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	dez/22	Acum. Ano	dez/22	Acum. 2022
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	1,1497%	12,6702%	102,35%	102,25%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,9634%	10,5772%	85,76%	85,36%
FI Caixa PCRJ RF	1,1248%	12,3176%	100,13%	99,41%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	1,1546%	11,7387%	102,78%	94,74%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Previ-Rio	1,1374%	12,4832%	101,26%	100,74%
Selic	1,1233%	12,3910%		

OBSERVAÇÃO:

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

Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

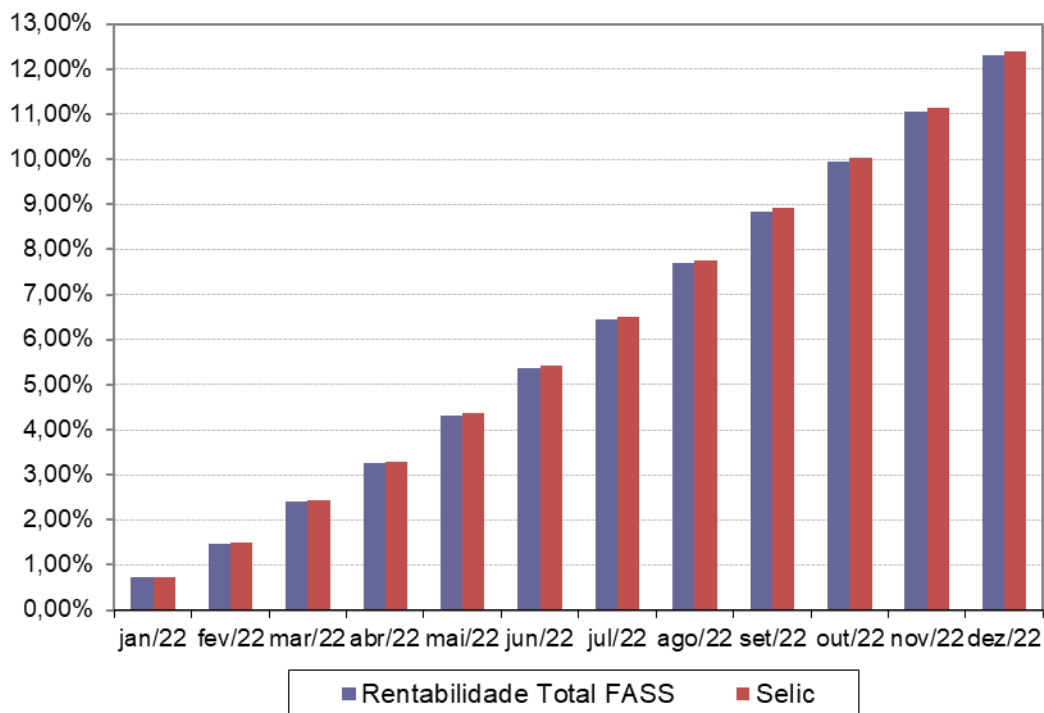
FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	dez/22	Acum. Ano	dez/22	Acum. 2022
FI Caixa PCRJ RF	1,1248%	12,3176%	100,13%	99,41%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,9634%	10,5772%	85,76%	85,36%
Rentabilidade Total FASS	1,1247%	12,3162%	100,12%	99,40%
Selic	1,1233%	12,3910%		

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 dezembro, rentabilidades em relação à meta de rentabilidade ⁽¹⁾ de 93,11% (FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF), 111,11% (Caixa Brasil Referenciado DI LP), 105,75% (FI Caixa Brasil TP RF LP), 106,55% (FI Caixa Aliança TP RF) e 111,59% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal. Desta forma, a carteira registrou um desempenho no mês de 107,12% em relação à meta e de 98,67% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 100,26% e de 99,17% em relação à meta e à taxa Selic, respectivamente.

(1 - Meta de rentabilidade de 6% + IPCA-E)