

Relatório Mensal

2023

Janeiro

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

DIRETORIA DE
INVESTIMENTOS

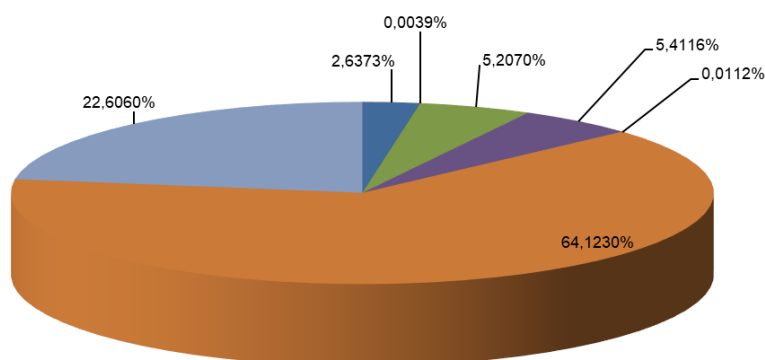
Composição da Carteira

Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)

Valor da Carteira pelo Mercado	
PREVI-RIO	R\$ 72.690.739,10
FUNPREVI	R\$ 1.146.075.874,80
FASS	R\$ 53.692.720,32

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-jan/23)	

Valor por Tipo de Ativo pelo Mercado	
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	R\$ 30.225.680,13
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 44.128,84
FI Caixa Brasil TP RF LP	R\$ 59.676.235,86
FI Caixa Aliança TP RF	R\$ 62.020.866,07
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 128.862,35
Subtotal Valores Mobiliários Funprevi	R\$ 152.095.773,25
Imóveis ⁽¹⁾	R\$ 734.898.323,37
Empréstimos e Financiamentos (Saldo Devedor-jan/23)	R\$ 259.081.778,18
Total Carteira Funprevi	R\$ 1.146.075.874,80

Valor Presente dos Recebíveis de Royalties	
Valor Presente (31/12/2022) ⁽²⁾	R\$ 8.705.966.906,76

Aluguéis Recebidos	
Janeiro/2023	R\$ 4.730.627,16

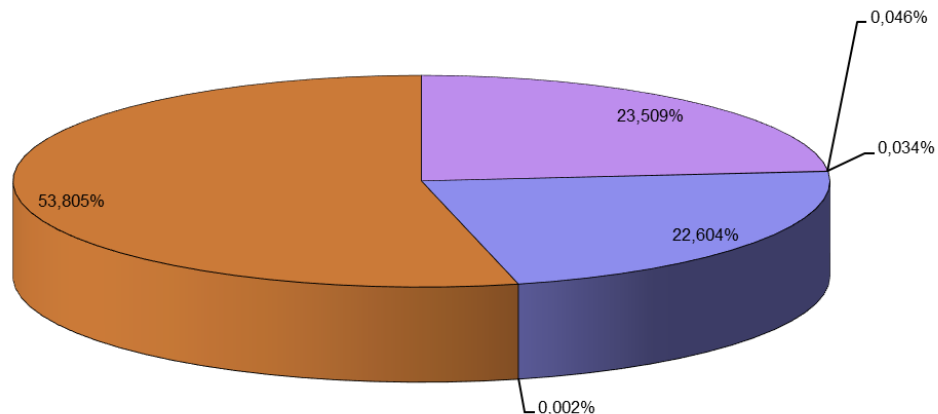
(1) Fonte: Balancete de verificação de janeiro/2023 emitido em 28/02/2023.

(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

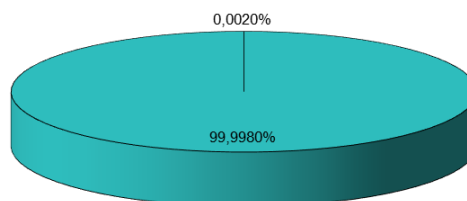


FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	FI Caixa PCRJ RF
Ações	Imóveis

Valor da Carteira	
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R\$ 17.089.104,25
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 25.056,04
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	R\$ 33.294,08
FI Caixa PCRJ RF	R\$ 16.430.787,43
Ações	R\$ 1.528,70
Subtotal Valores Mobiliários Previ-Rio	R\$ 33.579.770,50
Imóveis ⁽¹⁾	R\$ 39.110.968,60
Total Carteira Previ-Rio	R\$ 72.690.739,10

(1) Fonte: Balancete de verificação de janeiro/2023 emitido em 28/02/2023.

FASS



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

Valor da Carteira	
FI CAIXA PCRJ RF	R\$ 53.691.650,01
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 1.070,31
Total Carteira FASS	R\$ 53.692.720,32

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

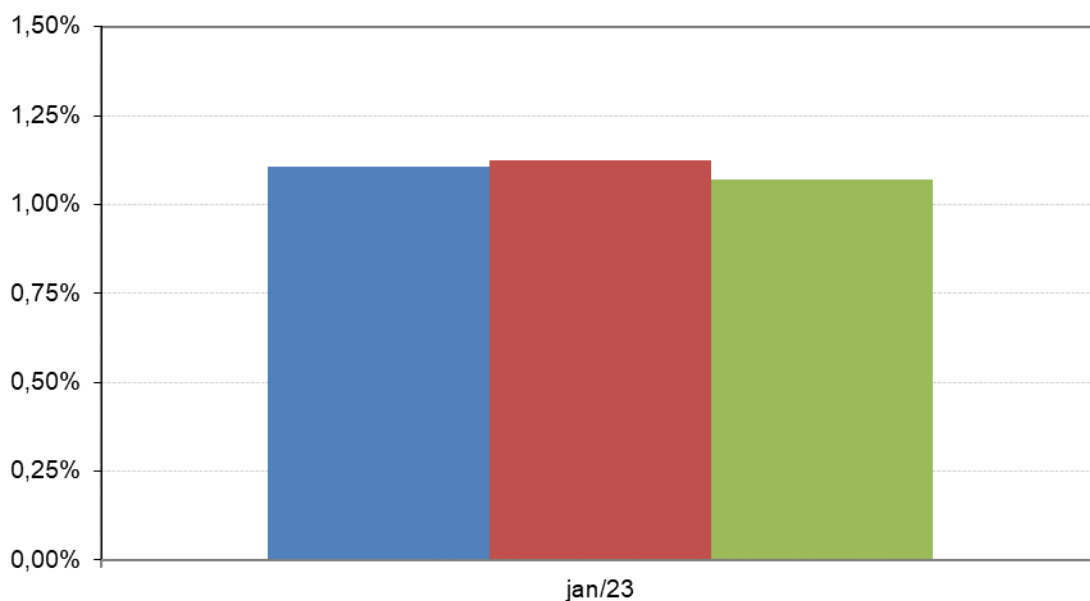
FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	jan/23	Acum. Ano	jan/23	Acum. 2023	jan/23	Acum. 2023
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	1,0942%	1,0942%	102,36%	102,36%	97,41%	97,41%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,9617%	0,9617%	89,96%	89,96%	85,61%	85,61%
FI Caixa Brasil TP RF LP	1,1166%	1,1166%	104,45%	104,45%	99,40%	99,40%
FI Caixa Aliança TP RF	1,1031%	1,1031%	103,19%	103,19%	98,20%	98,20%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	1,1212%	1,1212%	104,89%	104,89%	99,81%	99,81%
Rentabilidade Total Funprevi	1,1066%	1,1066%	103,52%	103,52%	98,51%	98,51%
Meta Rentabilidade	1,0690%	1,0690%				
Selic	1,1233%	1,1233%				

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

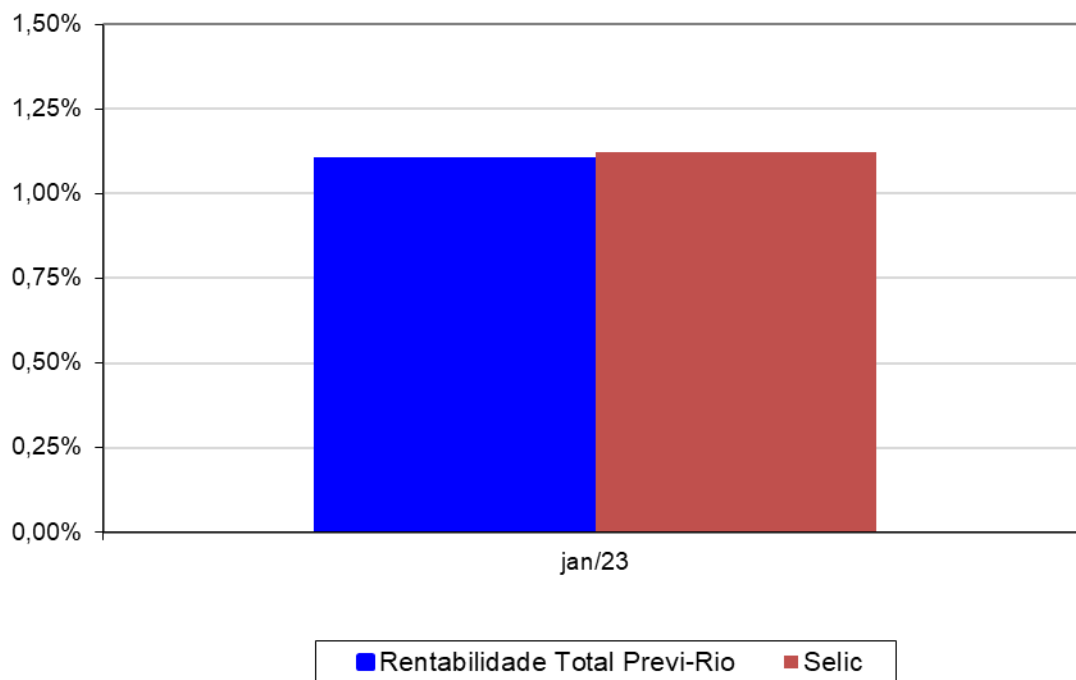
PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	jan/23	Acum. Ano	jan/23	Acum. 2023
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	1,0942%	1,0942%	97,41%	97,41%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,9617%	0,9617%	85,61%	85,61%
FI Caixa PCRJ RF	1,1244%	1,1244%	100,10%	100,10%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	1,1212%	1,1212%	99,81%	99,81%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Previ-Rio	1,1089%	1,1089%	98,71%	98,71%
Selic	1,1233%	1,1233%		

OBSERVAÇÃO:

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

Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

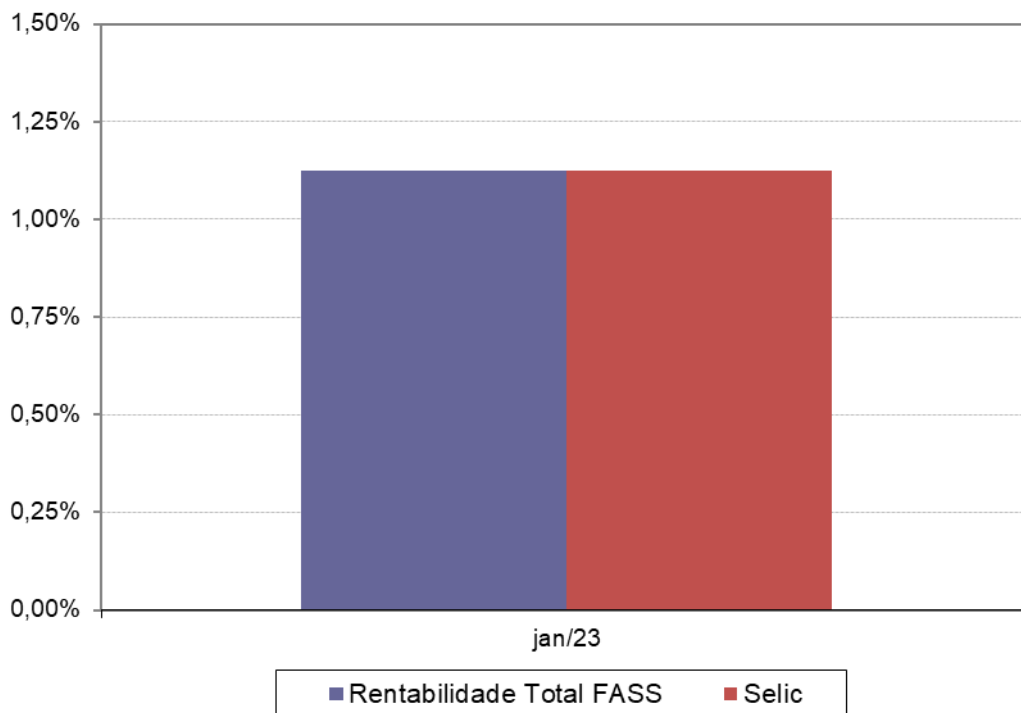
FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	jan/23	Acum. Ano	jan/23	Acum. 2023
FI Caixa PCRJ RF	1,1244%	1,1244%	100,10%	100,10%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,9617%	0,9617%	85,61%	85,61%
Rentabilidade Total FASS	1,1244%	1,1244%	100,10%	100,10%
Selic	1,1233%	1,1233%		

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 89,96% (FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF), 102,36% (Caixa Brasil Referenciado DI LP), 104,45% (FI Caixa Brasil TP RF LP), 103,19% (FI Caixa Aliança TP RF) e 104,89% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal. Desta forma, a carteira registrou um desempenho no mês de 103,52% em relação à meta e de 98,51% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 103,52% e de 98,51% em relação à meta e à taxa Selic, respectivamente.

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