

Relatório Mensal

2023

Fevereiro

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

DIRETORIA DE
INVESTIMENTOS

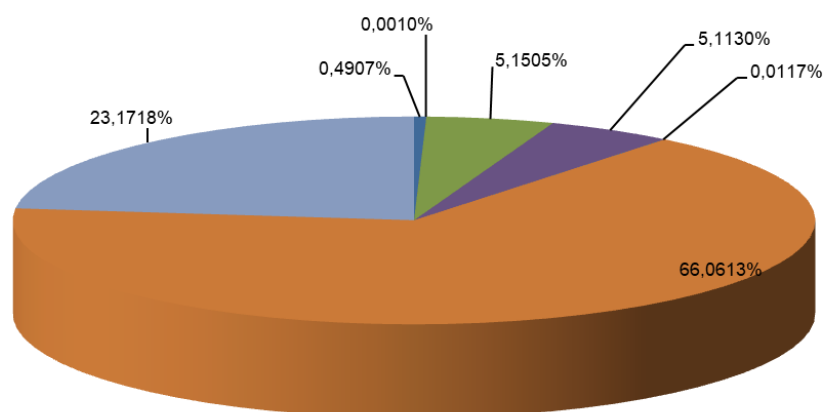
Composição da Carteira

Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)

Valor da Carteira pelo Mercado	
PREVI-RIO	R\$ 70.966.082,11
FUNPREVI	R\$ 1.112.449.824,76
FASS	R\$ 54.975.374,73

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-fev/23)	

Valor por Tipo de Ativo pelo Mercado	
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	R\$ 5.458.834,53
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 10.846,01
FI Caixa Brasil TP RF LP	R\$ 57.296.614,00
FI Caixa Aliança TP RF	R\$ 56.879.930,76
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 130.107,66
Subtotal Valores Mobiliários Funprevi	R\$ 119.776.332,96
Imóveis ⁽¹⁾	R\$ 734.898.323,37
Empréstimos e Financiamentos (Saldo Devedor-fev/23)	R\$ 257.775.168,43
Total Carteira Funprevi	R\$ 1.112.449.824,76

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

Aluguéis Recebidos	
Fevereiro/2023	R\$ 5.142.127,74

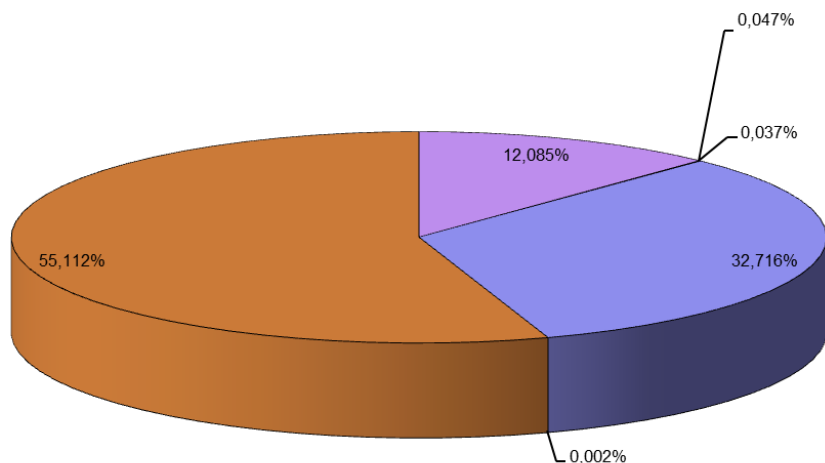
(1) Fonte: Balancete de verificação de fevereiro/2023 emitido em 28/03/2023.

(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

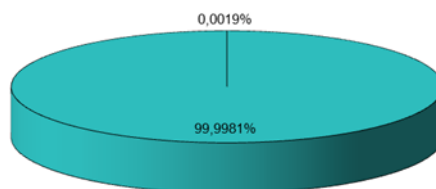


■ FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	■ FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF
■ FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	■ FI Caixa PCRJ RF
■ Ações	■ Imóveis

Valor da Carteira	
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R\$ 8.576.177,54
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 26.590,11
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	R\$ 33.615,83
FI Caixa PCRJ RF	R\$ 23.217.201,33
Ações	R\$ 1.528,70
Subtotal Valores Mobiliários Previ-Rio	R\$ 31.855.113,51
Imóveis ⁽¹⁾	R\$ 39.110.968,60
Total Carteira Previ-Rio	R\$ 70.966.082,11

(1) Fonte: Balancete de verificação de fevereiro/2023 emitido em 28/03/2023.

FASS



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

Valor da Carteira	
FI CAIXA PCRJ RF	R\$ 54.974.333,60
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 1.041,13
Total Carteira FASS	R\$ 54.975.374,73

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

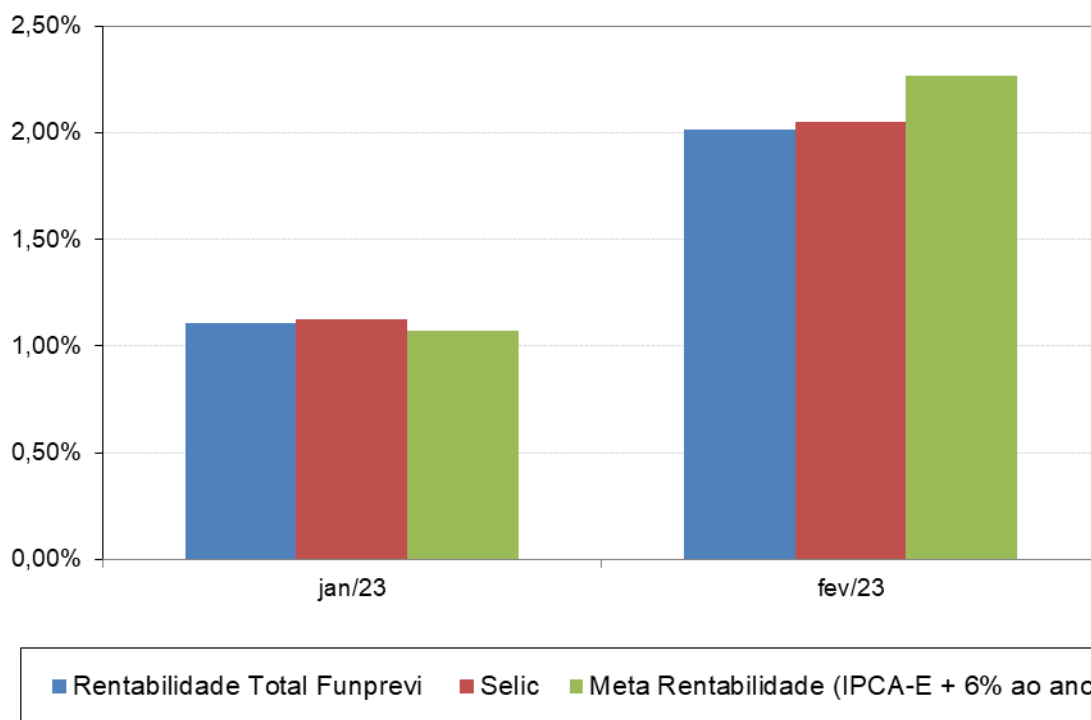
FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	fev/23	Acum. Ano	fev/23	Acum. 2023	fev/23	Acum. 2023
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,7994%	1,9024%	67,44%	83,92%	87,07%	92,72%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,7896%	1,7589%	66,61%	77,59%	86,00%	85,72%
FI Caixa Brasil TP RF LP	0,9298%	2,0568%	78,45%	90,73%	101,27%	100,25%
FI Caixa Aliança TP RF	0,9012%	2,0142%	76,03%	88,85%	98,15%	98,17%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,9664%	2,0984%	81,53%	92,57%	105,25%	102,27%
Rentabilidade Total Funprevi	0,9010%	2,0175%	76,01%	89,00%	98,13%	98,33%
Meta Rentabilidade	1,1853%	2,2670%				
Selic	0,9181%	2,0518%				

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

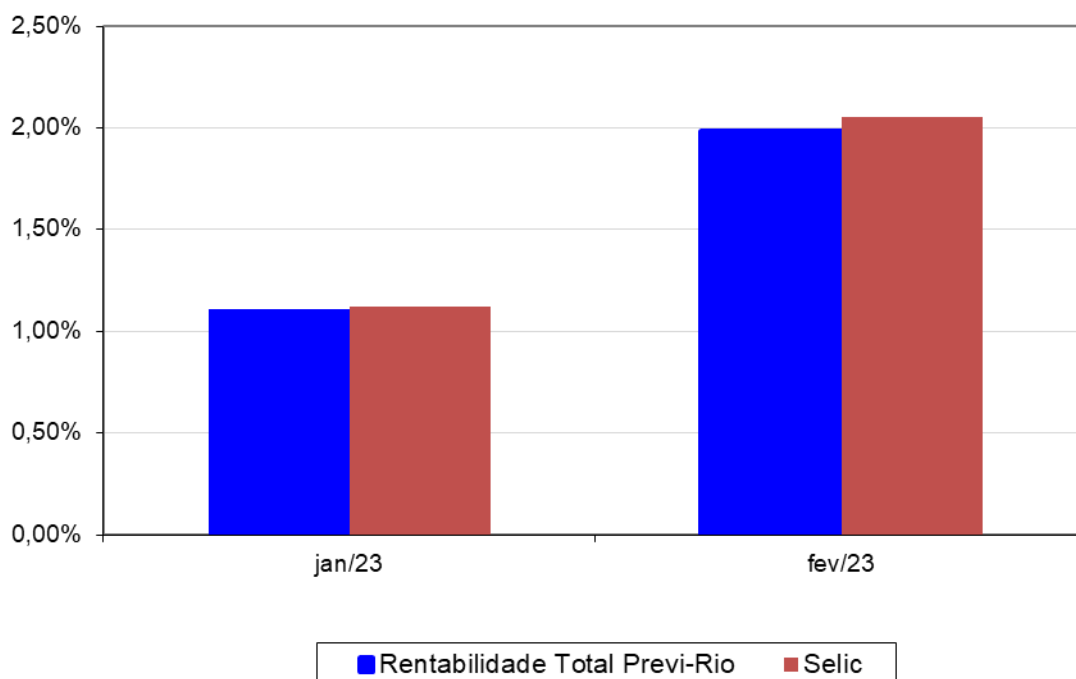
PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	fev/23	Acum. Ano	fev/23	Acum. 2023
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,7994%	1,9024%	87,07%	92,72%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,7896%	1,7589%	86,00%	85,72%
FI Caixa PCRJ RF	0,9188%	2,0536%	100,08%	100,09%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,9664%	2,0984%	105,25%	102,27%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Previ-Rio	0,8670%	1,9855%	94,43%	96,77%
Selic	0,9181%	2,0518%		

OBSERVAÇÃO:

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

Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

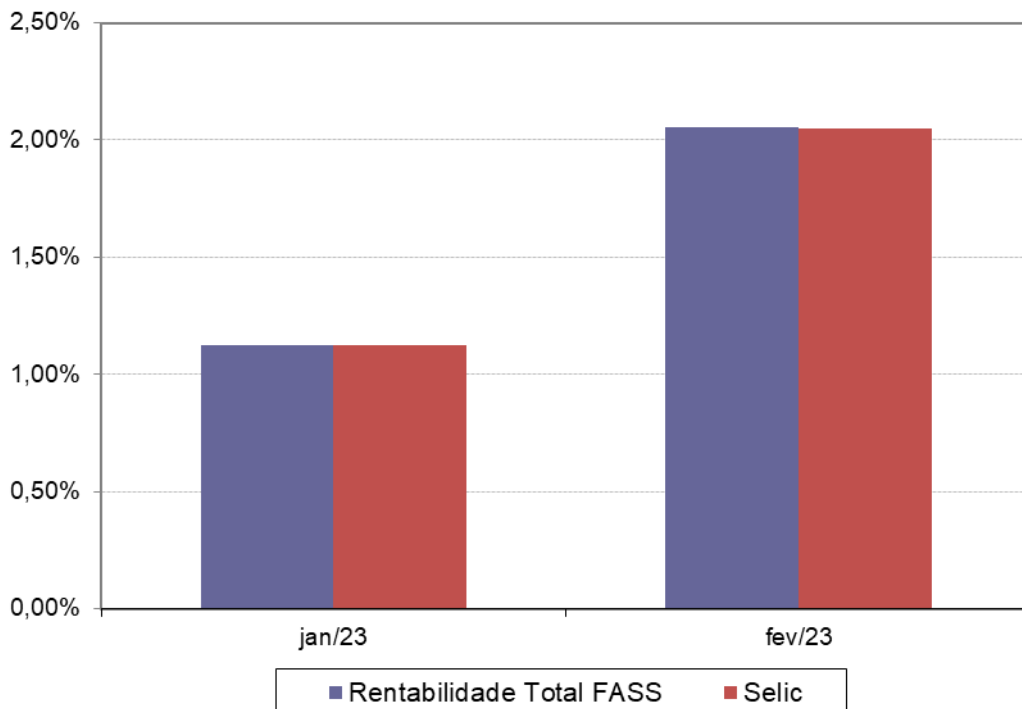
FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	fev/23	Acum. Ano	fev/23	Acum. 2023
FI Caixa PCRJ RF	0,9188%	2,0536%	100,08%	100,09%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,7896%	1,7589%	86,00%	85,72%
Rentabilidade Total FASS	0,9188%	2,0536%	100,08%	100,09%
Selic	0,9181%	2,0518%		

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 fevereiro, rentabilidades em relação à meta de rentabilidade ⁽¹⁾ de 66,61% (FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF), 67,44% (Caixa Brasil Referenciado DI LP), 78,45% (FI Caixa Brasil TP RF LP), 76,03% (FI Caixa Aliança TP RF) e 81,53% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal. Desta forma, a carteira registrou um desempenho no mês de 76,01% em relação à meta e de 98,13% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 89,00% e de 98,33% em relação à meta e à taxa Selic, respectivamente.

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