

Relatório Mensal

2023

Março

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

DIRETORIA DE
INVESTIMENTOS

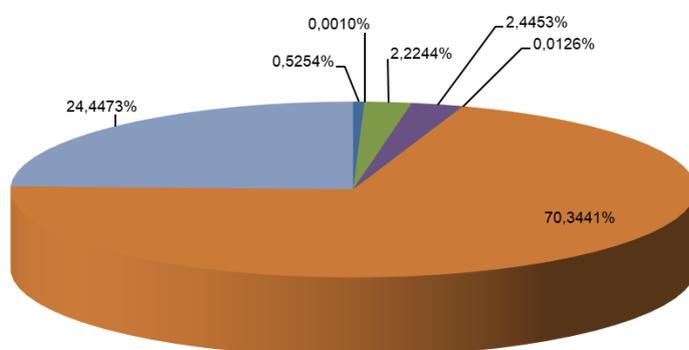
Composição da Carteira

Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)

Valor da Carteira pelo Mercado	
PREVI-RIO	R\$ 77.235.985,57
FUNPREVI	R\$ 1.044.718.987,98
FASS	R\$ 56.394.730,46

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-mar/23)	

Valor por Tipo de Ativo pelo Mercado	
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	R\$ 5.488.445,71
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 10.276,11
FI Caixa Brasil TP RF LP	R\$ 23.238.769,10
FI Caixa Aliança TP RF	R\$ 25.546.004,43
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 131.677,14
Subtotal Valores Mobiliários Funprevi	R\$ 54.415.172,49
Imóveis ⁽¹⁾	R\$ 734.898.323,37
Empréstimos e Financiamentos (Saldo Devedor-mar/23)	R\$ 255.405.492,12
Total Carteira Funprevi	R\$ 1.044.718.987,98

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

Aluguéis Recebidos	
Março/2023	R\$ 5.290.143,76

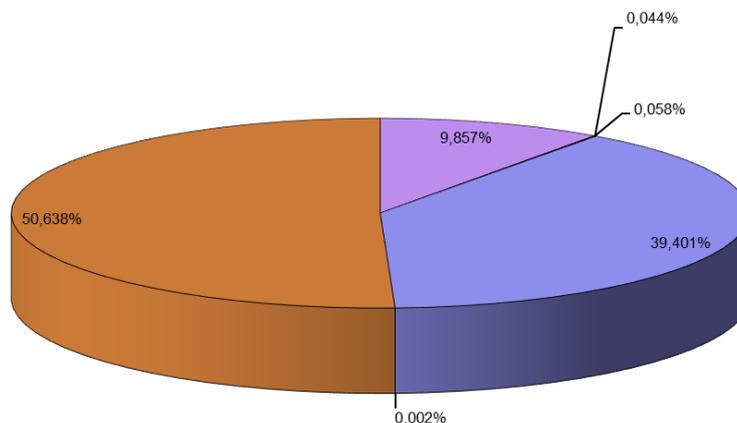
(1) Fonte: Balancete de verificação de março/2023 emitido em 26/04/2023.

(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

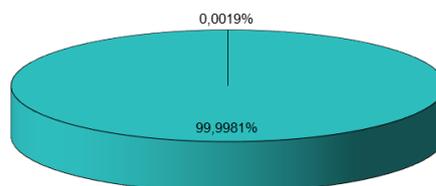


FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	FI Caixa PCRJ RF
Ações	Imóveis

Valor da Carteira	
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R\$ 7.613.297,64
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 44.442,17
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	R\$ 34.021,34
FI Caixa PCRJ RF	R\$ 30.431.727,12
Ações	R\$ 1.528,70
Subtotal Valores Mobiliários Previ-Rio	R\$ 38.125.016,97
Imóveis ⁽¹⁾	R\$ 39.110.968,60
Total Carteira Previ-Rio	R\$ 77.235.985,57

(1) Fonte: Balancete de verificação de março/2023 emitido em 26/04/2023.

FASS



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

Valor da Carteira	
FI CAIXA PCRJ RF	R\$ 56.393.656,54
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 1.073,92
Total Carteira FASS	R\$ 56.394.730,46

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

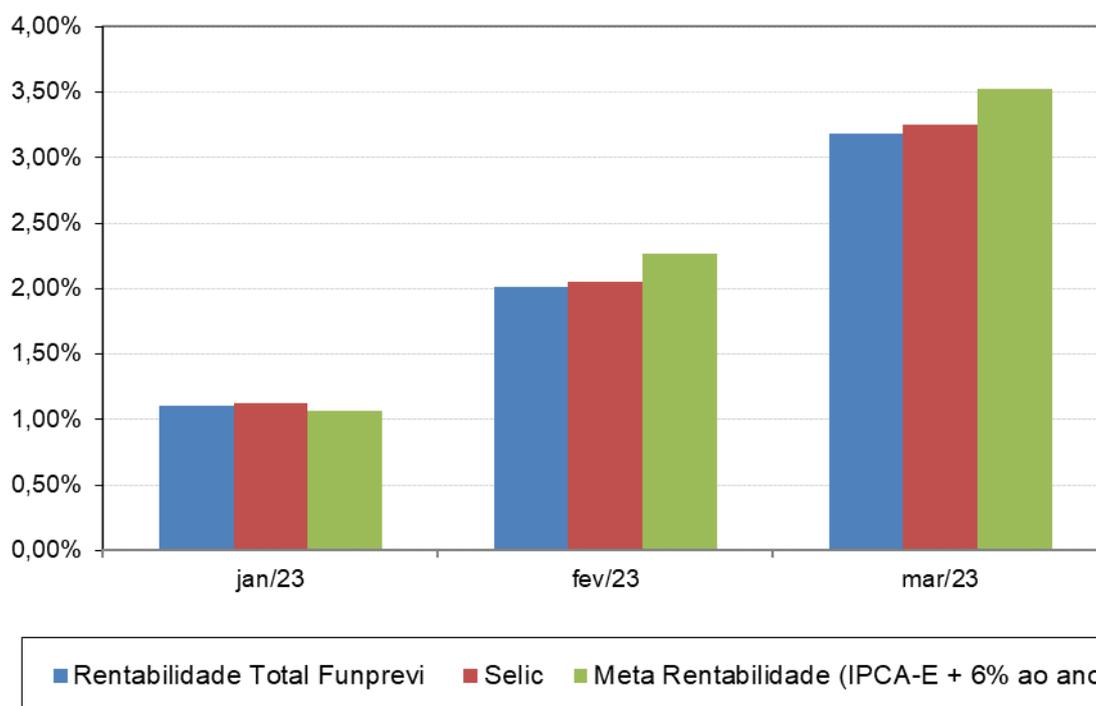
FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	mar/23	Acum. Ano	mar/23	Acum. 2023	mar/23	Acum. 2023
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	1,1508%	3,0751%	93,31%	87,15%	97,97%	94,60%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	1,0105%	2,7872%	81,93%	78,99%	86,03%	85,74%
FI Caixa Brasil TP RF LP	1,1374%	3,2177%	92,22%	91,19%	96,83%	98,99%
FI Caixa Aliança TP RF	1,1531%	3,1906%	93,49%	90,43%	98,17%	98,16%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	1,2063%	3,3300%	97,80%	94,38%	102,69%	102,45%
Rentabilidade Total Funprevi	1,1459%	3,1866%	92,91%	90,31%	97,55%	98,03%
Meta Rentabilidade	1,2334%	3,5283%				
Selic	1,1747%	3,2505%				

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

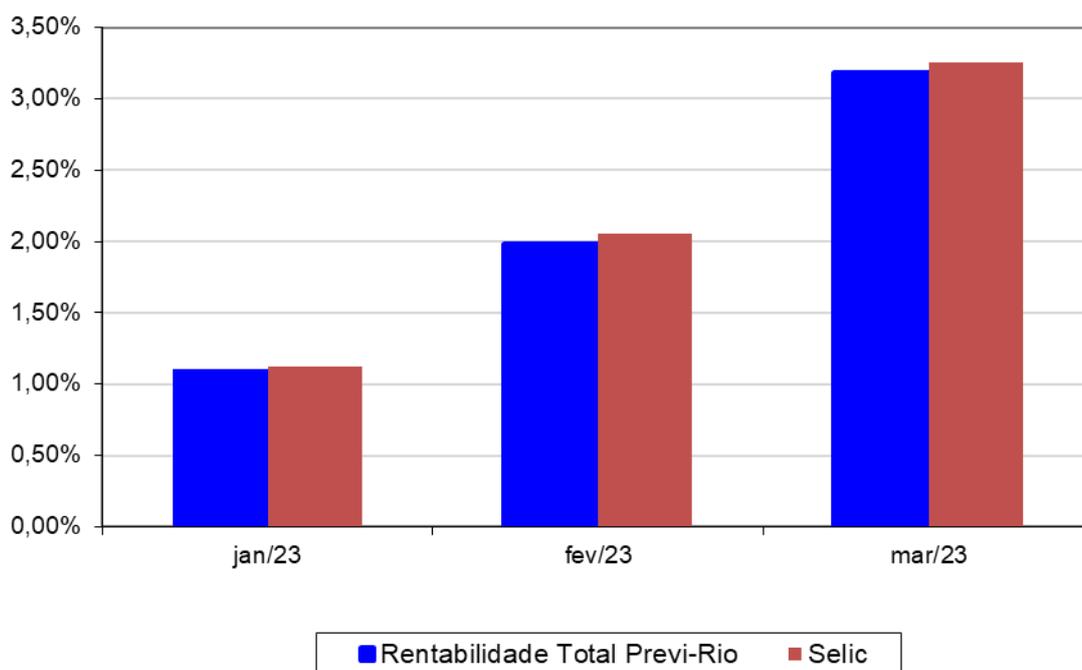
PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	mar/23	Acum. Ano	mar/23	Acum. 2023
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	1,1508%	3,0751%	97,97%	94,60%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	1,0105%	2,7872%	86,03%	85,74%
FI Caixa PCRJ RF	1,1758%	3,2536%	100,10%	100,09%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	1,2063%	3,3300%	102,69%	102,45%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Previ-Rio	1,1704%	3,1791%	99,63%	97,80%
Selic	1,1747%	3,2505%		

OBSERVAÇÃO:

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

Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

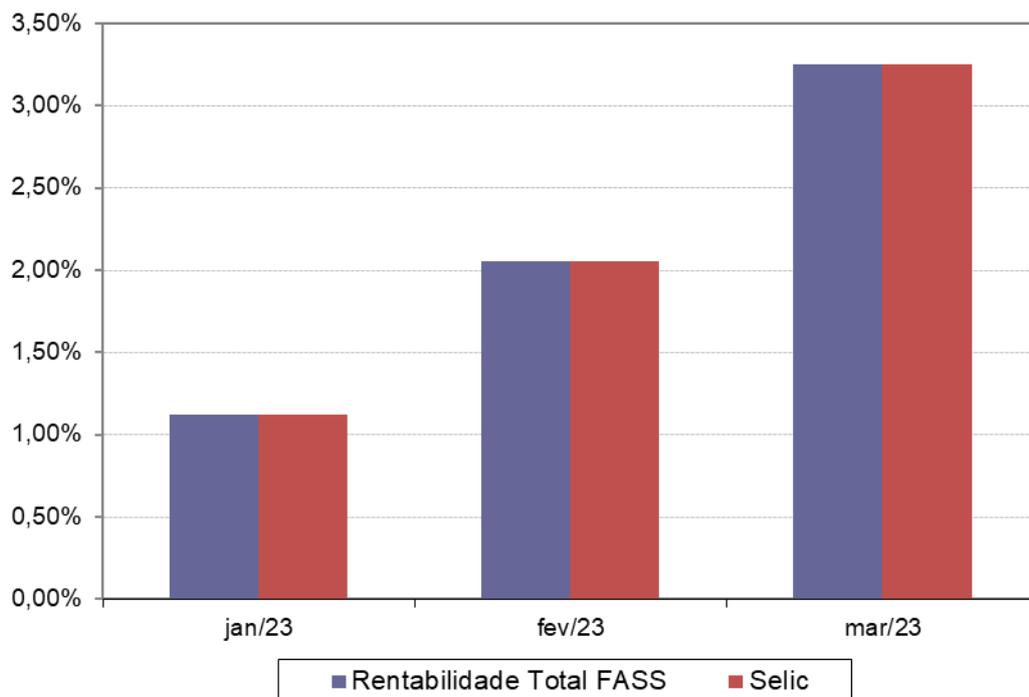
FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	mar/23	Acum. Ano	mar/23	Acum. 2023
FI Caixa PCRJ RF	1,1758%	3,2536%	100,10%	100,09%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	1,0105%	2,7872%	86,03%	85,74%
Rentabilidade Total FASS	1,1758%	3,2536%	100,10%	100,09%
Selic	1,1747%	3,2505%		

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 março, rentabilidades em relação à meta de rentabilidade ⁽¹⁾ de 81,93% (FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF), 93,31% (Caixa Brasil Referenciado DI LP), 92,22% (FI Caixa Brasil TP RF LP), 93,49% (FI Caixa Aliança TP RF) e 97,80% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal. Desta forma, a carteira registrou um desempenho no mês de 92,91% em relação à meta e de 97,55% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 90,31% e de 98,03% em relação à meta e à taxa Selic, respectivamente.

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