

Relatório Mensal

2023

Maio

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

DIRETORIA DE
INVESTIMENTOS

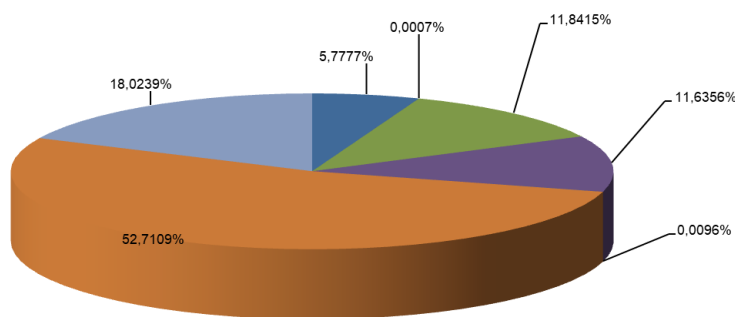
Composição da Carteira

Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)

Valor da Carteira pelo Mercado	
PREVI-RIO	R\$ 83.242.130,57
FUNPREVI	R\$ 1.394.206.253,32
FASS	R\$ 73.434.570,50

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-mai/23)	

Valor por Tipo de Ativo pelo Mercado	
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	R\$ 80.553.693,99
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 10.337,48
FI Caixa Brasil TP RF LP	R\$ 165.094.586,83
FI Caixa Aliança TP RF	R\$ 162.224.880,08
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 134.271,61
Subtotal Valores Mobiliários Funprevi	R\$ 408.017.769,99
Imóveis ⁽¹⁾	R\$ 734.898.323,37
Empréstimos e Financiamentos (Saldo Devedor-mai/23)	R\$ 251.290.159,96
Total Carteira Funprevi	R\$ 1.394.206.253,32

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

Aluguéis Recebidos	
Maio/2023	R\$ 5.009.734,16

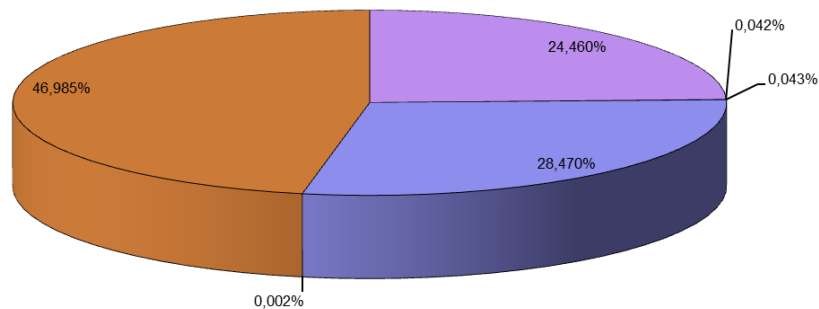
(1) Fonte: Balancete de verificação de maio/2023 emitido em 14/06/2023.

(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

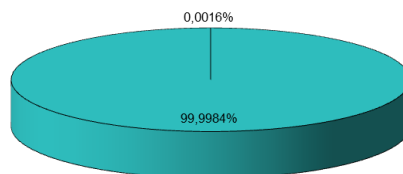


FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	FI Caixa PCRJ RF
Ações	Imóveis

Valor da Carteira	
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R\$ 20.360.776,77
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 35.394,47
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	R\$ 34.691,67
FI Caixa PCRJ RF	R\$ 23.698.770,36
Ações	R\$ 1.528,70
Subtotal Valores Mobiliários Previ-Rio	R\$ 44.131.161,97
Imóveis ⁽¹⁾	R\$ 39.110.968,60
Total Carteira Previ-Rio	R\$ 83.242.130,57

(1) Fonte: Balancete de verificação de maio/2023 emitido em 14/06/2023.

FASS



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

Valor da Carteira	
FI CAIXA PCRJ RF	R\$ 73.433.412,45
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 1.158,05
Total Carteira FASS	R\$ 73.434.570,50

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

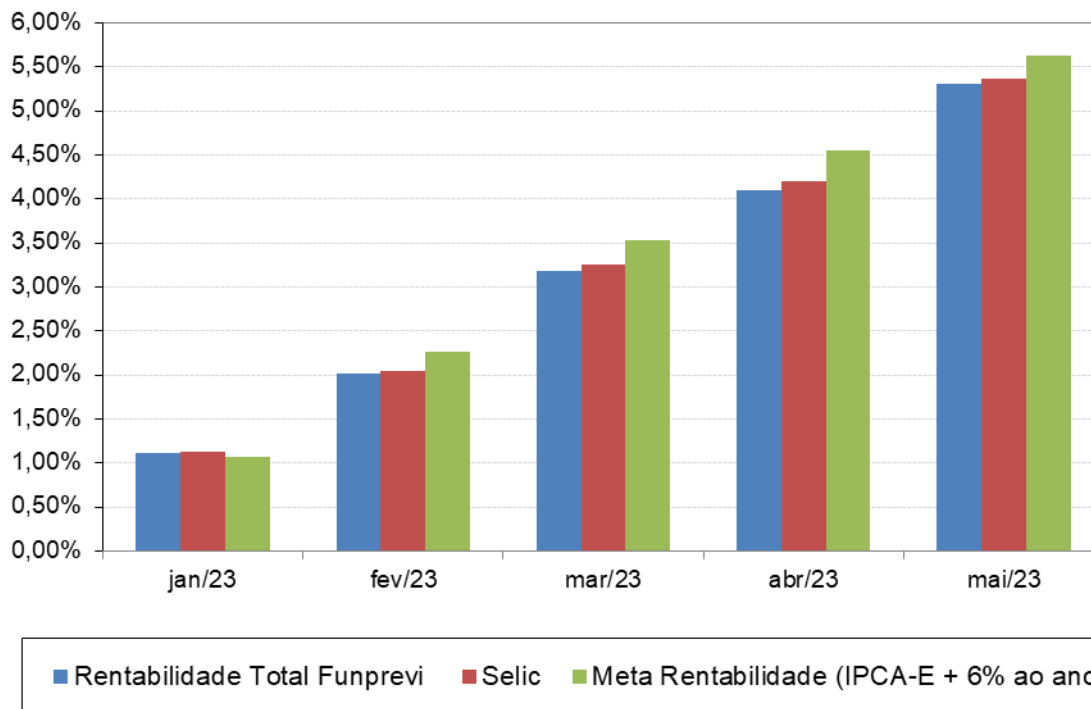
FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	mai/23	Acum. Ano	mai/23	Acum. 2023	mai/23	Acum. 2023
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	1,1800%	5,2489%	114,70%	93,17%	105,05%	97,76%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,9700%	4,6038%	94,29%	81,72%	86,36%	85,75%
FI Caixa Brasil TP RF LP	1,2242%	5,3586%	118,99%	95,12%	108,98%	99,81%
FI Caixa Aliança TP RF	1,1023%	5,2685%	107,14%	93,52%	98,13%	98,13%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	1,1234%	5,3660%	109,20%	95,25%	100,01%	99,94%
Rentabilidade Total Funprevi	1,1602%	5,3021%	112,78%	94,12%	103,29%	98,75%
Meta Rentabilidade	1,0288%	5,6336%				
Selic	1,1233%	5,3690%				

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

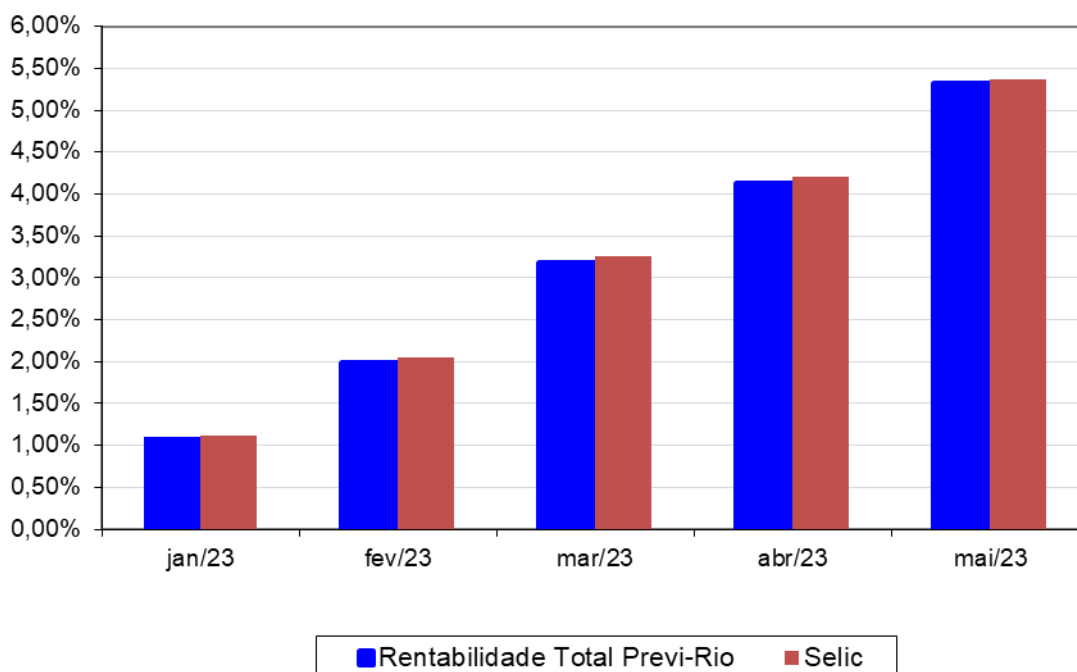
PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	mai/23	Acum. Ano	mai/23	Acum. 2023
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	1,1800%	5,2489%	105,05%	97,76%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,9700%	4,6038%	86,36%	85,75%
FI Caixa PCRJ RF	1,1241%	5,3740%	100,07%	100,09%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	1,1234%	5,3660%	100,01%	99,94%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Previ-Rio	1,1480%	5,3219%	102,19%	99,12%
Selic	1,1233%	5,3690%		

OBSERVAÇÃO:

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

Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

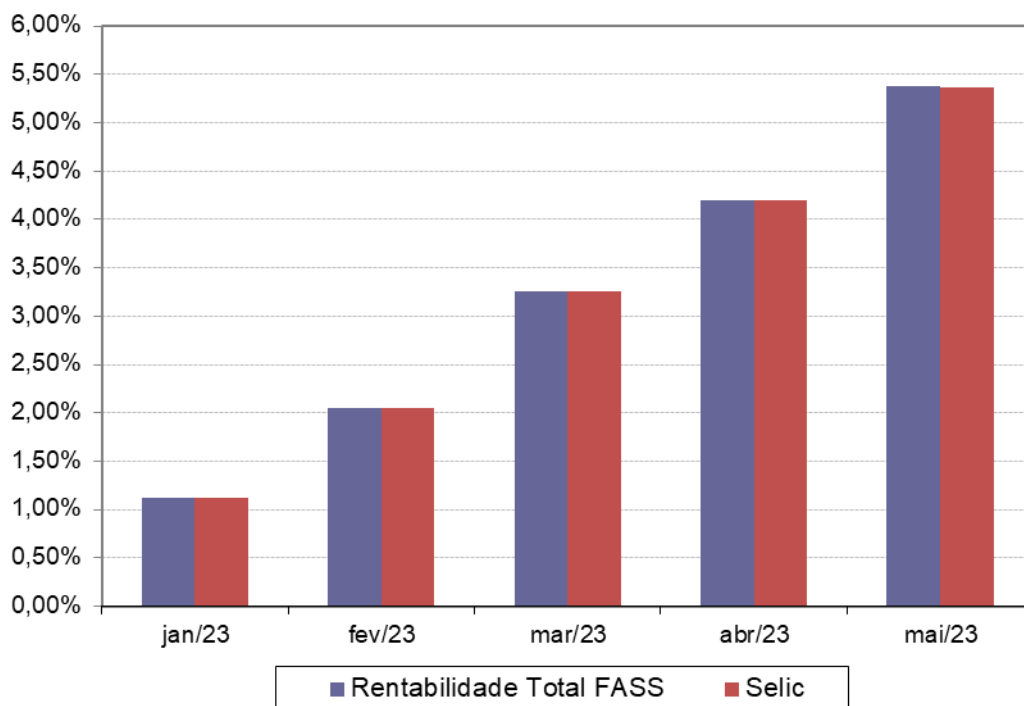
FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	mai/23	Acum. Ano	mai/23	Acum. 2023
FI Caixa PCRJ RF	1,1241%	5,3740%	100,07%	100,09%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,9700%	4,6038%	86,36%	85,75%
Rentabilidade Total FASS	1,1241%	5,3739%	100,07%	100,09%
Selic	1,1233%	5,3690%		

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 maio, rentabilidades em relação à meta de rentabilidade ⁽¹⁾ de 94,29% (FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF), 114,70% (Caixa Brasil Referenciado DI LP), 118,99% (FI Caixa Brasil TP RF LP), 107,14% (FI Caixa Aliança TP RF) e 109,20% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal. Desta forma, a carteira registrou um desempenho no mês de 112,78% em relação à meta e de 103,29% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 94,12% e de 98,75% em relação à meta e à taxa Selic, respectivamente.

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