

Relatório Mensal

2022

Fevereiro

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

DIRETORIA DE
INVESTIMENTOS

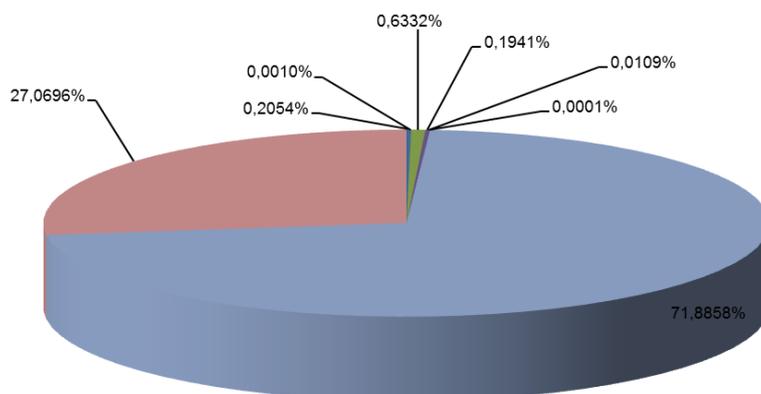
Composição da Carteira

Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)

Valor da Carteira pelo Mercado	
PREVI-RIO	R\$ 61.215.260,23
FUNPREVI	R\$ 1.065.120.577,10
FASS	R\$ 47.290.547,78

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	■ Ações
■ Imóveis	■ Empréstimos e Financiamentos (Saldo Devedor - fev/22)

Valor por Tipo de Ativo pelo Mercado	
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	R\$ 2.187.929,20
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 10.311,98
FI Caixa Brasil TP RF LP	R\$ 6.744.098,77
FI Caixa Aliança TP RF	R\$ 2.067.274,22
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 115.572,17
Ações	R\$ 1.416,00
Subtotal Valores Mobiliários Funprevi	R\$ 11.126.602,34
Imóveis	R\$ 765.670.523,37
Empréstimos e Financiamentos (Saldo Devedor - fev/22)	R\$ 288.323.451,39
Total Carteira Funprevi	R\$ 1.065.120.577,10

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

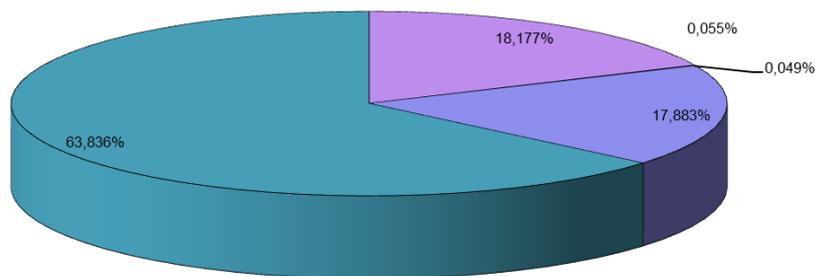
Aluguéis Recebidos	
Fevereiro/2022	R\$ 5.034.724,54

(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

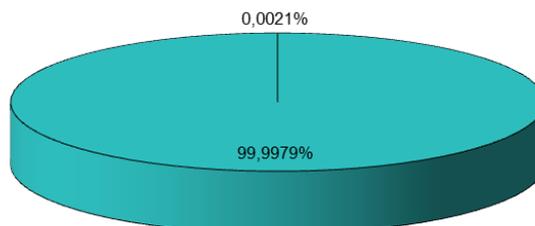
PREVI-RIO



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
Imóveis	

Valor da Carteira	
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R\$ 11.127.325,51
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 33.450,42
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	R\$ 29.860,31
FI Caixa PCRJ RF	R\$ 10.947.355,39
Subtotal Valores Mobiliários Previ-Rio	R\$ 22.137.991,63
Imóveis	R\$ 39.077.268,60
Total Carteira Previ-Rio	R\$ 61.215.260,23

FASS



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

Valor da Carteira	
FI CAIXA PCRJ RF	R\$ 47.289.540,39
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 1.007,39
Total Carteira FASS	R\$ 47.290.547,78

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

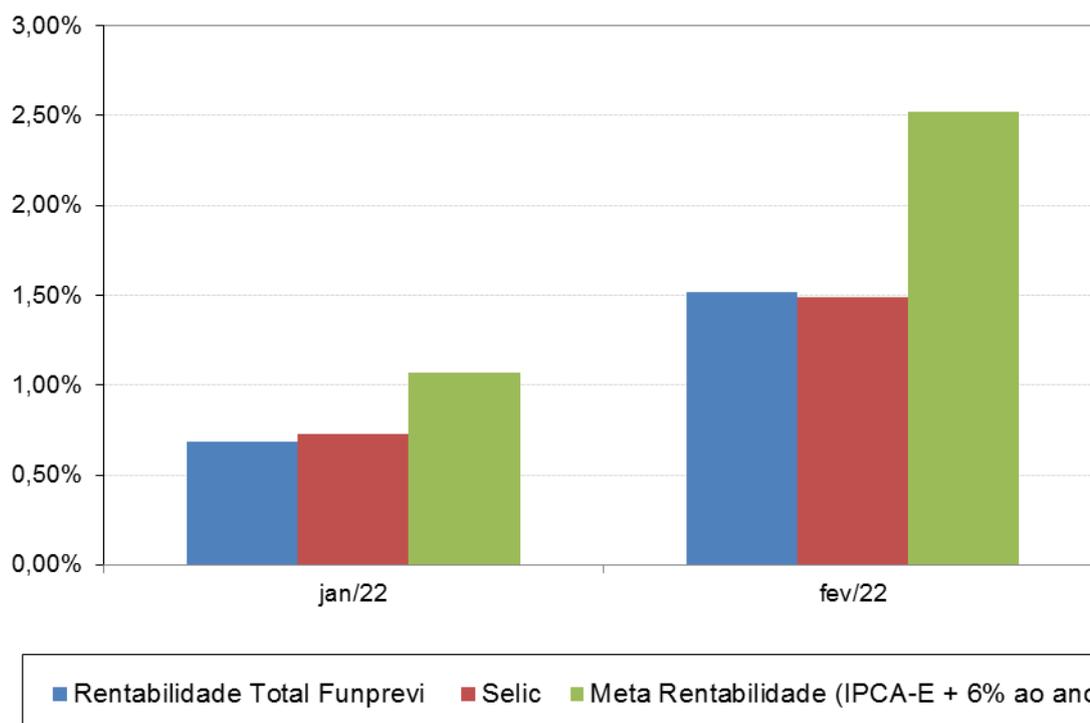
FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	fev/22	Acum. Ano	fev/22	Acum. 2022	fev/22	Acum. 2022
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,8191%	1,6125%	57,02%	63,90%	108,48%	108,01%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,6341%	1,2461%	44,15%	49,38%	83,99%	83,47%
FI Caixa Brasil TP RF LP	0,8771%	1,6781%	61,06%	66,50%	116,16%	112,41%
FI Caixa Aliança TP RF	0,7315%	1,4490%	50,92%	57,42%	96,88%	97,06%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,7248%	1,3382%	50,46%	53,03%	96,00%	89,64%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Funprevi	0,8266%	1,5218%	57,54%	60,31%	109,48%	101,94%
Meta Rentabilidade	1,4364%	2,5234%				
Selic	0,7550%	1,4928%				

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

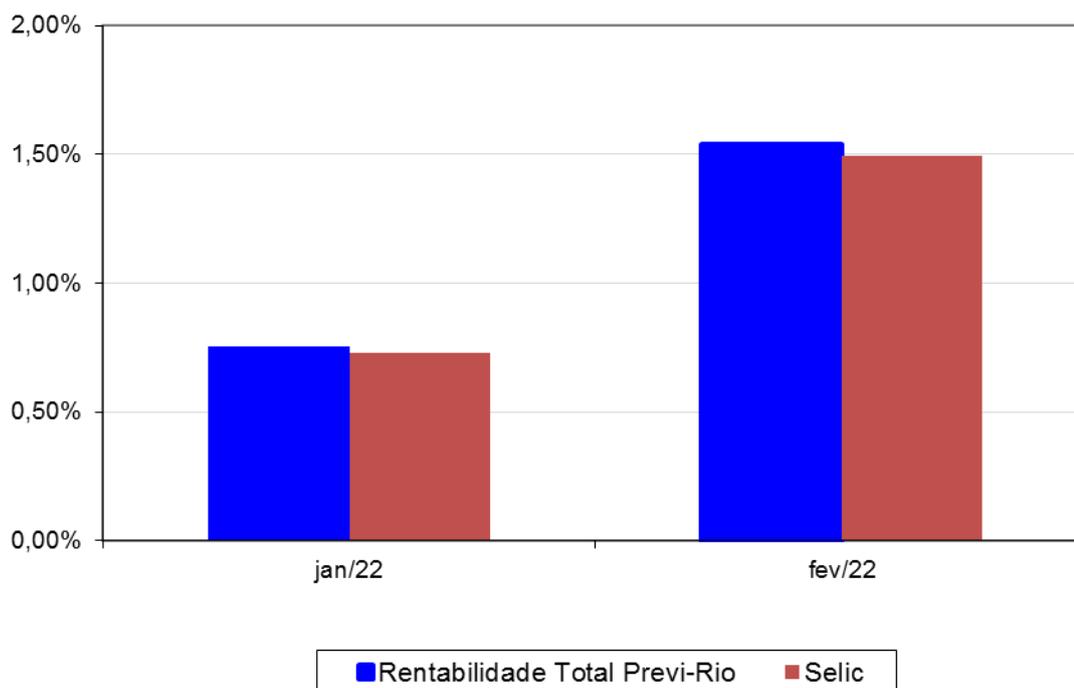
PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	fev/22	Acum. Ano	fev/22	Acum. 2022
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,8191%	1,6125%	108,48%	108,01%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,6341%	1,2461%	83,99%	83,47%
FI Caixa PCRJ RF	0,7442%	1,4766%	98,57%	98,91%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,7248%	1,3382%	96,00%	89,64%
Rentabilidade Total Previ-Rio	0,7804%	1,5408%	103,36%	103,21%
Selic	0,7550%	1,4928%		

OBSERVAÇÃO:

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

Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

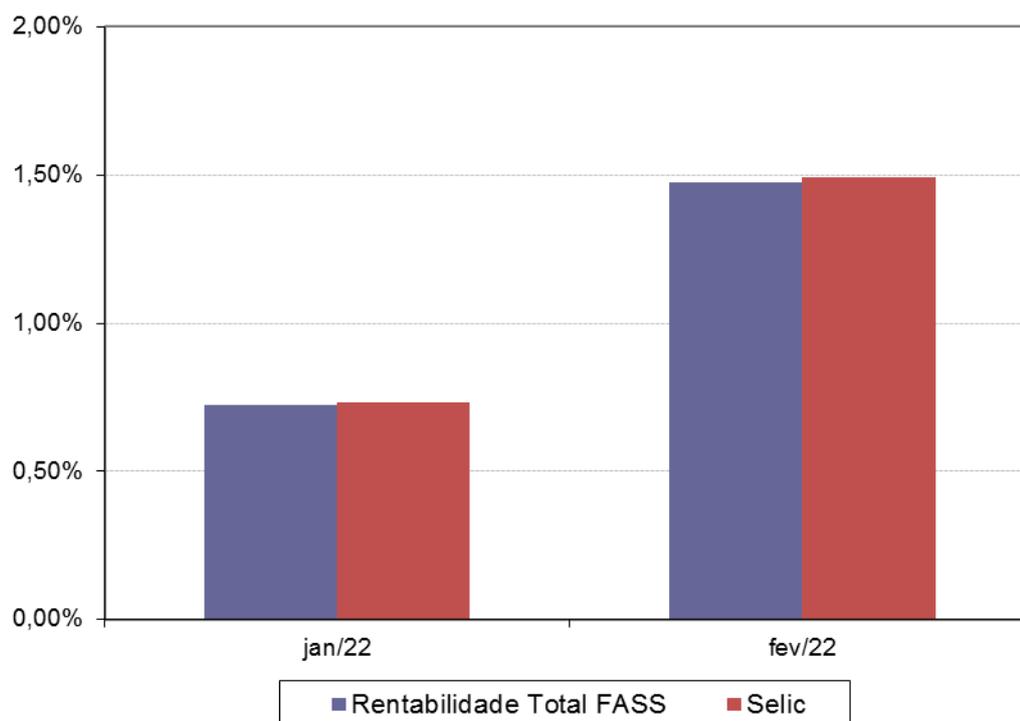
FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	fev/22	Acum. Ano	fev/22	Acum. 2022
FI Caixa PCRJ RF	0,7442%	1,4766%	98,57%	98,91%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,6341%	1,2461%	83,99%	83,47%
Rentabilidade Total FASS	0,7442%	1,4755%	98,57%	98,84%
Selic	0,7550%	1,4928%		

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 44,15% (FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF), 57,02% (Caixa Brasil Referenciado DI LP), 61,06% (FI Caixa Brasil TP RF LP), 50,92% (FI Caixa Aliança TP RF) e 50,46% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal. Desta forma, a carteira registrou um desempenho no mês de 57,54% em relação à meta e de 109,48% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 60,31% e de 101,94% em relação à meta e à taxa Selic, respectivamente.

O comportamento da carteira do FUNPREVI resultou diretamente de dois fatores, a saber: do atual cenário da economia brasileira e das peculiaridades do fluxo de caixa do FUNPREVI. Estas, ressalte-se, restringem sobremaneira as opções de aplicação dos recursos do RPPS.

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