

Relatório Mensal

2022

Maio

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

DIRETORIA DE
INVESTIMENTOS

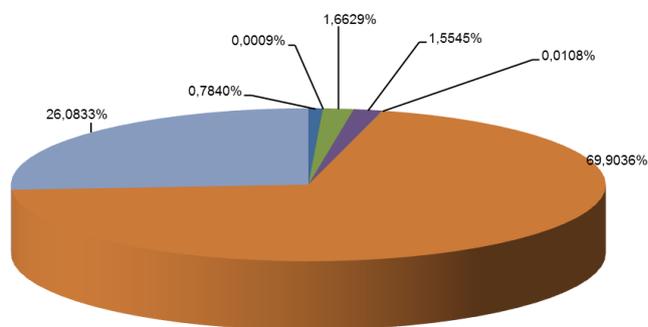
Composição da Carteira

Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)

Valor da Carteira pelo Mercado	
PREVI-RIO	R\$ 63.681.199,46
FUNPREVI	R\$ 1.095.330.344,31
FASS	R\$ 53.002.410,13

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/22)	

Valor por Tipo de Ativo pelo Mercado	
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	R\$ 8.587.216,12
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 10.304,92
FI Caixa Brasil TP RF LP	R\$ 18.214.502,85
FI Caixa Aliança TP RF	R\$ 17.026.380,97
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 118.505,91
Subtotal Valores Mobiliários Funprevi	R\$ 43.956.910,77
Imóveis ⁽¹⁾	R\$ 765.674.823,37
Empréstimos e Financiamentos (Saldo Devedor-mai/22)	R\$ 285.698.610,17
Total Carteira Funprevi	R\$ 1.095.330.344,31

Valor Presente dos Recebíveis de Royalties	
Valor Presente (31/12/2021) ⁽²⁾	R\$ 7.805.056.488,81

Aluguéis Recebidos	
Mai/2022	R\$ 4.863.020,74

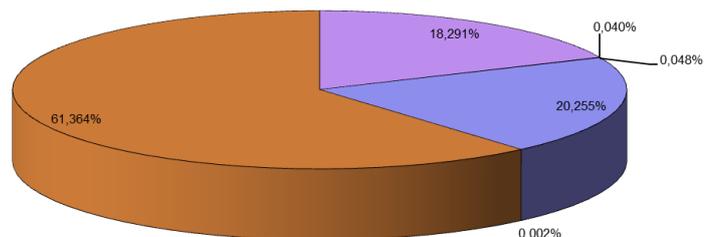
(1) Fonte: Balancete de verificação de maio/2022 emitido em 30/06/2022.

(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

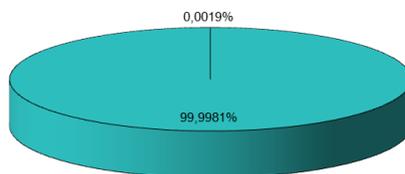
PREVI-RIO



Valor da Carteira	
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R\$ 11.647.790,01
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 25.470,71
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	R\$ 30.618,29
FI Caixa PCRJ RF	R\$ 12.898.523,15
Ações	R\$ 1.528,70
Subtotal Valores Mobiliários Previ-Rio	R\$ 24.603.930,86
Imóveis ⁽¹⁾	R\$ 39.077.268,60
Total Carteira Previ-Rio	R\$ 63.681.199,46

(1) Fonte: Balancete de verificação de maio/2022 emitido em 30/06/2022.

FASS



Valor da Carteira	
FI CAIXA PCRJ RF	R\$ 53.001.395,35
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 1.014,78
Total Carteira FASS	R\$ 53.002.410,13

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

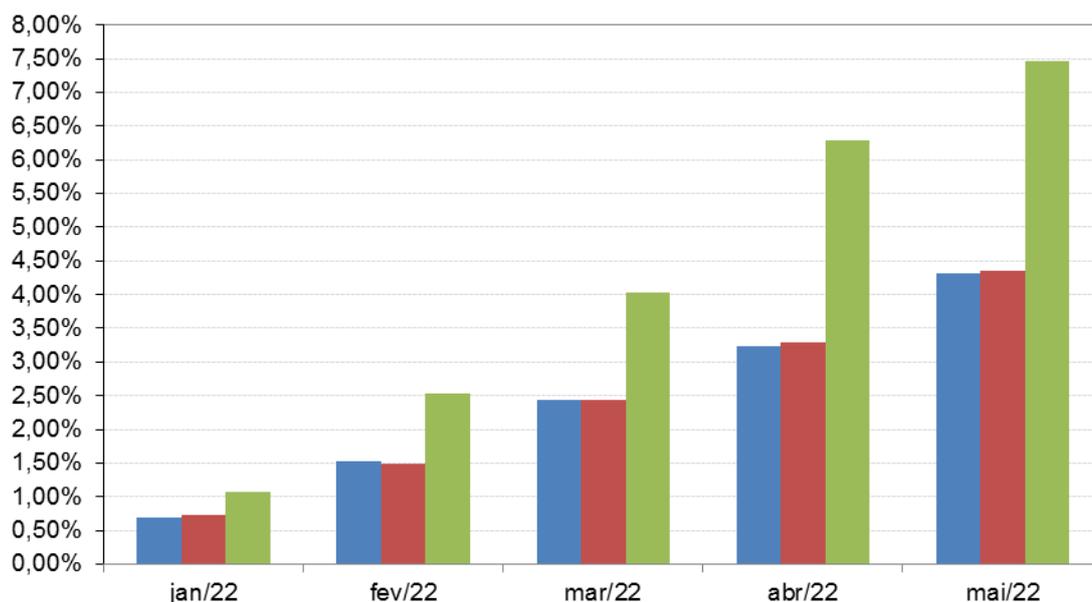
FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	mai/22	Acum. Ano	mai/22	Acum. 2022	mai/22	Acum. 2022
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	1,0765%	4,4883%	97,41%	60,09%	104,05%	103,01%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,8881%	3,6840%	80,37%	49,32%	85,84%	84,55%
FI Caixa Brasil TP RF LP	1,0737%	4,4496%	97,17%	59,57%	103,78%	102,13%
FI Caixa Aliança TP RF	1,0102%	4,2434%	91,42%	56,81%	97,65%	97,39%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,9281%	3,9106%	83,99%	52,36%	89,71%	89,76%
Rentabilidade Total Funprevi	1,0489%	4,3173%	94,91%	57,80%	101,38%	99,09%
Meta Rentabilidade	1,1051%	7,4694%				
Selic	1,0346%	4,3570%				

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

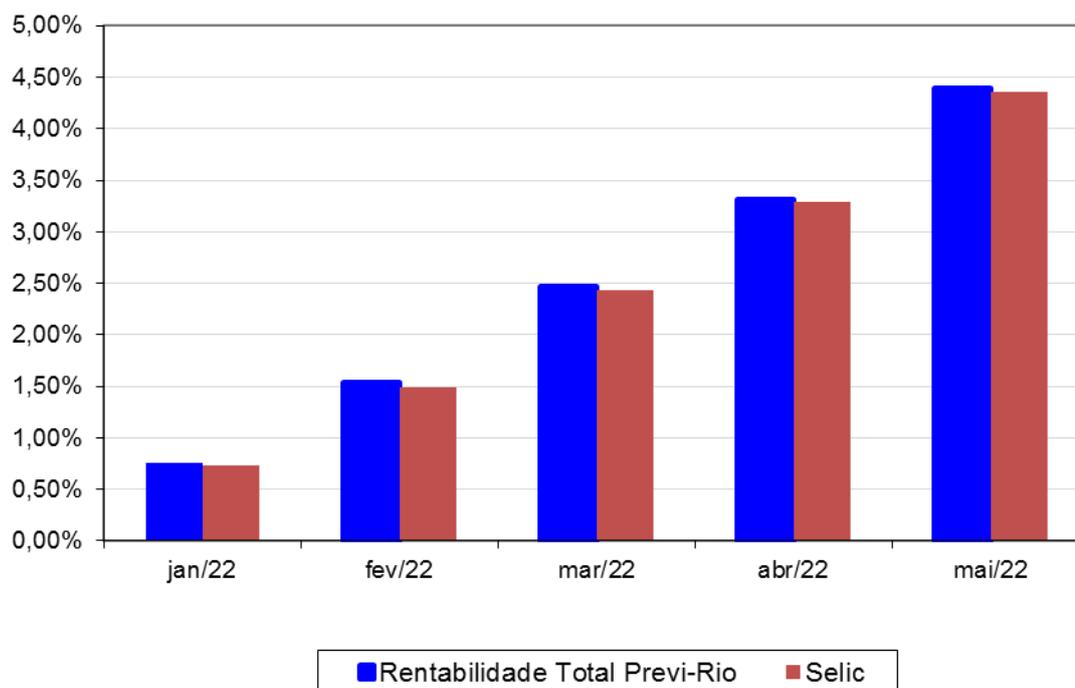
PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	mai/22	Acum. Ano	mai/22	Acum. 2022
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	1,0765%	4,4883%	104,05%	103,01%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,8881%	3,6840%	85,84%	84,55%
FI Caixa PCRJ RF	1,0261%	4,3179%	99,18%	99,10%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,9281%	3,9106%	89,71%	89,76%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Previ-Rio	1,0488%	4,3960%	101,37%	100,90%
Selic	1,0346%	4,3570%		

OBSERVAÇÃO:

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

Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

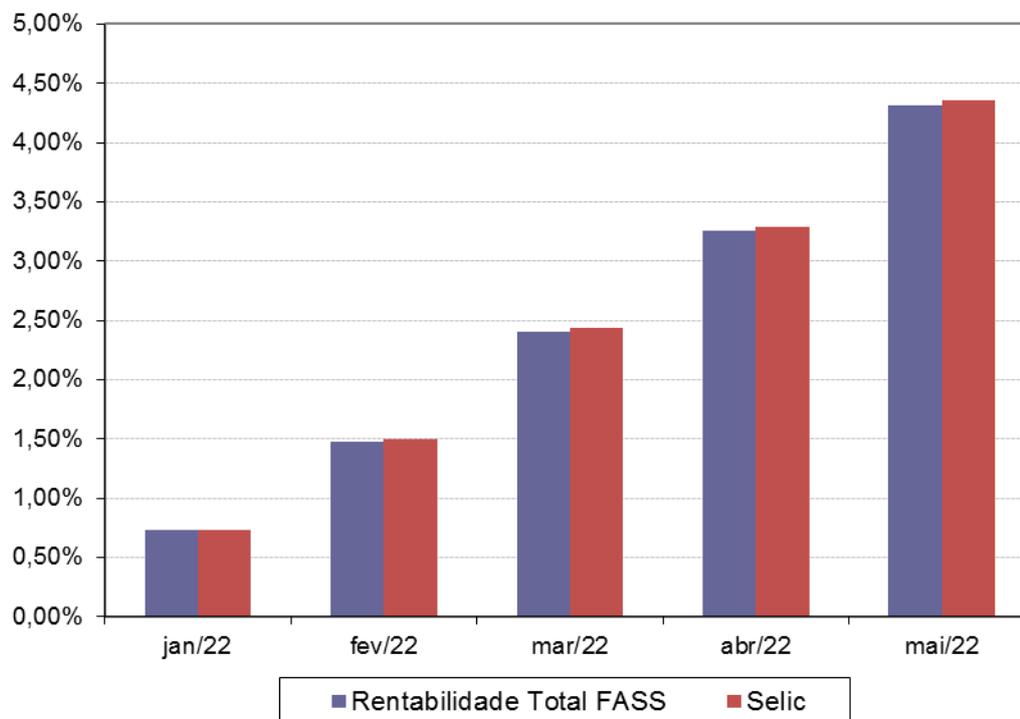
FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	mai/22	Acum. Ano	mai/22	Acum. 2022
FI Caixa PCRJ RF	1,0261%	4,3179%	99,18%	99,10%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,8881%	3,6840%	85,84%	84,55%
Rentabilidade Total FASS	1,0261%	4,3167%	99,18%	99,08%
Selic	1,0346%	4,3570%		

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 80,37% (FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF), 97,41% (Caixa Brasil Referenciado DI LP), 97,17% (FI Caixa Brasil TP RF LP), 91,42% (FI Caixa Aliança TP RF) e 83,99% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal. Desta forma, a carteira registrou um desempenho no mês de 94,91% em relação à meta e de 101,38% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 57,80% e de 99,09% 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)