

Relatório Mensal

2022
Julho

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

DIRETORIA DE INVESTIMENTOS

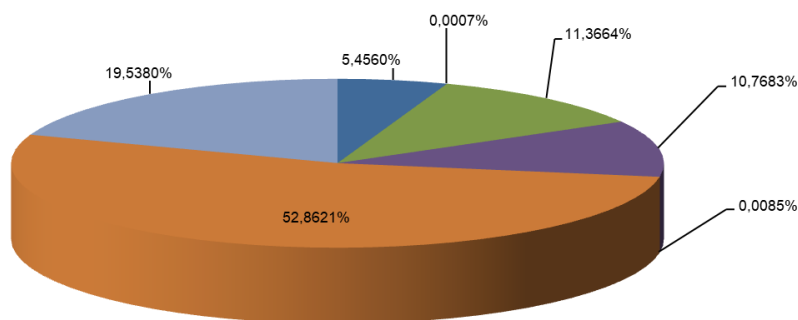
Composição da Carteira

Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)

Valor da Carteira pelo Mercado	
PREVI-RIO	R\$ 71.359.413,69
FUNPREVI	R\$ 1.425.974.506,36
FASS	R\$ 50.367.613,90

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-jul/22)	

Valor por Tipo de Ativo pelo Mercado	
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	R\$ 77.800.810,43
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 10.271,62
FI Caixa Brasil TP RF LP	R\$ 162.082.477,28
FI Caixa Aliança TP RF	R\$ 153.553.101,18
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 120.818,00
Subtotal Valores Mobiliários Funprevi	R\$ 393.567.478,51
Imóveis	R\$ 753.799.823,37
Empréstimos e Financiamentos (Saldo Devedor-jul/22)	R\$ 278.607.204,48
Total Carteira Funprevi	R\$ 1.425.974.506,36

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

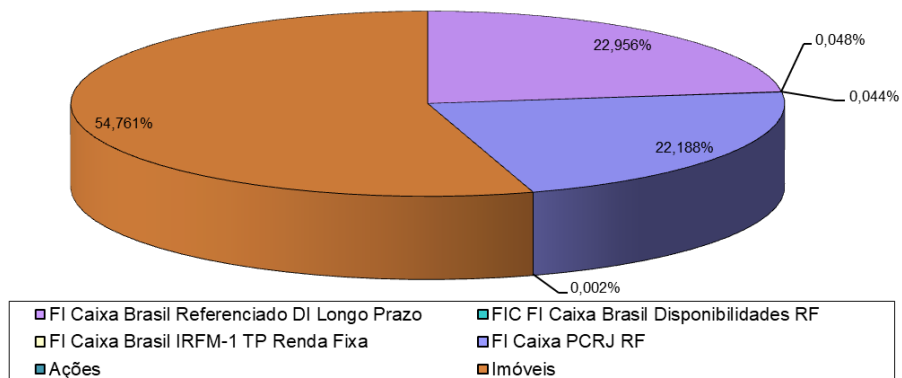
Aluguéis Recebidos	
Julho/2022	R\$ 4.863.020,74

(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

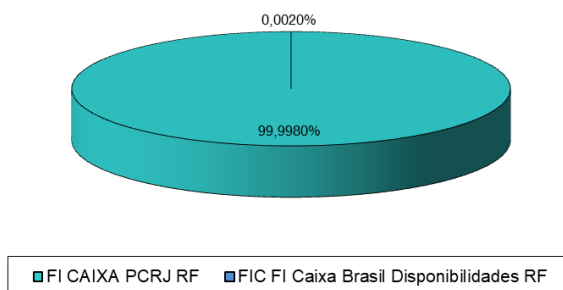
Ativos Mobiliários e Imobiliários

PREVI-RIO



Valor da Carteira	
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R\$ 16.381.277,35
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 34.566,33
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	R\$ 31.215,67
FI Caixa PCRJ RF	R\$ 15.833.557,04
Ações	R\$ 1.528,70
Subtotal Valores Mobiliários Previ-Rio	R\$ 32.282.145,09
Imóveis	R\$ 39.077.268,60
Total Carteira Previ-Rio	R\$ 71.359.413,69

FASS



Valor da Carteira	
FI CAIXA PCRJ RF	R\$ 50.366.610,58
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 1.003,32
Total Carteira FASS	R\$ 50.367.613,90

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

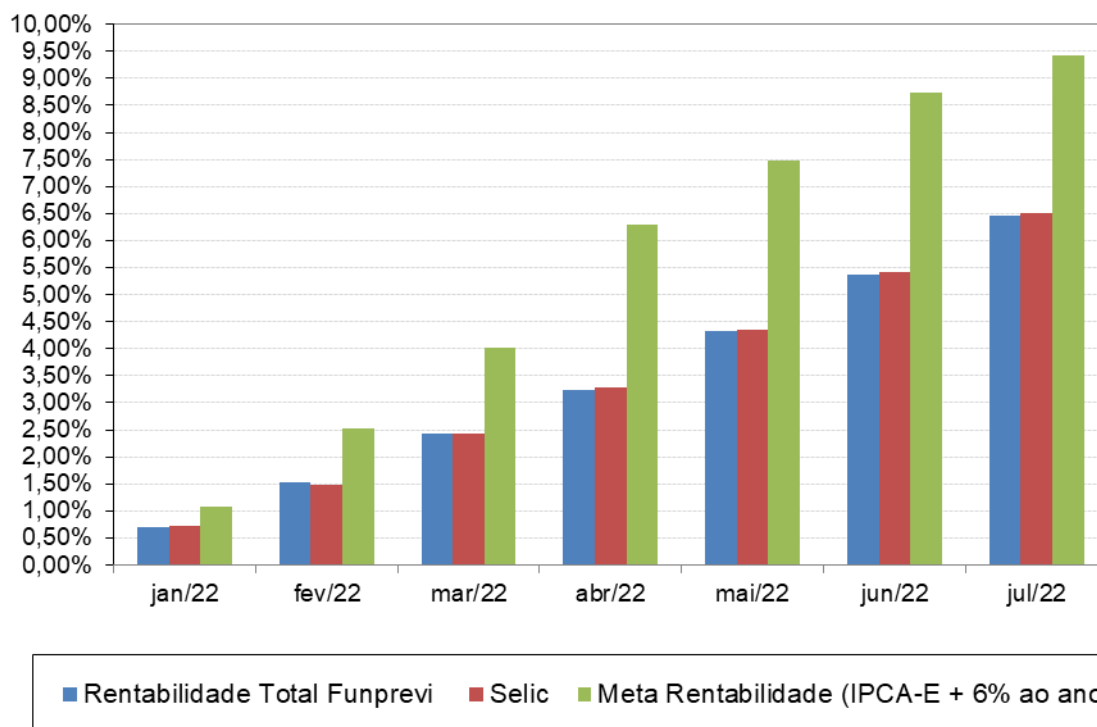
FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	jul/22	Acum. Ano	jul/22	Acum. 2022	jul/22	Acum. 2022
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	1,0069%	6,6598%	162,58%	70,75%	97,30%	102,34%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,9039%	5,5372%	145,95%	58,82%	87,35%	85,09%
FI Caixa Brasil TP RF LP	1,0221%	6,5970%	165,03%	70,08%	98,77%	101,38%
FI Caixa Aliança TP RF	1,0157%	6,3489%	164,00%	67,45%	98,15%	97,56%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	1,0317%	5,9379%	166,58%	63,08%	99,69%	91,25%
Rentabilidade Total Funprevi	1,0170%	6,4523%	164,20%	68,54%	98,27%	99,15%
Meta Rentabilidade	0,6193%	9,4132%				
Selic	1,0349%	6,5074%				

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

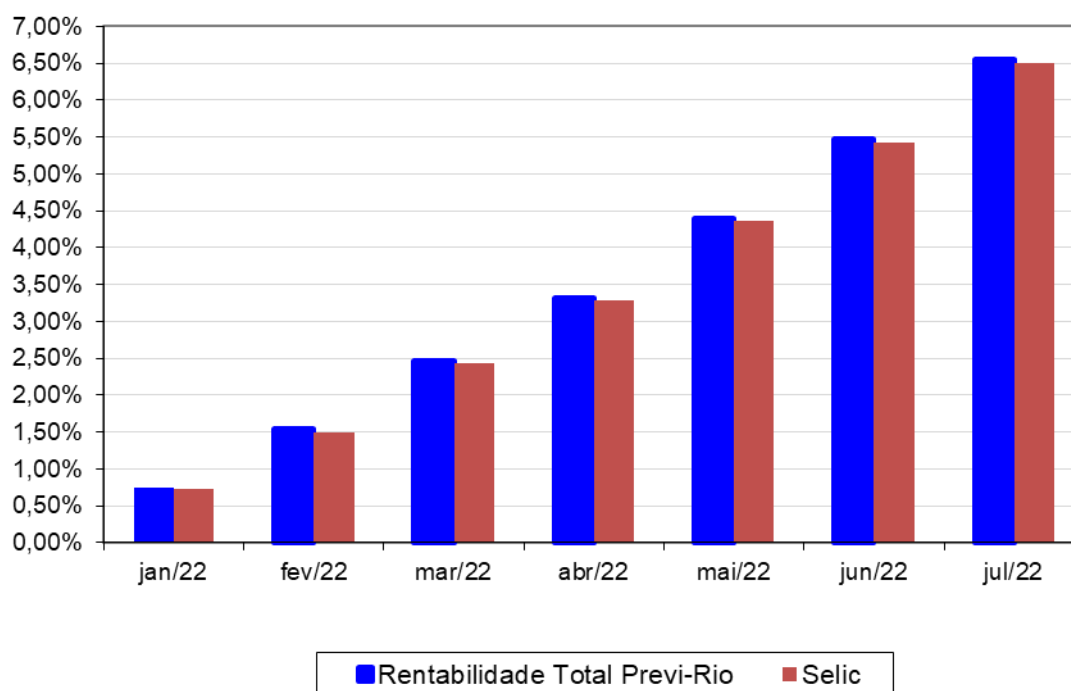
PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	jul/22	Acum. Ano	jul/22	Acum. 2022
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	1,0069%	6,6598%	97,30%	102,34%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,9039%	5,5372%	87,35%	85,09%
FI Caixa PCRJ RF	1,0301%	6,4557%	99,54%	99,20%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	1,0317%	5,9379%	99,69%	91,25%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Previ-Rio	1,0182%	6,5497%	98,39%	100,65%
Selic	1,0349%	6,5074%		

OBSERVAÇÃO:

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

Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

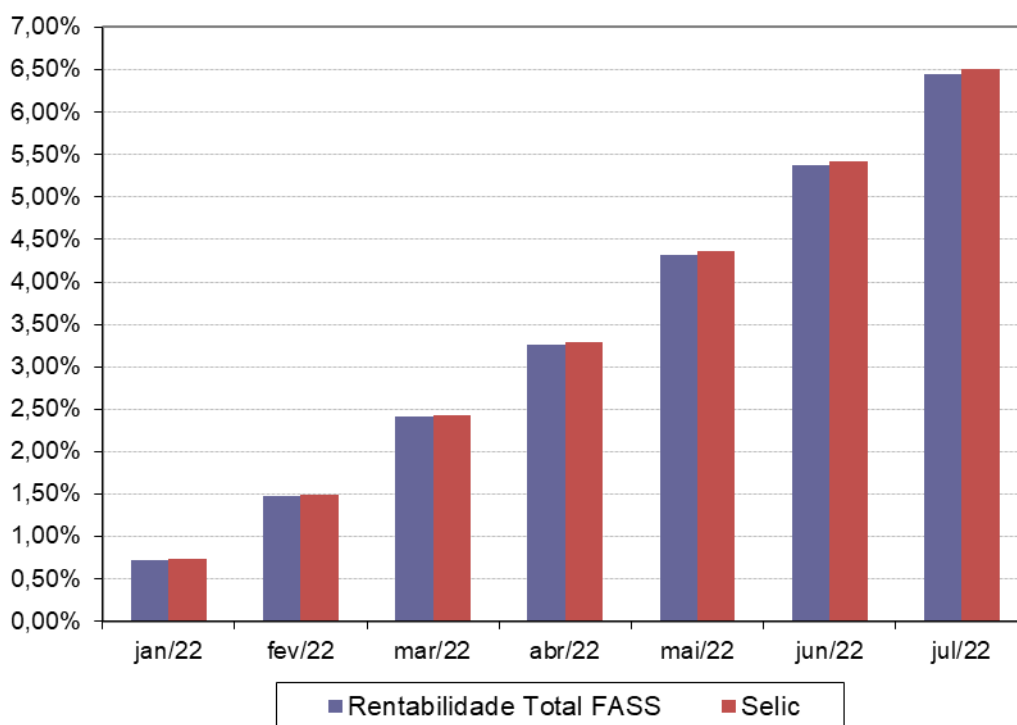
FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	jul/22	Acum. Ano	jul/22	Acum. 2022
FI Caixa PCRJ RF	1,0301%	6,4557%	99,54%	99,20%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,9039%	5,5372%	87,35%	85,09%
Rentabilidade Total FASS	1,0301%	6,4545%	99,54%	99,19%
Selic	1,0349%	6,5074%		

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 julho, rentabilidades em relação à meta de rentabilidade ⁽¹⁾ de 145,95% (FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF), 162,58% (Caixa Brasil Referenciado DI LP), 165,03% (FI Caixa Brasil TP RF LP), 164,00% (FI Caixa Aliança TP RF) e 166,58% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal. Desta forma, a carteira registrou um desempenho no mês de 164,20% em relação à meta e de 98,27% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 68,54% e de 99,15% 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)