

Relatório Mensal

2020
Abril

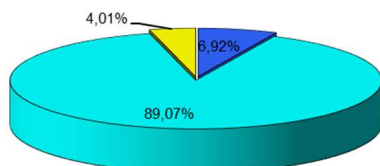
Instituto de Previdência e Assistência do Município do Rio de Janeiro - PREVI-RIO

DIRETORIA DE
INVESTIMENTOS

Composição da Carteira

Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

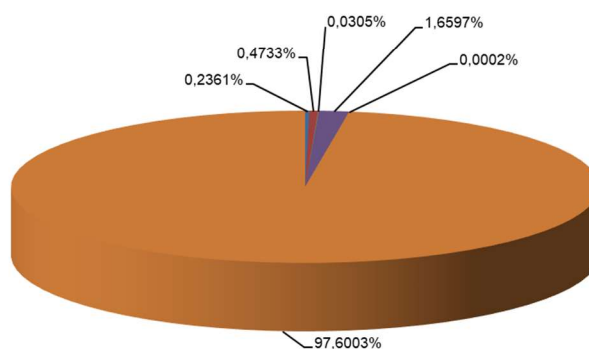
TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)



Valor da Carteira pelo Mercado	
PREVI-RIO	R\$ 66.905.533,03
FUNPREVI	R\$ 861.576.373,73
FASS	R\$ 38.802.110,14



FUNPREVI



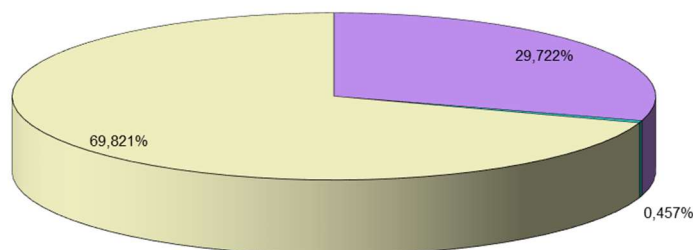
Valor por Tipo de Ativo pelo Mercado	
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	R\$ 2.033.856,29
FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 4.078.222,74
Santander Cash Blue FI RF Referenciado DI	R\$ 262.559,27
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 14.299.219,43
Ações	R\$ 1.416,00
Subtotal Valores Mobiliários Funprevi	R\$ 20.675.273,73
Imóveis ⁽¹⁾	R\$ 840.901.100,00
Total Carteira Funprevi	R\$ 861.576.373,73
Valor Presente dos Recebíveis de Royalties	
Valor Presente (01/01/2020) ⁽¹⁾	R\$ 4.208.148.301,65
Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos	
Saldo (Abril 2020)	R\$ 345.852.657,41
Aluguéis Recebidos	
Abril 2020	R\$ 8.195.105,77

(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

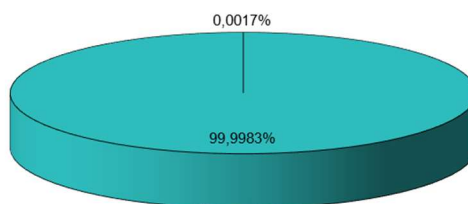
PREVI-RIO



■ FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo ■ FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa □ Imóveis

Valor da Carteira	
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R\$ 19.885.473,64
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	R\$ 305.767,42
Subtotal Valores Mobiliários Previ-Rio	R\$ 20.191.241,06
Imóveis	R\$ 46.714.291,97
Total Carteira Previ-Rio	R\$ 66.905.533,03

FASS



■ FI CAIXA PCRJ RF ■ FI Caixa Brasil Disponibilidades RF

Valor da Carteira	
FI CAIXA PCRJ RF	R\$ 38.801.469,59
FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 640,55
Total Carteira FASS	R\$ 38.802.110,14

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

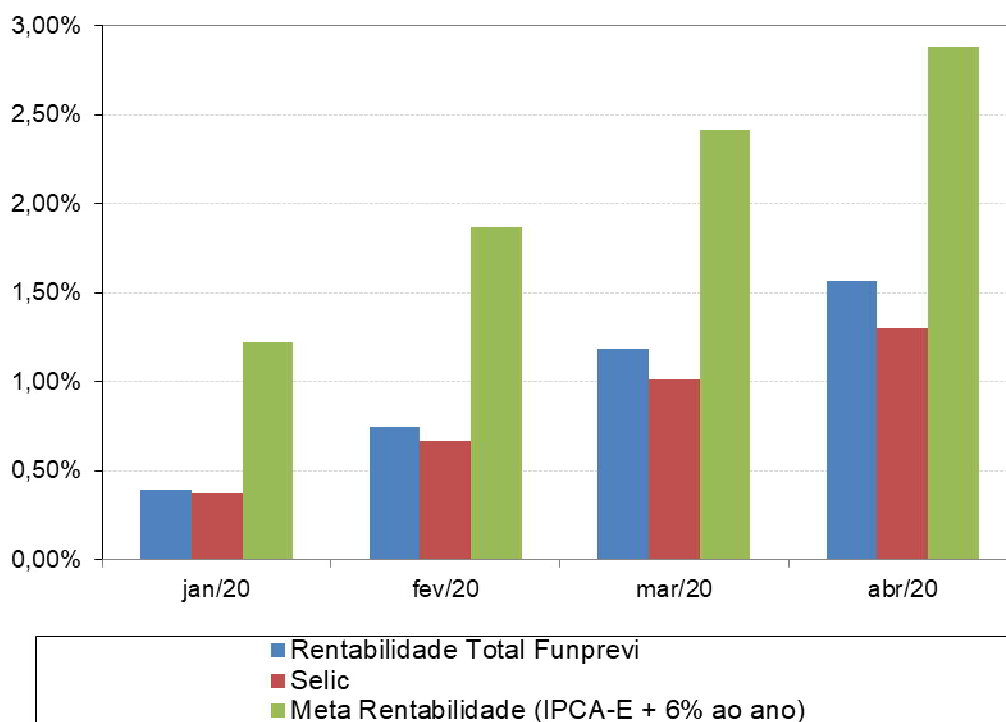
FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	abr/20	Acum. Ano	abr/20	Acum. 2020	abr/20	Acum. 2020
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,00%	0,79%	0,76%	27,50%	1,22%	60,96%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,22%	1,02%	47,92%	35,39%	76,58%	78,45%
Santander Cash Blue FI RF Referenciado DI	0,24%	1,15%	53,52%	39,78%	85,53%	88,19%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,43%	1,82%	95,15%	63,13%	152,06%	139,93%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Funprevi	0,38%	1,57%	82,88%	54,40%	132,45%	120,60%
Meta Rentabilidade	0,46%	2,88%				
Selic	0,28%	1,30%				

OBSERVAÇÕES::

- 1) Aplicações informadas com posição de fechamento do último dia útil.
- 2) Os recursos aplicados no Santander Cash Blue FI RF Referenciado DI estão bloqueados em conta controlada, relacionada à garantia ao atendimento de exigências contratuais que após cumpridas poderão ter o saldo disponível para movimentação.

Rentabilidade Acumulada - Funprevi x Meta Rentabilidade x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

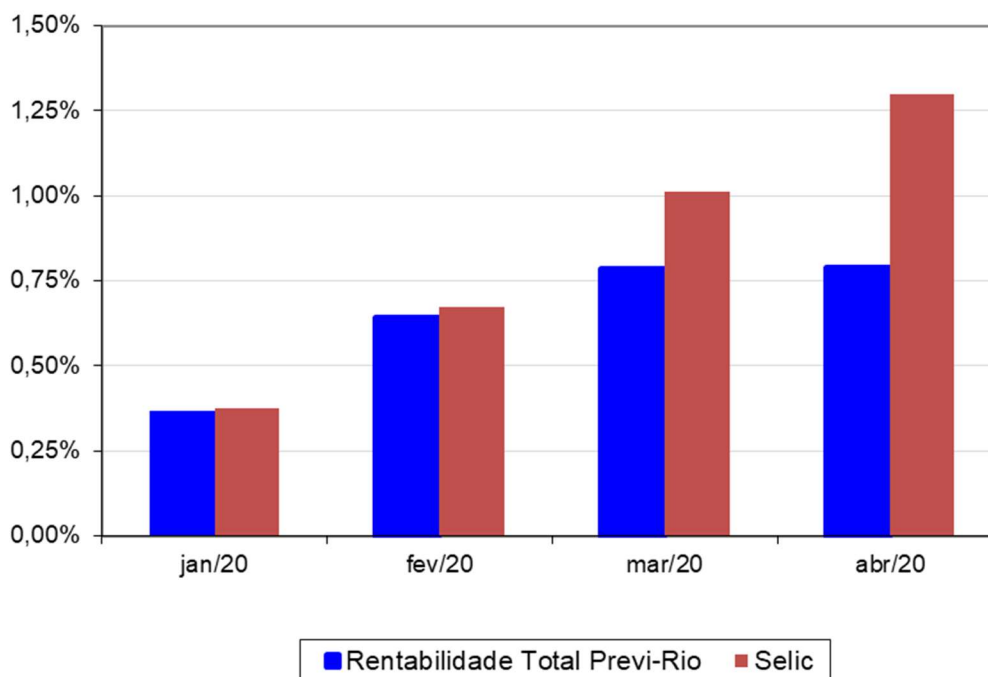
PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	abr/20	Acum. Ano	abr/20	Acum. 2020
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,00%	0,79%	1,22%	60,96%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,22%	1,02%	76,58%	78,45%
Rentabilidade Total Previ-Rio	0,00%	0,79%	0,53%	60,74%
Selic	0,28%	1,30%		

OBSERVAÇÕES:

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

Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

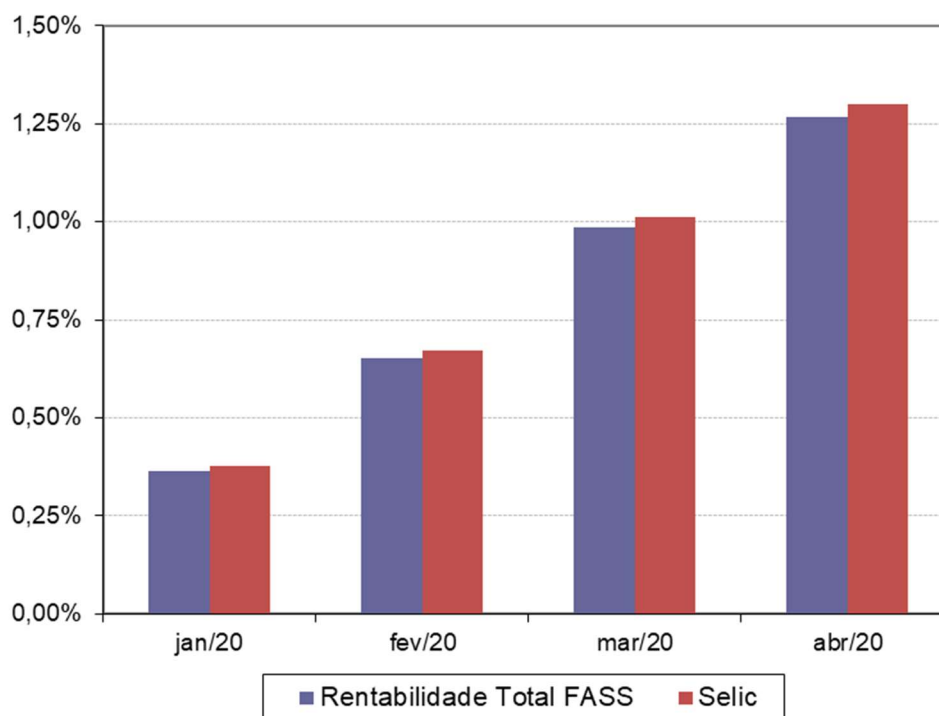
FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	abr/20	Acum. Ano	abr/20	Acum. 2020
FI CAIXA PCRJ RF	0,28%	1,27%	96,90%	97,40%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,22%	1,02%	76,58%	78,45%
Rentabilidade Total FASS	0,28%	1,27%	96,83%	97,39%
Selic	0,28%	1,30%		

OBSERVAÇÕES:

- 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 abril, rentabilidades em relação à meta de rentabilidade ⁽¹⁾ de 47,92% (Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa), 0,76% (Caixa Brasil Referenciado DI LP) e 95,15% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal; e 53,52% no fundo onde está aplicado o recurso bloqueado em conta controlada (Santander Cash Blue RF Referenciado DI FI), relacionado à garantia de liberação total do terreno vendido ao Consulado dos EUA. Desta forma, a carteira registrou um desempenho no mês de 82,88% em relação à meta e de 132,45% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 54,40% e de 120,60% em relação à meta e à taxa Selic, respectivamente.

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