

# Relatório Mensal

2020

# Agosto

---

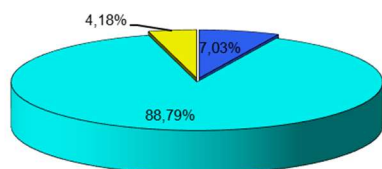
Instituto de Previdência e Assistência do Município do Rio de Janeiro - PREVI-RIO

DIRETORIA DE  
INVESTIMENTOS

# Composição da Carteira

## Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

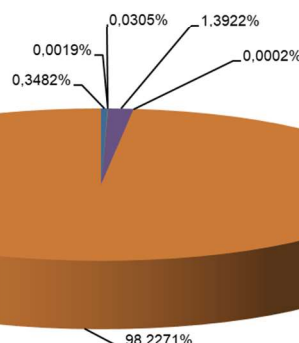
### TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)



Valor da Carteira pelo Mercado	
PREVI-RIO	R\$ 68.732.874,29
FUNPREVI	R\$ 867.647.600,05
FASS	R\$ 40.847.370,86



### FUNPREVI



■ FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	■ FI Caixa Brasil Disponibilidades RF
■ Santander Cash Blue FI RF Referenciado DI	■ FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF
■ Ações	■ Imóveis

Valor por Tipo de Ativo pelo Mercado	
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	R\$ 3.021.165,03
FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 16.284,89
Santander Cash Blue FI RF Referenciado DI	R\$ 264.322,99
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 12.079.511,14
Ações	R\$ 1.416,00
Subtotal Valores Mobiliários Funprevi	R\$ 15.382.700,05
Imóveis	R\$ 852.264.900,00
Total Carteira Funprevi	R\$ 867.647.600,05

Valor Presente dos Recebíveis de Royalties	
Valor Presente (01/01/2020) <sup>(1)</sup>	R\$ 4.208.148.301,65

Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos	
Saldo (Agosto 2020)	R\$ 325.702.739,95

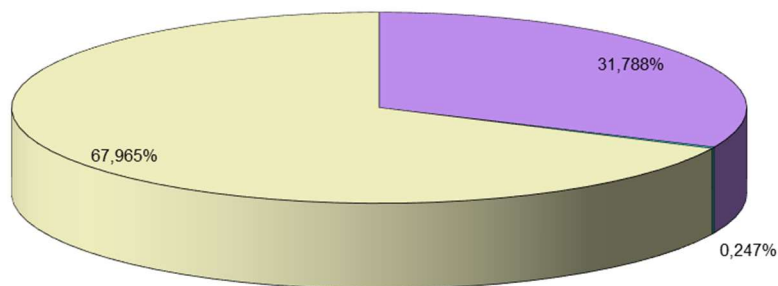
Aluguéis Recebidos	
Agosto 2020	R\$ 4.032.627,58

(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

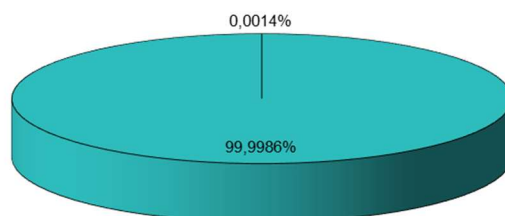
### PREVI-RIO



■ 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\$ 21.848.479,10
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	R\$ 170.103,22
Subtotal Valores Mobiliários Previ-Rio	R\$ 22.018.582,32
Imóveis	R\$ 46.714.291,97
<b>Total Carteira Previ-Rio</b>	<b>R\$ 68.732.874,29</b>

### FASS



■ FI CAIXA PCRJ RF 
 ■ FI Caixa Brasil Disponibilidades RF

Valor da Carteira	
FI CAIXA PCRJ RF	R\$ 40.846.779,01
FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 591,85
<b>Total Carteira FASS</b>	<b>R\$ 40.847.370,86</b>

# Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

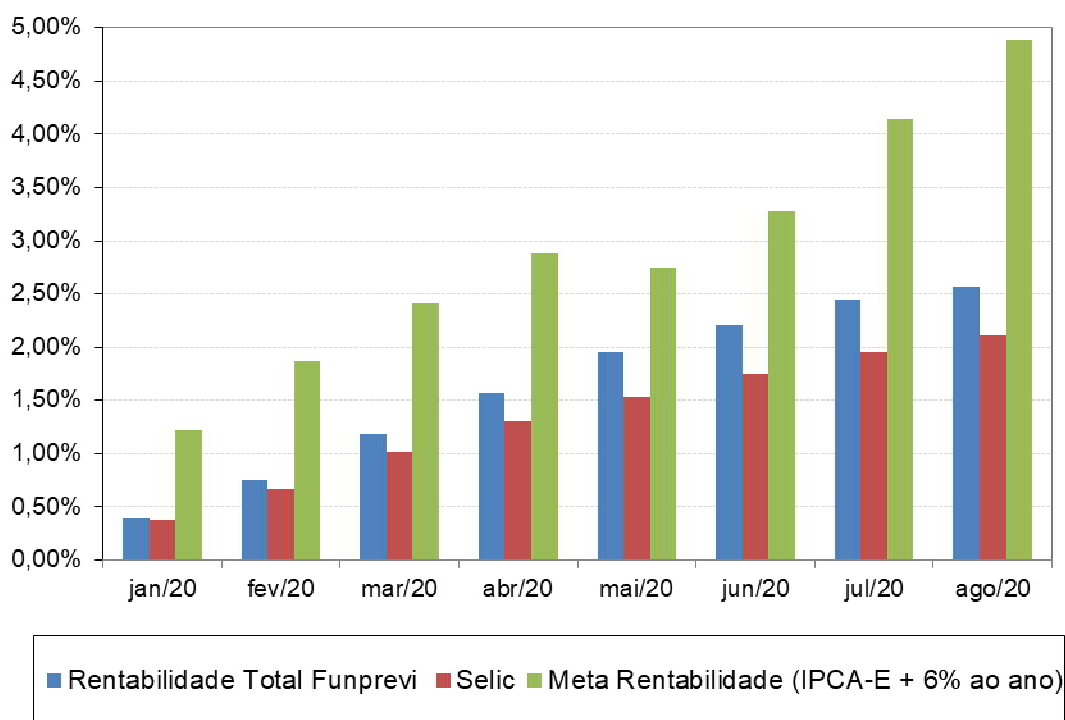
## FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	ago/20	Acum. Ano	ago/20	Acum. 2020	ago/20	Acum. 2020
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,14%	1,77%	20,14%	36,17%	90,67%	83,59%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,09%	1,55%	12,58%	31,70%	56,62%	73,25%
Santander Cash Blue FIRF Referenciado DI	0,13%	1,83%	17,63%	37,36%	79,38%	86,32%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,10%	2,83%	13,40%	57,91%	60,34%	133,81%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
<b>Rentabilidade Total Funprevi</b>	<b>0,11%</b>	<b>2,56%</b>	<b>15,06%</b>	<b>52,45%</b>	<b>67,81%</b>	<b>121,18%</b>
<b>Meta Rentabilidade</b>	<b>0,72%</b>	<b>4,89%</b>				
<b>Selic</b>	<b>0,16%</b>	<b>2,12%</b>				

### 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

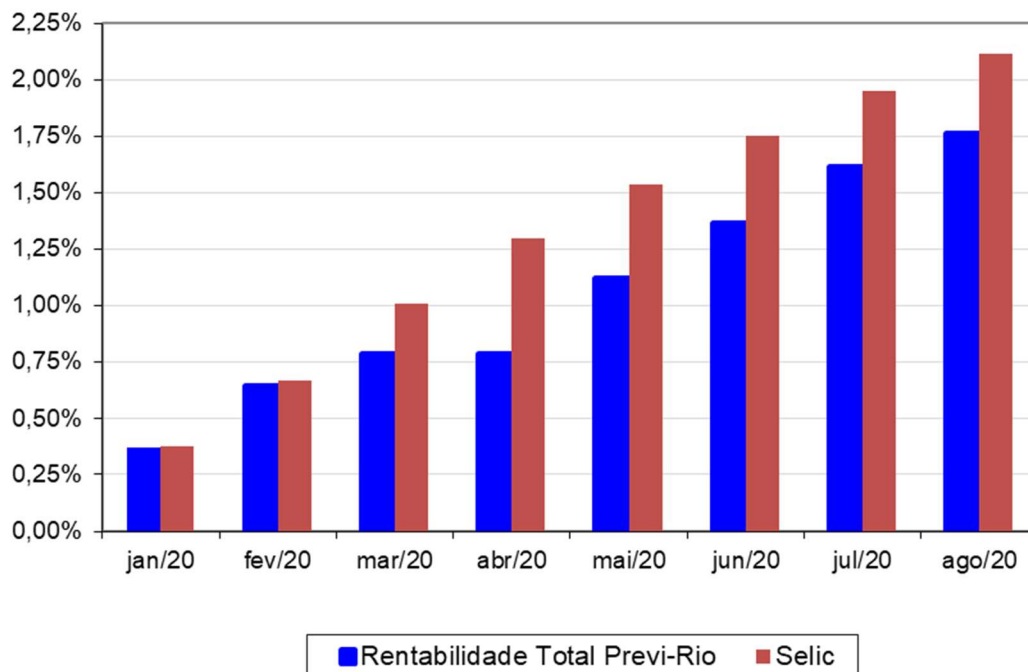
## PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	ago/20	Acum. Ano	ago/20	Acum. 2020
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,14%	1,77%	90,67%	83,59%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,09%	1,55%	56,62%	73,25%
Rentabilidade Total Previ-Rio	0,14%	1,76%	90,58%	83,42%
Selic	0,16%	2,12%		

### OBSERVAÇÕES:

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

### Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



# Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

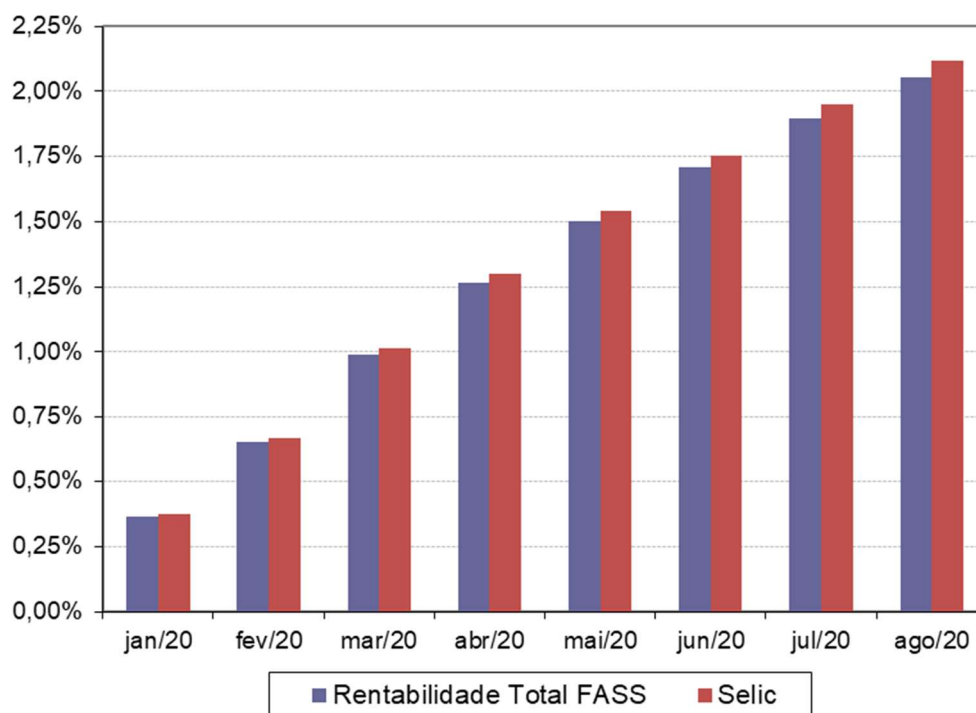
## FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	ago/20	Acum. Ano	ago/20	Acum. 2020
FI CAIXA PCRJ RF	0,15%	2,05%	95,02%	96,97%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,09%	1,55%	56,62%	73,25%
Rentabilidade Total FASS	0,15%	2,05%	95,02%	96,96%
Selic	0,16%	2,12%		

### 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 agosto, rentabilidades em relação à meta de rentabilidade <sup>(1)</sup> de 12,58% (Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa), 20,14% (Caixa Brasil Referenciado DI LP) e 13,40% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal; e 17,63% 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 15,06% em relação à meta e de 67,81% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 52,45% e de 121,18% em relação à meta e à taxa Selic, respectivamente.

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