

Relatório Mensal

2020

Dezembro

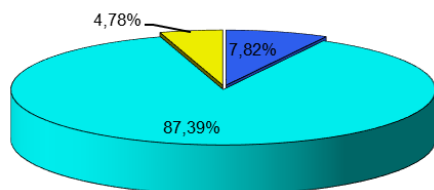
Instituto de Previdência e Assistência do Município do Rio de Janeiro - PREVI-RIO

DIRETORIA DE
INVESTIMENTOS

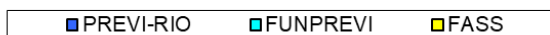
Composição da Carteira

Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

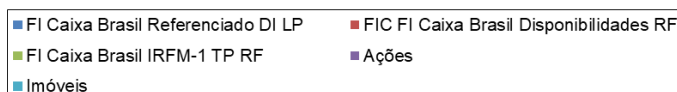
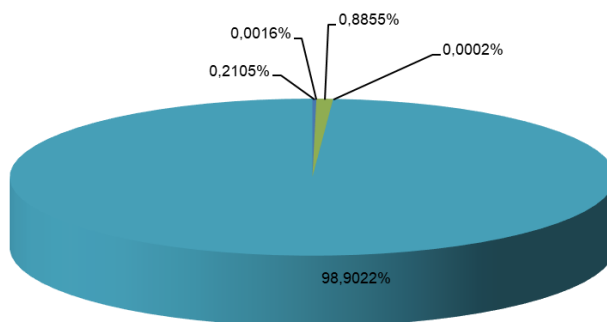
TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)



Valor da Carteira pelo Mercado	
PREVI-RIO	R\$ 69.504.990,39
FUNPREVI	R\$ 776.387.605,93
FASS	R\$ 42.486.411,13



FUNPREVI



Valor por Tipo de Ativo pelo Mercado	
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	R\$ 1.634.039,93
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 12.358,43
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 6.875.291,57
Ações	R\$ 1.416,00
Subtotal Valores Mobiliários Funprevi	R\$ 8.523.105,93
Imóveis	R\$ 767.864.500,00
Total Carteira Funprevi	R\$ 776.387.605,93

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

Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos	
(Saldo Dezembro 2020)	R\$ 316.276.724,57

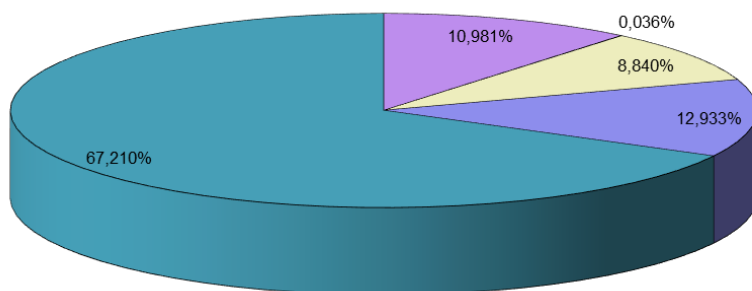
Aluguéis Recebidos	
Dezembro 2020	R\$ 3.985.105,01

(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

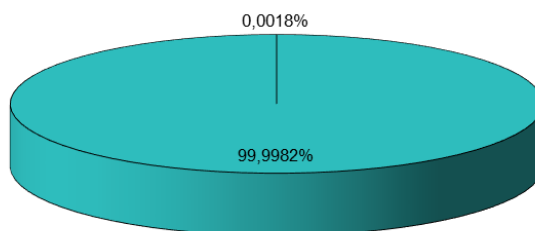
PREVI-RIO



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\$ 7.632.522,56
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 25.233,16
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	R\$ 6.144.049,97
FI Caixa PCRJ RF	R\$ 8.988.892,73
Subtotal Valores Mobiliários Previ-Rio	R\$ 22.790.698,42
Imóveis	R\$ 46.714.291,97
Total Carteira Previ-Rio	R\$ 69.504.990,39

FASS



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

Valor da Carteira	
FI CAIXA PCRJ RF	R\$ 42.485.649,86
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 761,27
Total Carteira FASS	R\$ 42.486.411,13

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

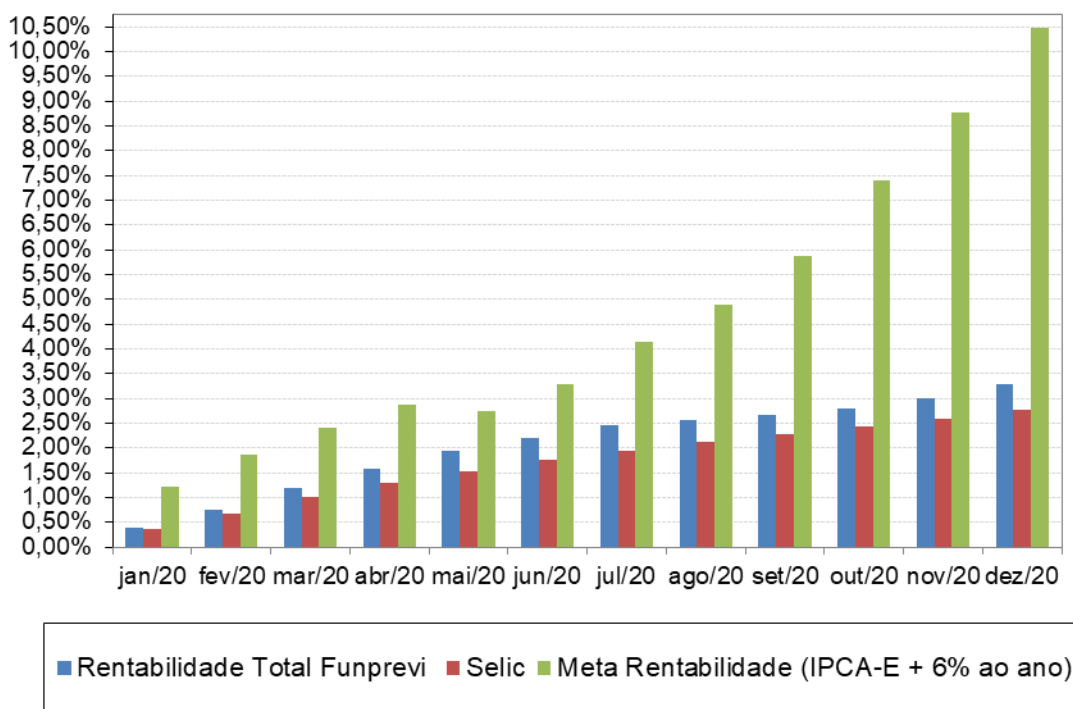
FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	dez/20	Acum. Ano	dez/20	Acum. 2020	dez/20	Acum. 2020
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,36%	2,42%	22,99%	23,05%	220,55%	87,59%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,09%	1,90%	5,70%	18,14%	54,66%	68,94%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,28%	3,63%	18,05%	34,64%	173,14%	131,67%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Funprevi	0,27%	3,28%	17,35%	31,32%	166,42%	119,03%
Meta Rentabilidade	1,58%	10,48%				
Selic	0,16%	2,76%				

OBSERVAÇÕES:

- 1) Aplicações informadas com posição de fechamento do último dia útil.
- 2) Razão Social do FI Caixa Brasil Disponibilidades RF foi alterado para FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF.

Rentabilidade Acumulada - Funprevi x Meta Rentabilidade x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

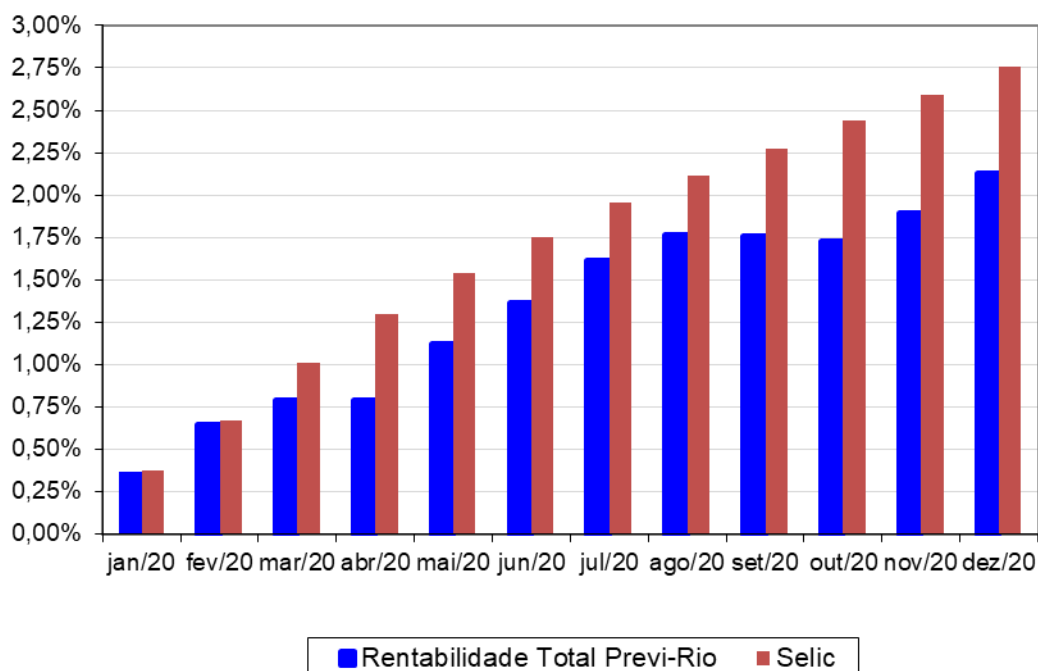
PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	dez/20	Acum. Ano	dez/20	Acum. 2020
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,36%	2,42%	220,55%	87,59%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,09%	1,90%	54,66%	68,94%
FI Caixa PCRJ RF	0,15%	0,37%	93,82%	94,20%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,28%	0,55%	173,14%	149,71%
Rentabilidade Total Previ-Rio	0,23%	2,13%	142,62%	77,26%
Selic	0,16%	2,76%		

OBSERVAÇÕES:

- 1) Aplicações informadas com posição de fechamento do último dia útil.
- 2) A aplicação inicial no Caixa FI PCRJ RF ocorreu em 16/10/2020, portanto a rentabilidade acumulada do ano é parcial.
- 3) A aplicação inicial no Fundo de Investimento Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa ocorreu em 21/10/2020, portanto a rentabilidade acumulada do ano é parcial.
- 4) Razão Social do FI Caixa Brasil Disponibilidades RF foi alterado para FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF.

Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

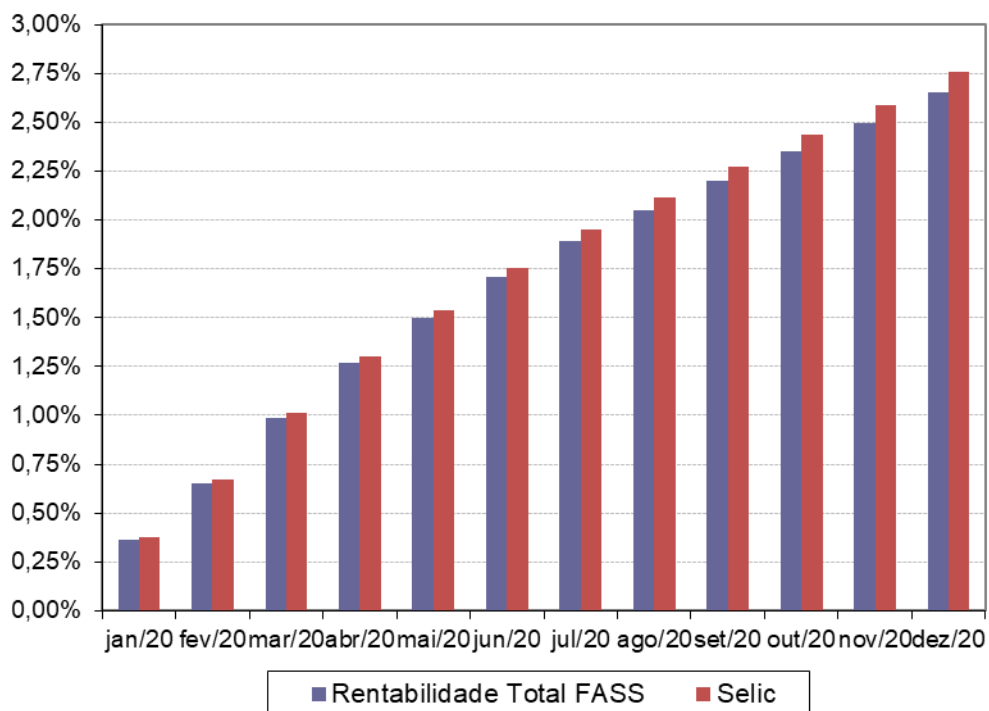
FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	dez/20	Acum. Ano	dez/20	Acum. 2020
FI Caixa PCRJ RF	0,15%	2,66%	93,82%	96,34%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,09%	1,90%	54,66%	68,94%
Rentabilidade Total FASS	0,15%	2,66%	93,81%	96,33%
Selic	0,16%	2,76%		

OBSERVAÇÕES:

- 1) Aplicações informadas com posição de fechamento do último dia útil.
- 2) Razão Social do FI Caixa Brasil Disponibilidades RF foi alterado para FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF.

Rentabilidade Acumulada - FASS x Selic



CARTEIRA FUNPREVI

Os fundos de investimentos que compõem a carteira do FUNPREVI apresentaram, em dezembro, rentabilidades em relação à meta de rentabilidade ⁽¹⁾ de 5,70% (FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF), 22,99% (Caixa Brasil Referenciado DI LP) e 18,05% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal. Desta forma, a carteira registrou um desempenho no mês de 17,35% em relação à meta e de 166,42% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 31,32% e de 119,03% em relação à meta e à taxa Selic, respectivamente.

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