

Relatório Mensal

2020

Fevereiro

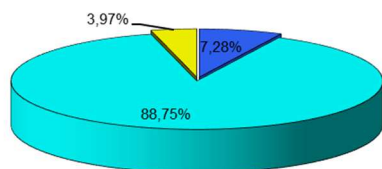
Instituto de Previdência e Assistência do Município do Rio de Janeiro - PREVI-RIO

DIRETORIA DE
INVESTIMENTOS

Composição da Carteira

Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

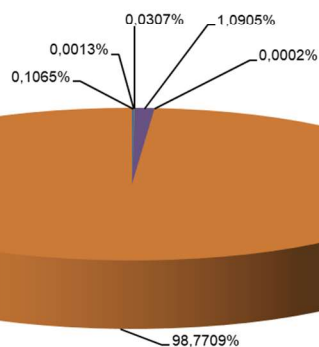
TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)



Valor da Carteira pelo Mercado	
PREVI-RIO	R\$ 69.822.474,73
FUNPREVI	R\$ 851.365.012,58
FASS	R\$ 38.088.017,15



FUNPREVI



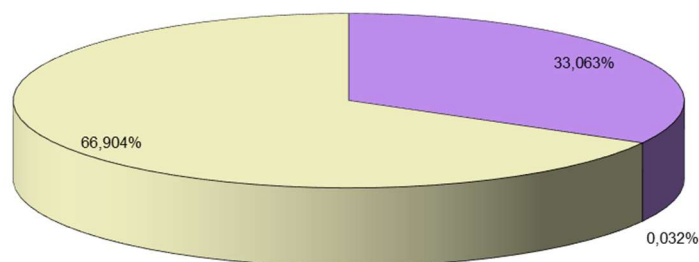
Valor por Tipo de Ativo pelo Mercado	
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	R\$ 906.420,87
FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 10.687,18
Santander Cash Blue FI RF Referenciado DI	R\$ 261.135,50
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 9.284.253,03
Ações	R\$ 1.416,00
Subtotal Valores Mobiliários Funprevi	R\$ 10.463.912,58
Imóveis	R\$ 840.901.100,00
Total Carteira Funprevi	R\$ 851.365.012,58
Valor Presente dos Recebíveis de Royalties	
Valor Presente (01/01/2020) ⁽¹⁾	R\$ 4.208.148.301,65
Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos	
Saldo (Fevereiro 2020)	R\$ 355.615.171,91
Aluguéis Recebidos	
Fevereiro 2020	R\$ -

(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

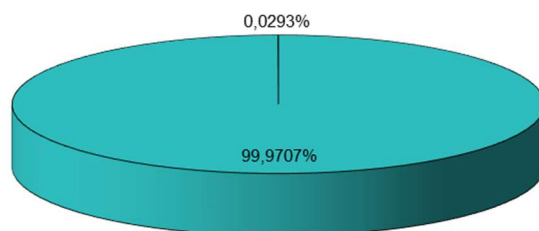
PREVI-RIO



■ 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\$ 23.085.676,85
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	R\$ 22.505,91
Subtotal Valores Mobiliários Previ-Rio	R\$ 23.108.182,76
Imóveis	R\$ 46.714.291,97
Total Carteira Previ-Rio	R\$ 69.822.474,73

FASS



■ FI CAIXA PCRJ RF ■ FI Caixa Brasil Disponibilidades RF

Valor da Carteira	
FI CAIXA PCRJ RF	R\$ 38.076.845,69
FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 11.171,46
Total Carteira FASS	R\$ 38.088.017,15

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

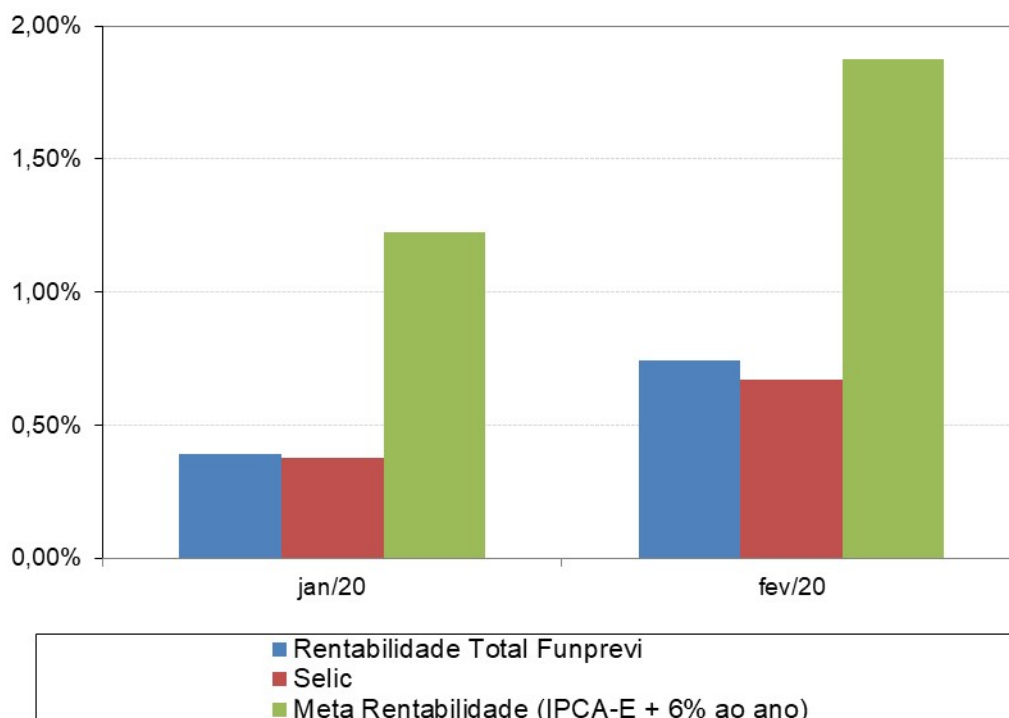
FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	fev/20	Acum. Ano	fev/20	Acum. 2020	fev/20	Acum. 2020
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,27%	0,65%	42,82%	34,47%	93,24%	96,16%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,23%	0,53%	36,05%	28,50%	78,51%	79,49%
Santander Cash Blue FI RF Referenciado DI	0,26%	0,60%	40,16%	31,92%	87,46%	89,05%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,36%	0,79%	56,79%	42,03%	123,67%	117,26%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Funprevi	0,35%	0,75%	54,55%	39,80%	118,80%	111,04%
Meta Rentabilidade	0,64%	1,87%				
Selic	0,29%	0,67%				

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

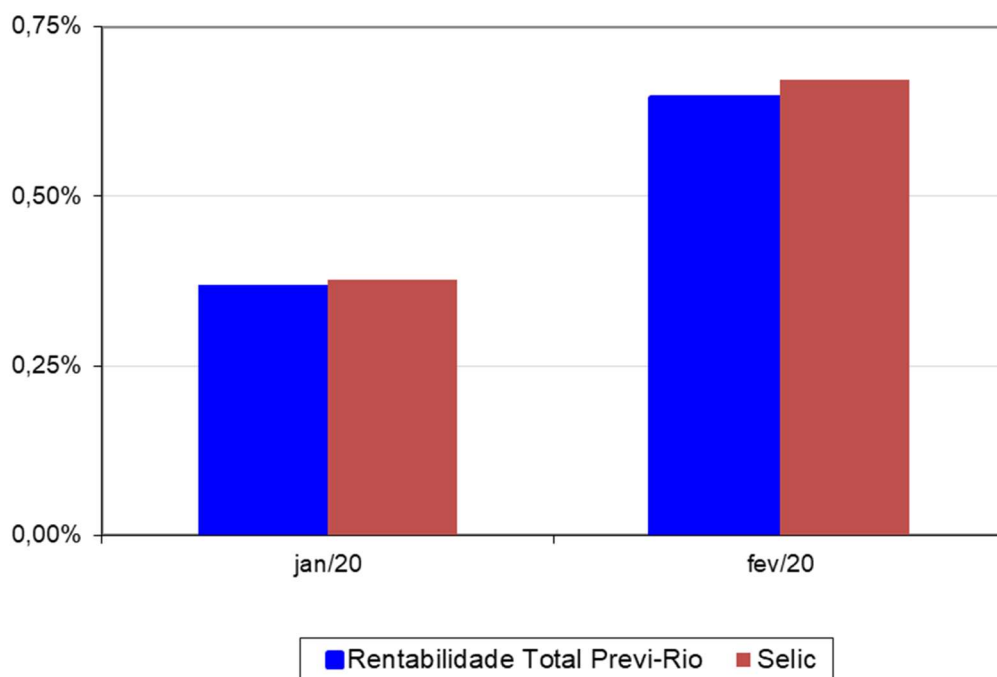
PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	fev/20	Acum. Ano	fev/20	Acum. 2020
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,27%	0,65%	93,24%	96,16%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,23%	0,53%	78,51%	79,49%
Rentabilidade Total Previ-Rio	0,27%	0,64%	93,22%	96,01%
Selic	0,29%	0,67%		

OBSERVAÇÕES:

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

Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

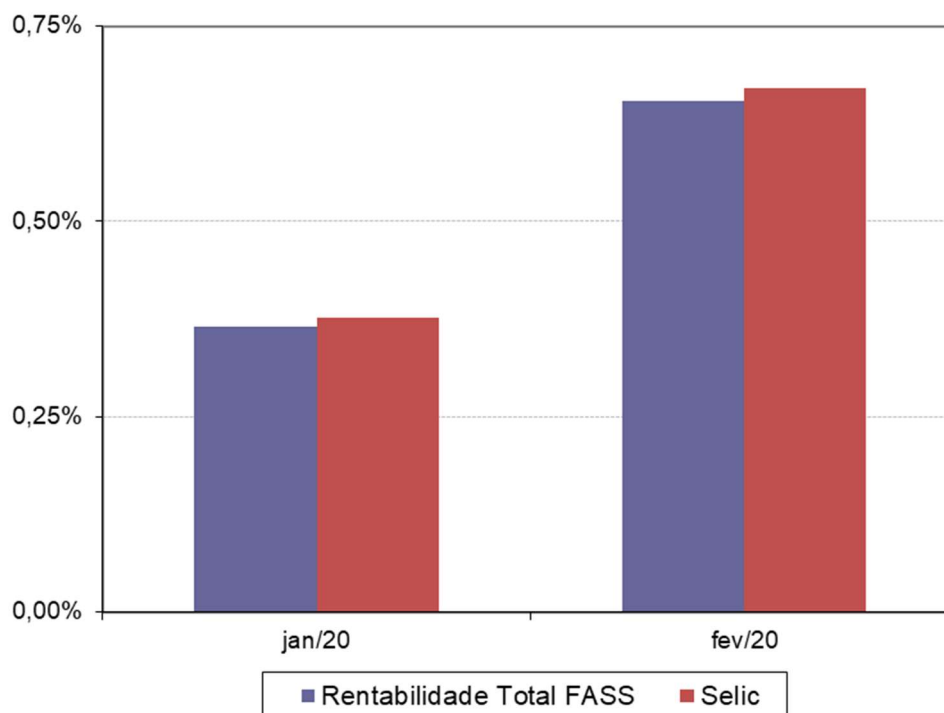
FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	fev/20	Acum. Ano	fev/20	Acum. 2020
FI CAIXA PCRJ RF	0,29%	0,65%	97,69%	97,38%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,23%	0,53%	78,51%	79,49%
Rentabilidade Total FASS	0,29%	0,65%	97,69%	97,38%
Selic	0,29%	0,67%		

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 fevereiro, rentabilidades em relação à meta de rentabilidade ⁽¹⁾ de 36,05% (Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa), 42,82% (Caixa Brasil Referenciado DI LP) e 56,79% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal; e 40,16% 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 54,55% em relação à meta e de 118,80% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 39,80% e de 111,04% em relação à meta e à taxa Selic, respectivamente.

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