

# Relatório Mensal

## 2020

# Janeiro

---

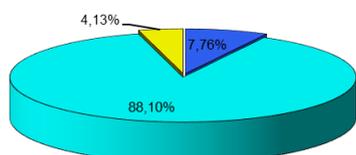
Instituto de Previdência e Assistência do Município do Rio de Janeiro - PREVI-RIO

DIRETORIA DE INVESTIMENTOS

# Composição da Carteira

## Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

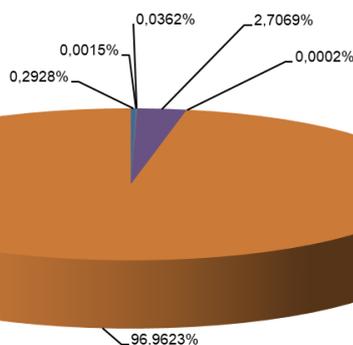
### TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)



■ PREVI-RIO ■ FUNPREVI ■ FASS

| Valor da Carteira pelo Mercado |                    |
|--------------------------------|--------------------|
| PREVI-RIO                      | R\$ 63.356.824,85  |
| FUNPREVI                       | R\$ 718.907.079,30 |
| FASS                           | R\$ 33.736.865,81  |

### 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\$ 2.104.899,66   |
| FI Caixa Brasil Disponibilidades RF       | R\$ 10.972,24      |
| Santander Cash Blue FI RF Referenciado DI | R\$ 260.466,37     |
| FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF              | R\$ 19.460.225,03  |
| Ações                                     | R\$ 1.416,00       |
| Subtotal Valores Mobiliários Funprevi     | R\$ 21.837.979,30  |
| Imóveis                                   | R\$ 697.069.100,00 |
| Total Carteira Funprevi                   | R\$ 718.907.079,30 |

| 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 (Janeiro 2020)                       | R\$ 360.723.970,74 |

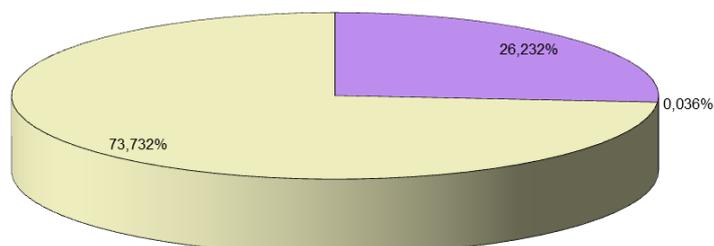
| Aluguéis Recebidos |                  |
|--------------------|------------------|
| Janeiro 2020       | R\$ 3.911.964,99 |

(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

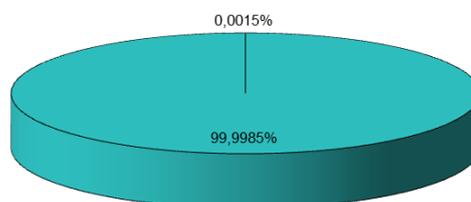
### PREVI-RIO



■ 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\$ 16.619.825,81        |
| FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa | R\$ 22.707,07            |
| Subtotal Valores Mobiliários Previ-Rio      | R\$ 16.642.532,88        |
| Imóveis                                     | R\$ 46.714.291,97        |
| <b>Total Carteira Previ-Rio</b>             | <b>R\$ 63.356.824,85</b> |

### FASS



■ FI CAIXA PCRJ RF ■ FI Caixa Brasil Disponibilidades RF

| Valor da Carteira                   |                          |
|-------------------------------------|--------------------------|
| FI CAIXA PCRJ RF                    | R\$ 33.736.343,61        |
| FI Caixa Brasil Disponibilidades RF | R\$ 522,20               |
| <b>Total Carteira FASS</b>          | <b>R\$ 33.736.865,81</b> |

# Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

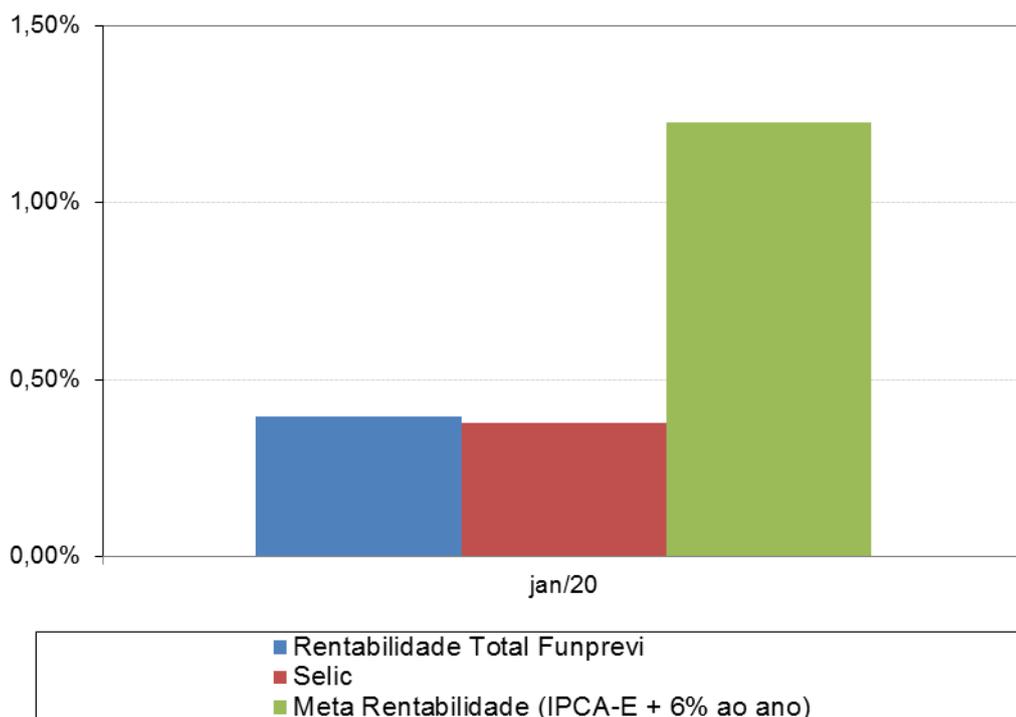
## FUNPREVI

| ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI               | Rentabilidade Nominal |               | Rentabilidade em relação à Meta |               | Rentabilidade em relação à Selic |               |
|---|-----------------------|---------------|---------------------------------|---------------|----------------------------------|---------------|
|   | jan/20                | Acum. Ano     | jan/20                          | Acum. 2020    | jan/20                           | Acum. 2020    |
| FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo | 0,37%                 | 0,37%         | 30,25%                          | 30,25%        | 98,46%                           | 98,46%        |
| FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa | 0,30%                 | 0,30%         | 24,68%                          | 24,68%        | 80,31%                           | 80,31%        |
| Santander Cash Blue FI RF Referenciado DI   | 0,34%                 | 0,34%         | 27,75%                          | 27,75%        | 90,32%                           | 90,32%        |
| FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa        | 0,42%                 | 0,42%         | 34,48%                          | 34,48%        | 112,20%                          | 112,20%       |
| Ações                                       | Não aplicável         | Não aplicável | Não aplicável                   | Não aplicável | Não aplicável                    | Não aplicável |
| Rentabilidade Total Funprevi                | 0,40%                 | 0,40%         | 32,25%                          | 32,25%        | 104,94%                          | 104,94%       |
| Meta Rentabilidade                          | 1,23%                 | 1,23%         |                                 |               |                                  |               |
| Selic                                       | 0,38%                 | 0,38%         |                                 |               |                                  |               |

### 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

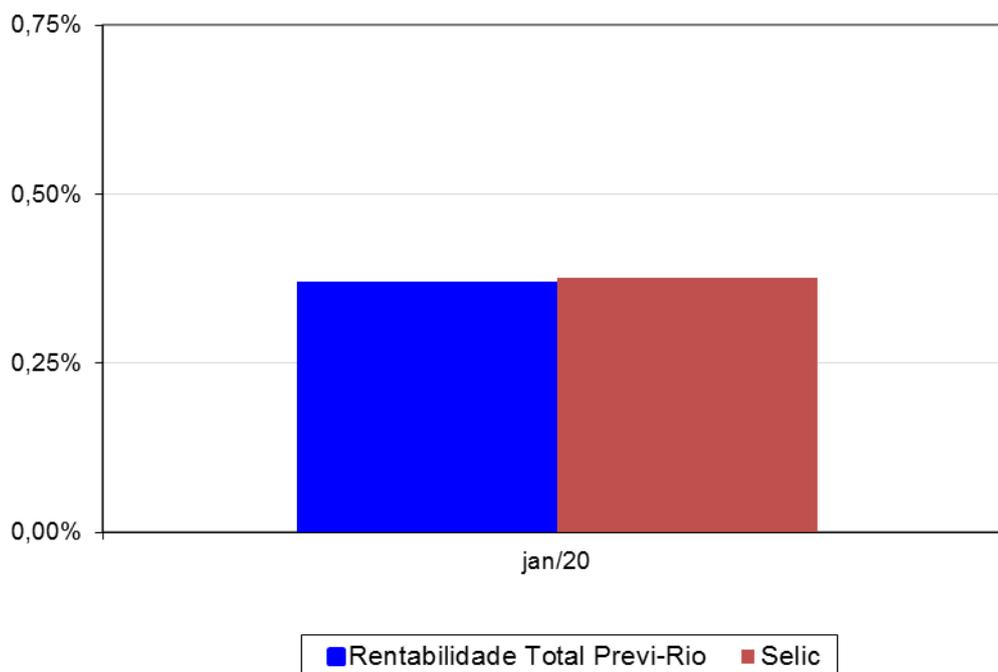
## PREVI-RIO

| ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO              | Rentabilidade Nominal |           | Rentabilidade em relação à Selic |            |
|---|-----------------------|-----------|----------------------------------|------------|
|   | jan/20                | Acum. Ano | jan/20                           | Acum. 2020 |
| FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo | 0,37%                 | 0,37%     | 98,46%                           | 98,46%     |
| FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa | 0,30%                 | 0,30%     | 80,31%                           | 80,31%     |
| Rentabilidade Total Previ-Rio               | 0,37%                 | 0,37%     | 98,21%                           | 98,21%     |
| Selic                                       | 0,38%                 | 0,38%     |                                  |            |

### OBSERVAÇÕES:

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

### Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



# Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

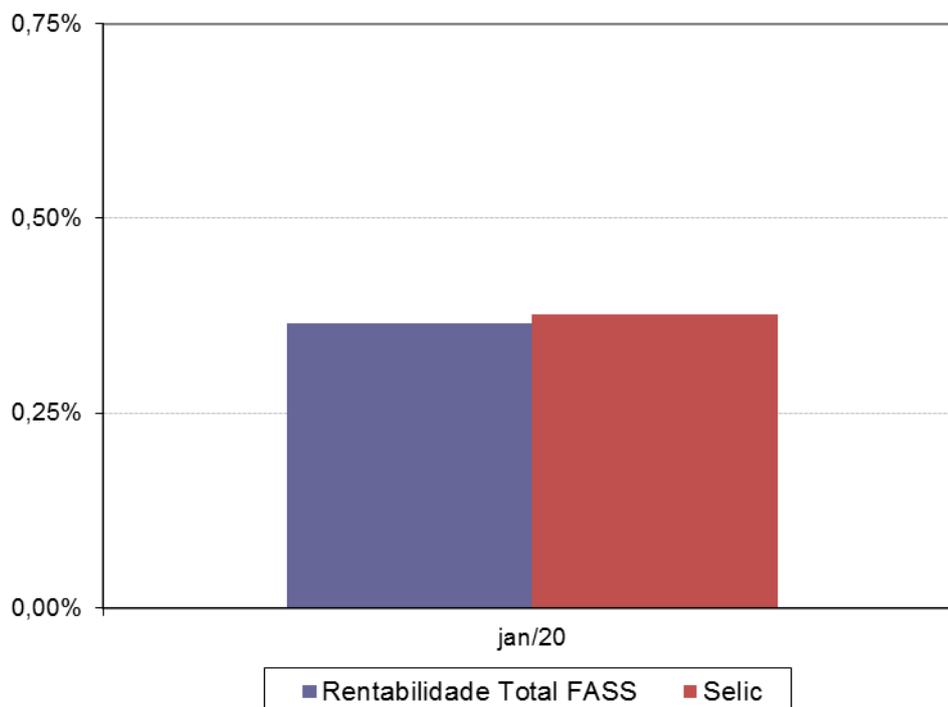
## FASS

| ATIVOS FINANCEIROS - FASS                   | Rentabilidade Nominal |           | Rentabilidade em relação à Selic |            |
|---|-----------------------|-----------|----------------------------------|------------|
|   | jan/20                | Acum. Ano | jan/20                           | Acum. 2020 |
| FI CAIXA PCRJ RF                            | 0,37%                 | 0,37%     | 97,15%                           | 97,15%     |
| FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa | 0,30%                 | 0,30%     | 80,31%                           | 80,31%     |
| Rentabilidade Total FASS                    | 0,37%                 | 0,37%     | 97,15%                           | 97,15%     |
| Selic                                       | 0,38%                 | 0,38%     |                                  |            |

### 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 janeiro, rentabilidades em relação à meta de rentabilidade <sup>(1)</sup> de 24,68% (Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa), 30,25% (Caixa Brasil Referenciado DI LP) e 34,48% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal; e 27,75% 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 32,25% em relação à meta e de 104,94% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 32,25% e de 104,94% em relação à meta e à taxa Selic, respectivamente.

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