

Relatório Mensal

2020

Junho

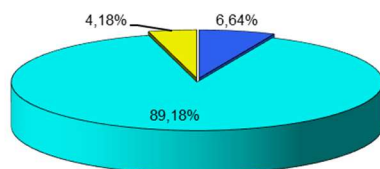
Instituto de Previdência e Assistência do Município do Rio de Janeiro - PREVI-RIO

DIRETORIA DE INVESTIMENTOS

Composição da Carteira

Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

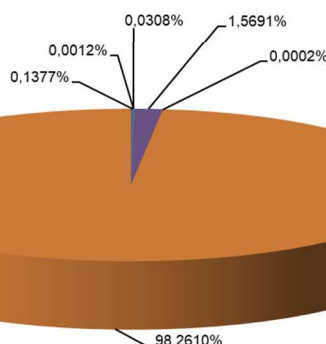
TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)



Valor da Carteira pelo Mercado	
PREVI-RIO	R\$ 63.690.372,92
FUNPREVI	R\$ 855.781.193,96
FASS	R\$ 40.148.478,12



FUNPREVI



Valor por Tipo de Ativo pelo Mercado	
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	R\$ 1.178.384,76
FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 10.336,69
Santander Cash Blue FI RF Referenciado DI	R\$ 263.573,42
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 13.428.383,09
Ações	R\$ 1.416,00
Subtotal Valores Mobiliários Funprevi	R\$ 14.882.093,96
Imóveis	R\$ 840.899.100,00
Total Carteira Funprevi	R\$ 855.781.193,96

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

Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos	
Saldo (Junho 2020)	R\$ 334.024.026,23

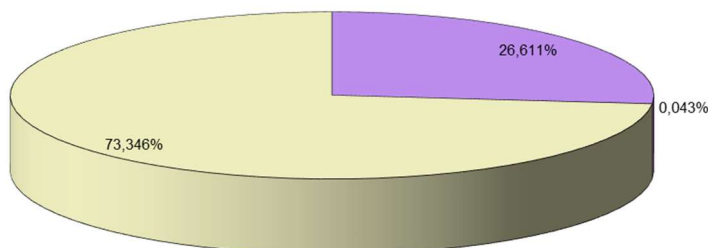
Aluguéis Recebidos	
Junho 2020	R\$ 8.065.255,16

(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

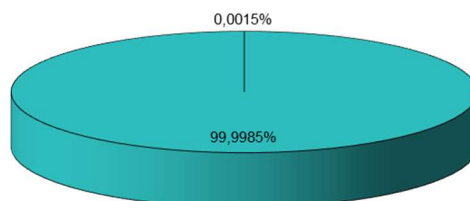
PREVI-RIO



■ 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\$ 16.948.617,45
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	R\$ 27.463,50
Subtotal Valores Mobiliários Previ-Rio	R\$ 16.976.080,95
Imóveis	R\$ 46.714.291,97
Total Carteira Previ-Rio	R\$ 63.690.372,92

FASS



■ FI CAIXA PCRJ RF ■ FI Caixa Brasil Disponibilidades RF

Valor da Carteira	
FI CAIXA PCRJ RF	R\$ 40.147.890,21
FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 587,91
Total Carteira FASS	R\$ 40.148.478,12

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

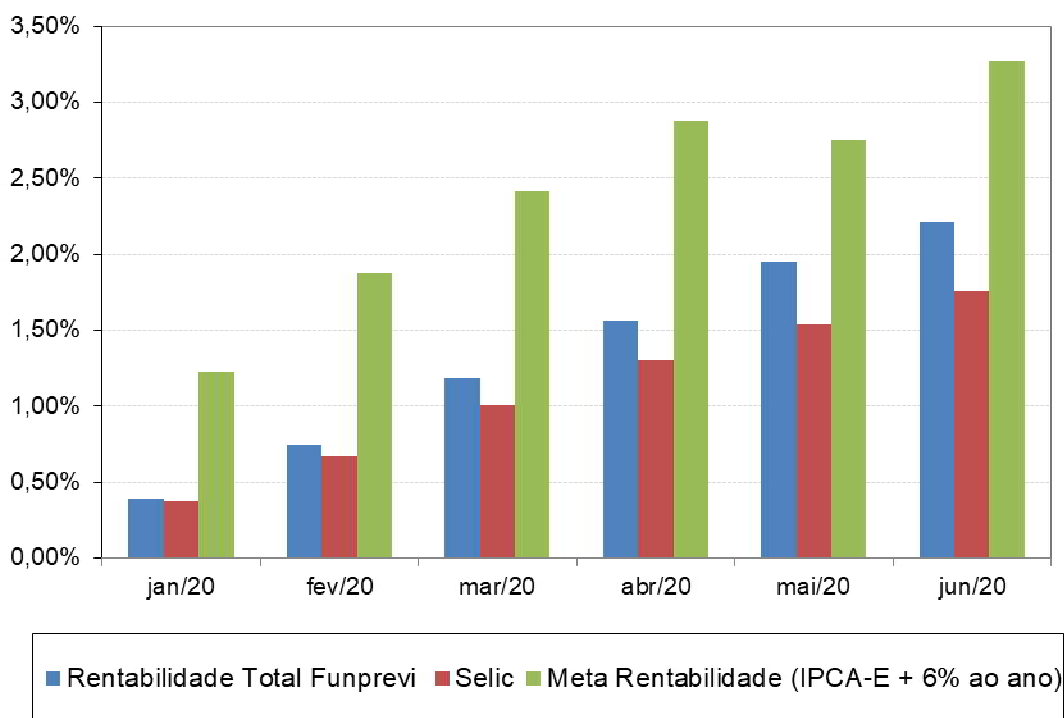
FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	jun/20	Acum. Ano	jun/20	Acum. 2020	jun/20	Acum. 2020
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,24%	1,37%	47,71%	41,82%	114,33%	78,02%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,14%	1,34%	28,41%	40,92%	68,08%	76,36%
Santander Cash Blue FI RF Referenciado DI	0,18%	1,54%	35,35%	46,96%	84,72%	87,62%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,26%	2,48%	50,95%	75,89%	122,08%	141,60%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Funprevi	0,26%	2,21%	50,29%	67,59%	120,52%	126,11%
Meta Rentabilidade	0,51%	3,27%				
Selic	0,21%	1,75%				

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

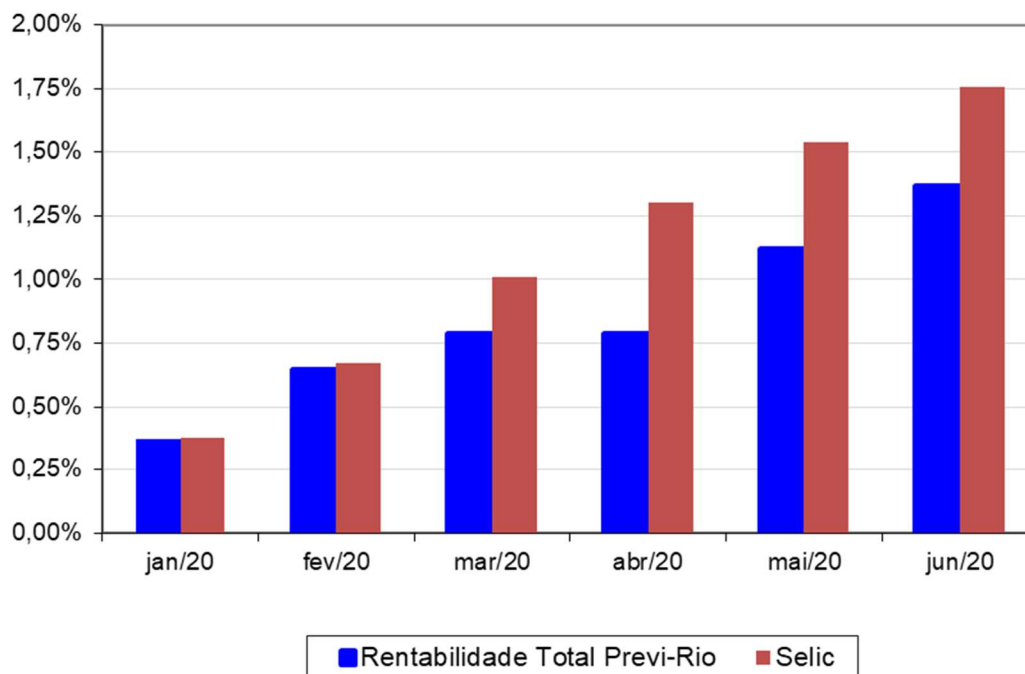
PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	jun/20	Acum. Ano	jun/20	Acum. 2020
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,24%	1,37%	114,33%	78,02%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,14%	1,34%	68,08%	76,36%
Rentabilidade Total Previ-Rio	0,24%	1,37%	114,27%	77,85%
Selic	0,21%	1,75%		

OBSERVAÇÕES:

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

Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

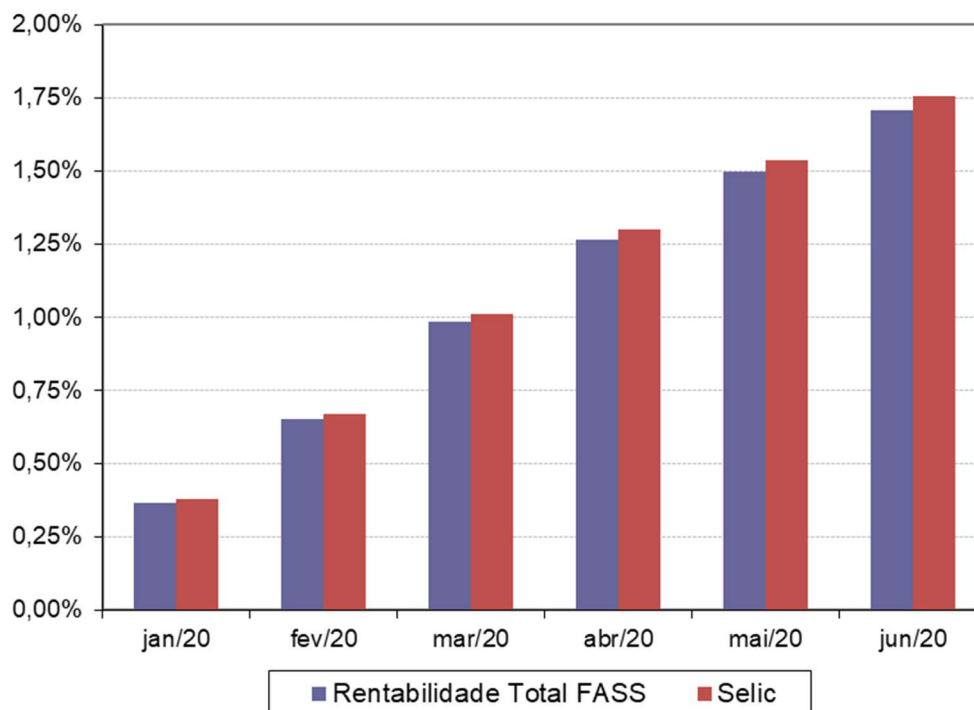
FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	jun/20	Acum. Ano	jun/20	Acum. 2020
FI CAIXA PCRJ RF	0,21%	1,71%	97,26%	97,43%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,14%	1,34%	68,08%	76,36%
Rentabilidade Total FASS	0,21%	1,71%	97,26%	97,42%
Selic	0,21%	1,75%		

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 junho, rentabilidades em relação à meta de rentabilidade ⁽¹⁾ de 28,41% (Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa), 47,71% (Caixa Brasil Referenciado DI LP) e 50,95% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal; e 35,35% 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 50,29% em relação à meta e de 120,52% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 67,59% e de 126,11% em relação à meta e à taxa Selic, respectivamente.

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