

Relatório Mensal

2020

Maio

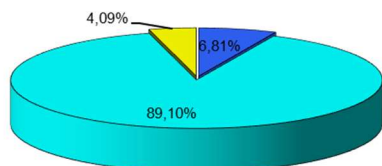
Instituto de Previdência e Assistência do Município do Rio de Janeiro - PREVI-RIO

DIRETORIA DE
INVESTIMENTOS

Composição da Carteira

Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

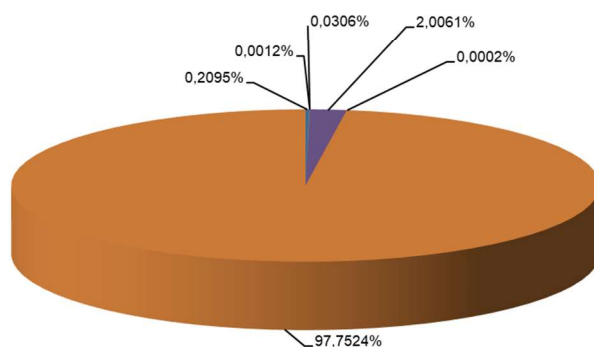
TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)



Valor da Carteira pelo Mercado	
PREVI-RIO	R\$ 65.743.086,38
FUNPREVI	R\$ 860.235.552,69
FASS	R\$ 39.524.652,37

■ PREVI-RIO ■ FUNPREVI ■ FASS

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\$ 1.802.183,69
FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 10.238,74
Santander Cash Blue FI RF Referenciado DI	R\$ 263.100,15
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 17.257.514,11
Ações	R\$ 1.416,00
Subtotal Valores Mobiliários Funprevi	R\$ 19.334.452,69
Imóveis	R\$ 840.901.100,00
Total Carteira Funprevi	R\$ 860.235.552,69

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

Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos	
Saldo (Maio 2020)	R\$ 338.478.121,75

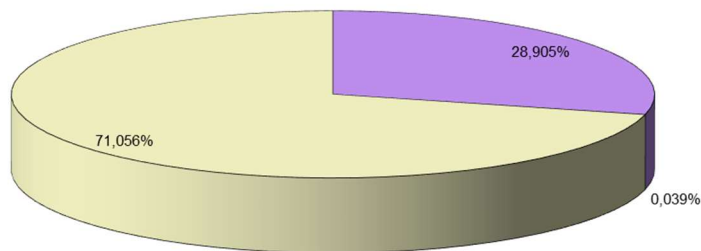
Aluguéis Recebidos	
Maio 2020	R\$ 4.032.627,58

(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

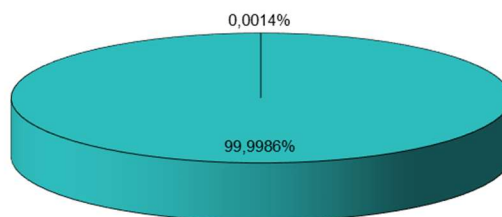
PREVI-RIO



■ 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\$ 19.003.186,63
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	R\$ 25.607,78
Subtotal Valores Mobiliários Previ-Rio	R\$ 19.028.794,41
Imóveis	R\$ 46.714.291,97
Total Carteira Previ-Rio	R\$ 65.743.086,38

FASS



■ FI CAIXA PCRJ RF ■ FI Caixa Brasil Disponibilidades RF

Valor da Carteira	
FI CAIXA PCRJ RF	R\$ 39.524.085,19
FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 567,18
Total Carteira FASS	R\$ 39.524.652,37

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

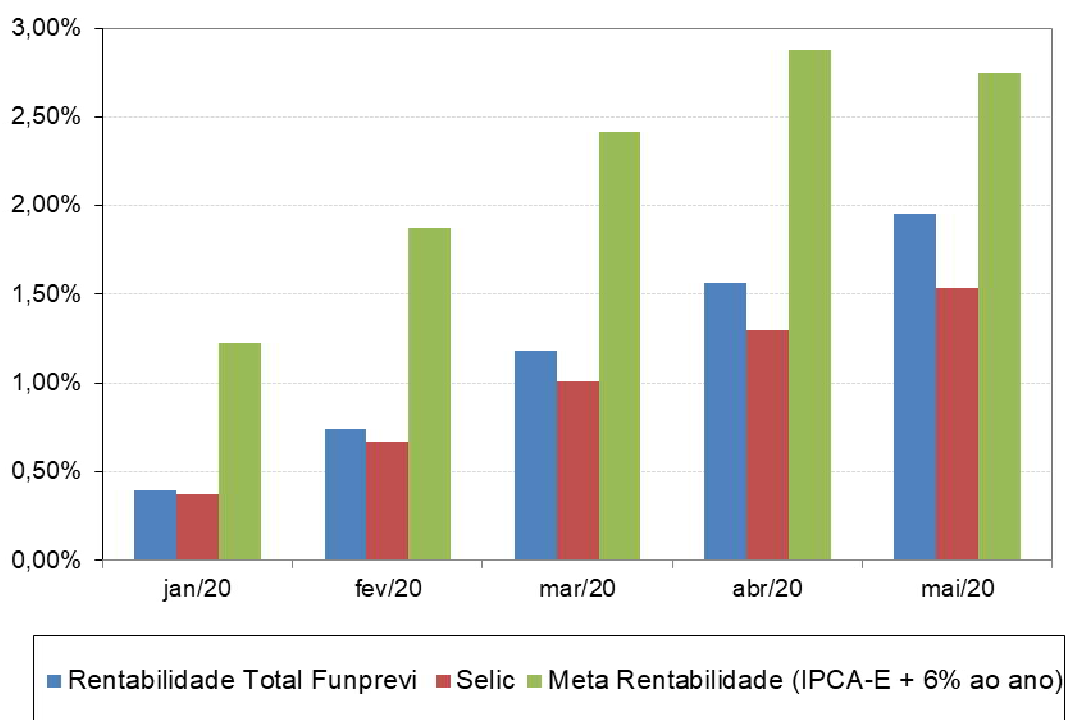
FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	mai/20	Acum. Ano	mai/20	Acum. 2020	mai/20	Acum. 2020
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,33%	1,12%	357,77%	40,84%	139,24%	73,00%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,17%	1,19%	234,81%	43,38%	72,82%	77,55%
Santander Cash Blue FI RF Referenciado DI	0,21%	1,35%	261,73%	49,25%	87,36%	88,04%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,39%	2,22%	408,56%	80,68%	166,67%	144,22%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Funprevi	0,38%	1,95%	396,76%	70,95%	160,29%	126,83%
Meta Rentabilidade	-0,13%	2,75%				
Selic	0,24%	1,54%				

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

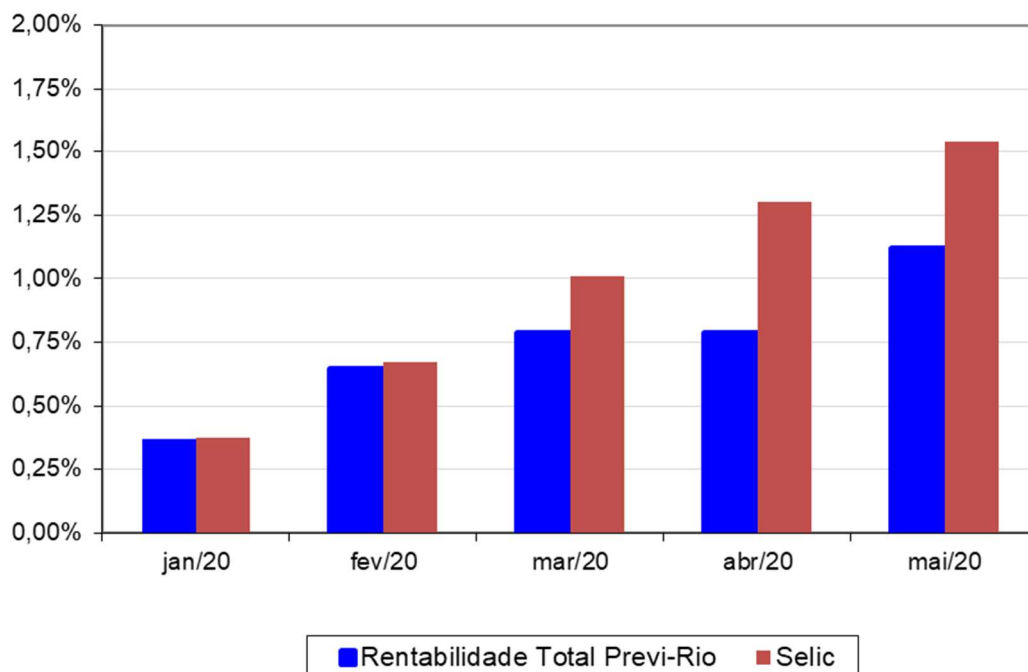
PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	mai/20	Acum. Ano	mai/20	Acum. 2020
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,33%	1,12%	139,24%	73,00%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,17%	1,19%	72,82%	77,55%
Rentabilidade Total Previ-Rio	0,33%	1,12%	139,17%	72,81%
Selic	0,24%	1,54%		

OBSERVAÇÕES:

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

Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

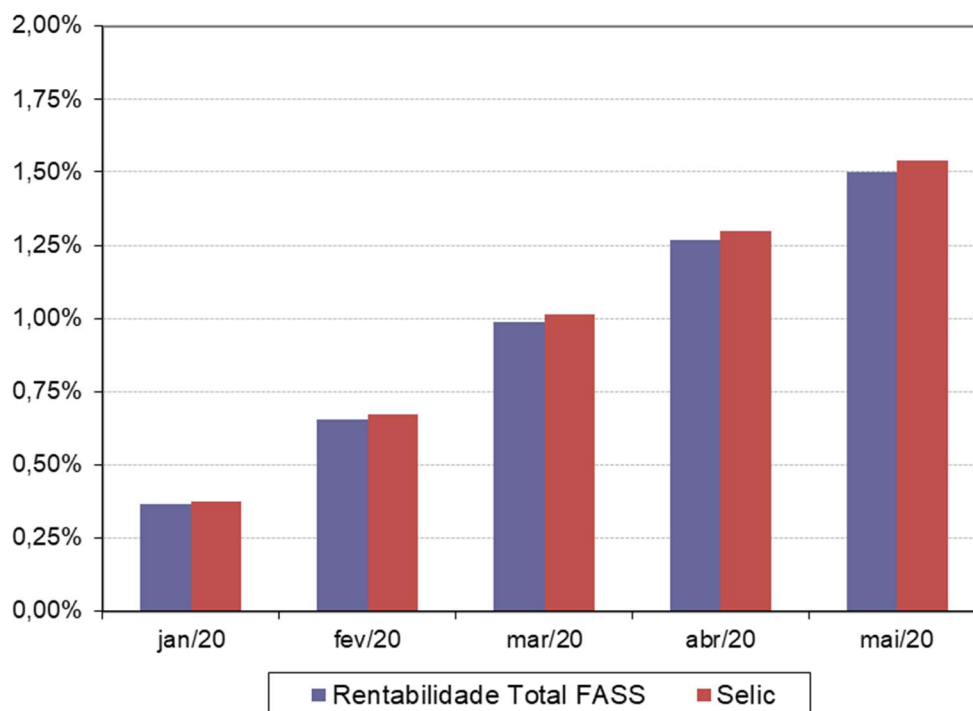
FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	mai/20	Acum. Ano	mai/20	Acum. 2020
FI CAIXA PCRJ RF	0,23%	1,50%	97,79%	97,46%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,17%	1,19%	72,82%	77,55%
Rentabilidade Total FASS	0,23%	1,50%	97,79%	97,44%
Selic	0,24%	1,54%		

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 maio, rentabilidades em relação à meta de rentabilidade ⁽¹⁾ de 234,81% (Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa), 357,77% (Caixa Brasil Referenciado DI LP) e 408,56% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal; e 261,73% 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 396,76% em relação à meta e de 160,29% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 70,95% e de 126,83% em relação à meta e à taxa Selic, respectivamente.

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