

Relatório Mensal

2020

Março

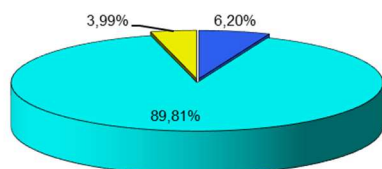
Instituto de Previdência e Assistência do Município do Rio de Janeiro - PREVI-RIO

DIRETORIA DE
INVESTIMENTOS

Composição da Carteira

Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

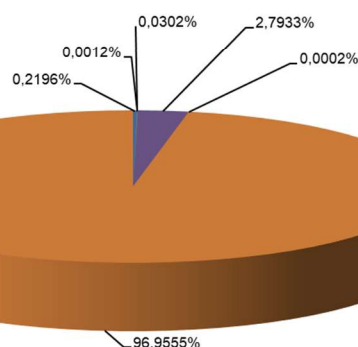
TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)



Valor da Carteira pelo Mercado	
PREVI-RIO	R\$ 59.876.858,82
FUNPREVI	R\$ 867.305.846,88
FASS	R\$ 38.538.461,83



FUNPREVI



Valor por Tipo de Ativo pelo Mercado	
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	R\$ 1.904.391,61
FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 10.262,40
Santander Cash Blue FI RF Referenciado DI	R\$ 261.920,99
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 24.226.755,88
Ações	R\$ 1.416,00
Subtotal Valores Mobiliários Funprevi	R\$ 26.404.746,88
Imóveis	R\$ 840.901.100,00
Total Carteira Funprevi	R\$ 867.305.846,88

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

Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos	
Saldo (Março 2020)	R\$ 350.628.065,56

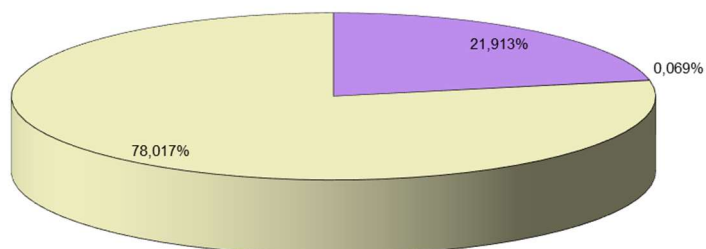
Aluguéis Recebidos	
Março 2020	R\$ 28.334,00

(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

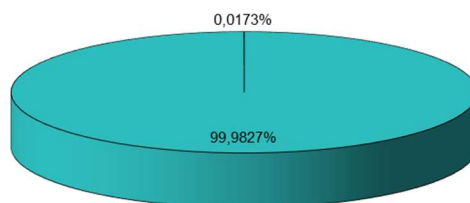
PREVI-RIO



■ 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\$ 13.120.988,39
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	R\$ 41.578,46
Subtotal Valores Mobiliários Previ-Rio	R\$ 13.162.566,85
Imóveis	R\$ 46.714.291,97
Total Carteira Previ-Rio	R\$ 59.876.858,82

FASS



■ FI CAIXA PCRJ RF ■ FI Caixa Brasil Disponibilidades RF

Valor da Carteira	
FI CAIXA PCRJ RF	R\$ 38.531.811,80
FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 6.650,03
Total Carteira FASS	R\$ 38.538.461,83

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

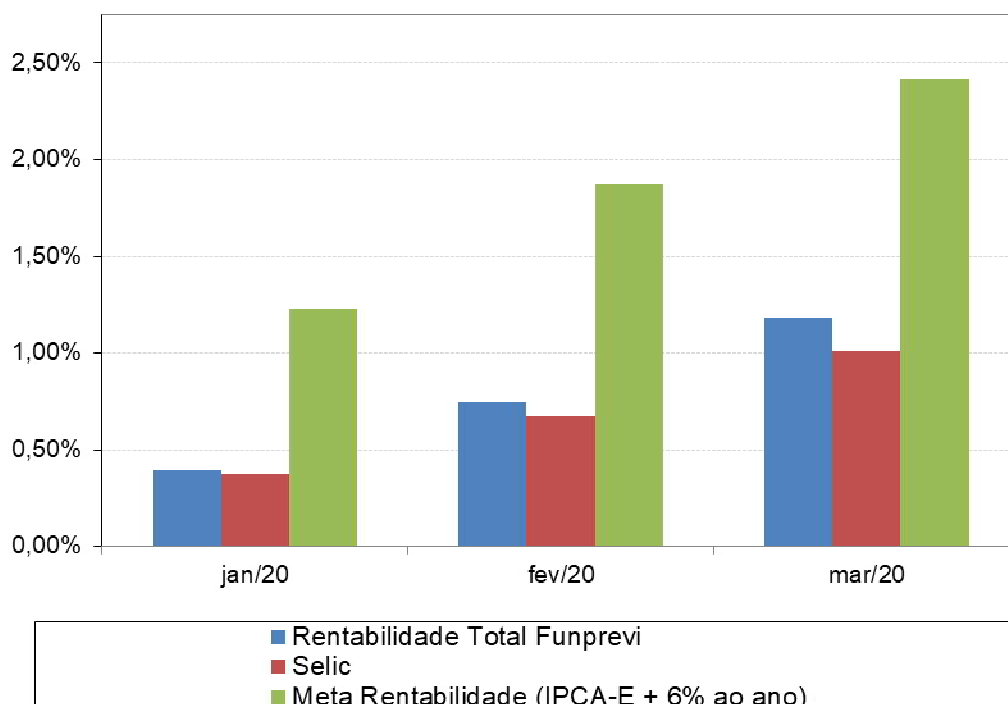
FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	mar/20	Acum. Ano	mar/20	Acum. 2020	mar/20	Acum. 2020
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,14%	0,79%	26,73%	32,66%	42,04%	77,94%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,26%	0,80%	49,75%	33,12%	78,23%	79,03%
Santander Cash Blue FI RF Referenciado DI	0,30%	0,90%	56,53%	37,28%	88,90%	88,98%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,59%	1,38%	110,46%	57,13%	173,72%	136,33%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Funprevi	0,44%	1,19%	82,13%	49,10%	129,16%	117,17%
Meta Rentabilidade	0,53%	2,42%				
Selic	0,34%	1,01%				

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

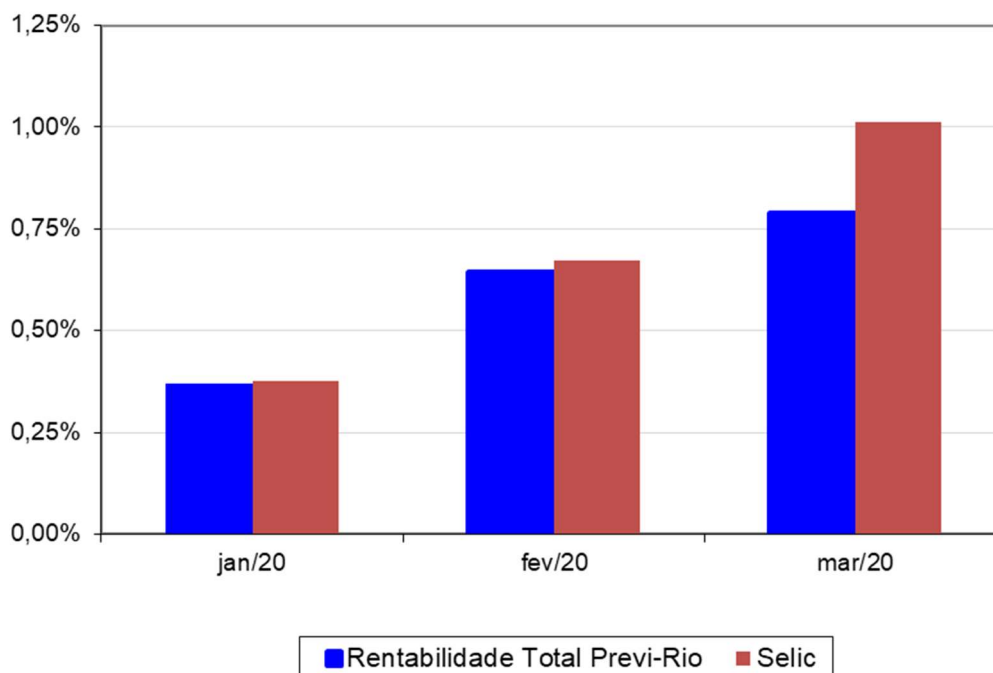
PREVI-RIO

ATMOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	mar/20	Acum. Ano	mar/20	Acum. 2020
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,14%	0,79%	42,04%	77,94%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,26%	0,80%	78,23%	79,03%
Rentabilidade Total Previ-Rio	0,14%	0,79%	42,10%	77,87%
Selic	0,34%	1,01%		

OBSERVAÇÕES:

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

Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

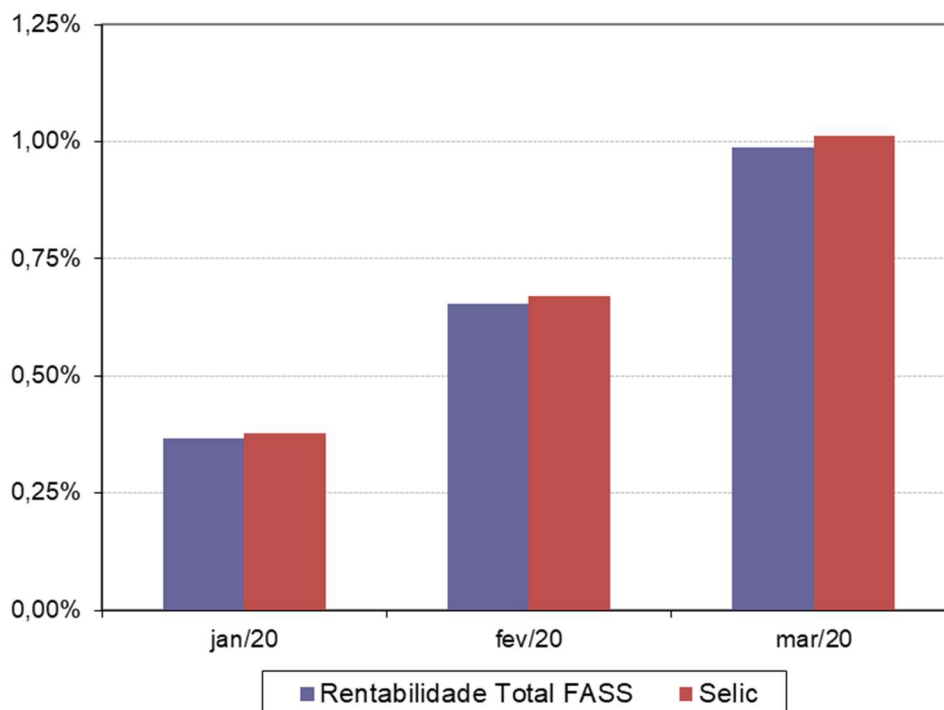
FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	mar/20	Acum. Ano	mar/20	Acum. 2020
FI CAIXA PCRJ RF	0,33%	0,99%	97,90%	97,55%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,26%	0,80%	78,23%	79,03%
Rentabilidade Total FASS	0,33%	0,99%	97,90%	97,55%
Selic	0,34%	1,01%		

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 março, rentabilidades em relação à meta de rentabilidade ⁽¹⁾ de 49,75% (Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa), 26,73% (Caixa Brasil Referenciado DI LP) e 110,46% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal; e 56,53% 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 82,13% em relação à meta e de 129,16% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 49,10% e de 117,17% em relação à meta e à taxa Selic, respectivamente.

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