

Relatório Mensal

2020

Setembro

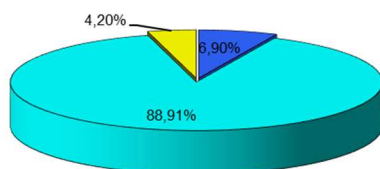
Instituto de Previdência e Assistência do Município do Rio de Janeiro - PREVI-RIO

DIRETORIA DE
INVESTIMENTOS

Composição da Carteira

Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

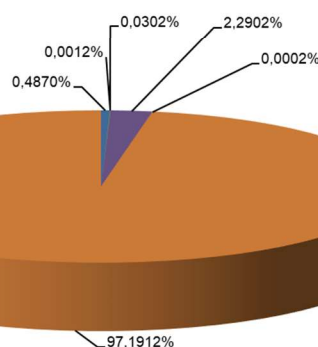
TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)



Valor da Carteira pelo Mercado	
PREVI-RIO	R\$ 67.799.341,08
FUNPREVI	R\$ 874.014.502,77
FASS	R\$ 41.259.656,94

■ 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\$ 4.256.604,07
FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 10.250,44
Santander Cash Blue FI RF Referenciado DI	R\$ 264.236,19
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 20.016.396,07
Ações	R\$ 1.416,00
Subtotal Valores Mobiliários Funprevi	R\$ 24.548.902,77
Imóveis	R\$ 849.465.600,00
Total Carteira Funprevi	R\$ 874.014.502,77

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

Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos	
Saldo (Setembro 2020)	R\$ 322.127.940,39

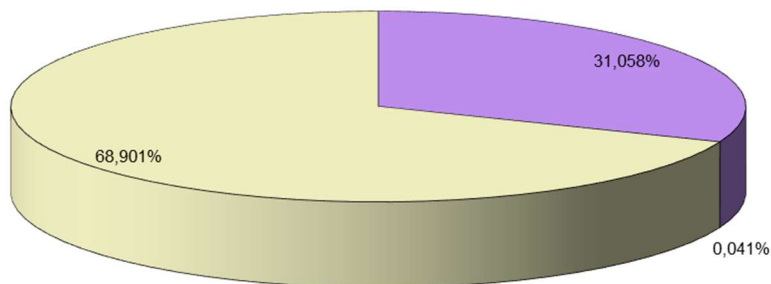
Aluguéis Recebidos	
Setembro 2020	R\$ 4.032.627,58

(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

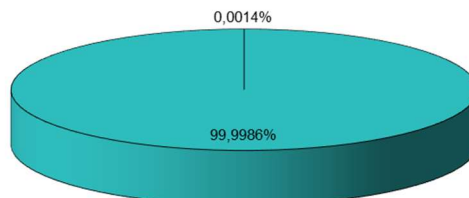
PREVI-RIO



■ 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\$ 21.057.430,81
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	R\$ 27.618,30
Subtotal Valores Mobiliários Previ-Rio	R\$ 21.085.049,11
Imóveis	R\$ 46.714.291,97
Total Carteira Previ-Rio	R\$ 67.799.341,08

FASS



■ FI CAIXA PCRJ RF ■ FI Caixa Brasil Disponibilidades RF

Valor da Carteira	
FI CAIXA PCRJ RF	R\$ 41.259.065,50
FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 591,44
Total Carteira FASS	R\$ 41.259.656,94

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

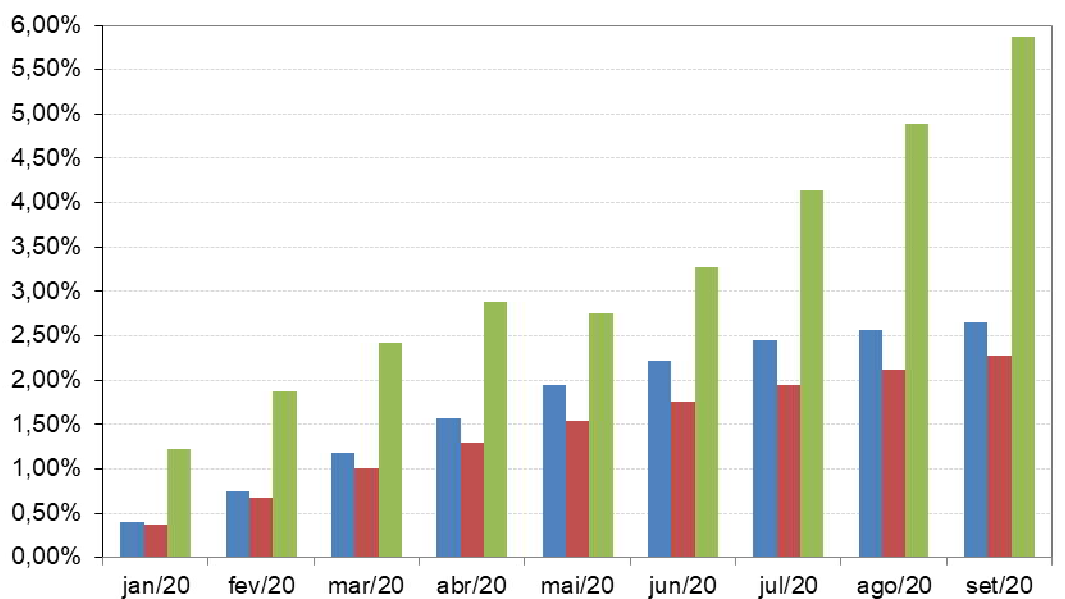
FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	set/20	Acum. Ano	set/20	Acum. 2020	set/20	Acum. 2020
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,00%	1,77%	-0,28%	30,05%	-1,68%	77,58%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,09%	1,64%	9,23%	27,88%	55,34%	71,97%
Santander Cash Blue FI RF Referenciado DI	-0,03%	1,79%	-3,49%	30,51%	-20,92%	78,77%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,13%	2,97%	14,17%	50,52%	84,94%	130,41%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Funprevi	0,09%	2,66%	9,54%	45,20%	57,19%	116,69%
Meta Rentabilidade	0,94%	5,87%				
Selic	0,16%	2,28%				

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 Total Funprevi ■ Selic ■ Meta Rentabilidade (IPCA-E + 6% ao ano)

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

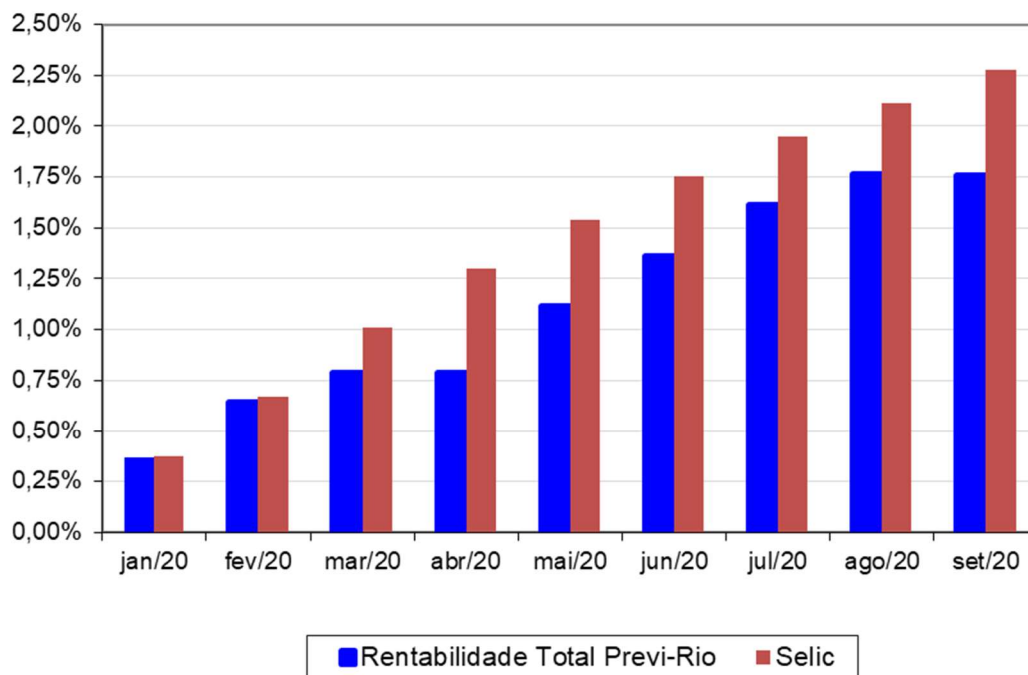
PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	set/20	Acum. Ano	set/20	Acum. 2020
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,00%	1,77%	-1,68%	77,58%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,09%	1,64%	55,34%	71,97%
Rentabilidade Total Previ-Rio	0,00%	1,76%	-1,66%	77,43%
Selic	0,16%	2,28%		

OBSERVAÇÕES:

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

Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

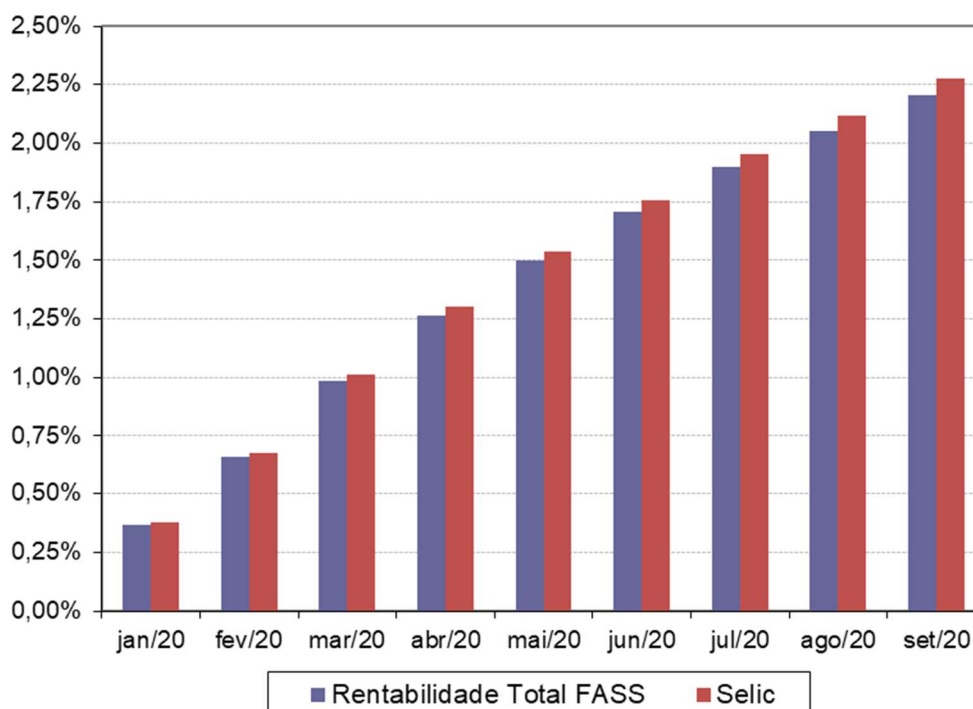
FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	set/20	Acum. Ano	set/20	Acum. 2020
FI CAIXA PCRJ RF	0,15%	2,20%	94,57%	96,80%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,09%	1,64%	55,34%	71,97%
Rentabilidade Total FASS	0,15%	2,20%	94,57%	96,79%
Selic	0,16%	2,28%		

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 setembro, rentabilidades em relação à meta de rentabilidade ⁽¹⁾ de 9,23% (Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa), -1,68% (Caixa Brasil Referenciado DI LP) e 14,17% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal; e -3,49% 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 9,54% em relação à meta e de 57,19% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 45,20% e de 116,69% em relação à meta e à taxa Selic, respectivamente.

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