

# Relatório Mensal

2020  
Julho

---

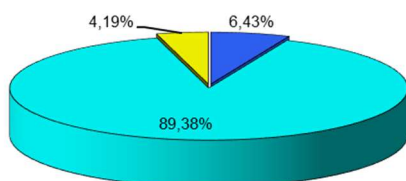
Instituto de Previdência e Assistência do Município do Rio de Janeiro - PREVI-RIO

DIRETORIA DE INVESTIMENTOS

# Composição da Carteira

## Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

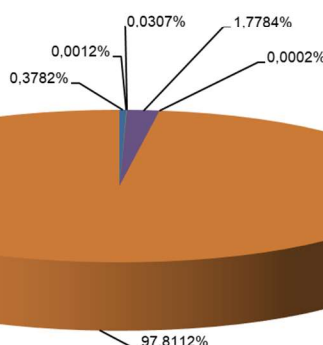
### TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)



Valor da Carteira pelo Mercado	
PREVI-RIO	R\$ 61.891.456,07
FUNPREVI	R\$ 859.716.437,69
FASS	R\$ 40.293.809,49



### FUNPREVI



Valor por Tipo de Ativo pelo Mercado	
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	R\$ 3.251.712,10
FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 10.697,06
Santander Cash Blue FI RF Referenciado DI	R\$ 263.987,91
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 15.289.524,62
Ações	R\$ 1.416,00
Subtotal Valores Mobiliários Funprevi	R\$ 18.817.337,69
Imóveis	R\$ 840.899.100,00
Total Carteira Funprevi	R\$ 859.716.437,69

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 (Julho 2020)	R\$ 328.378.623,38

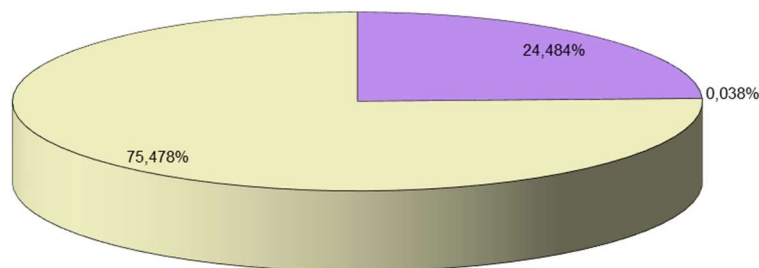
Aluguéis Recebidos	
Julho 2020	R\$ 4.032.627,58

(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

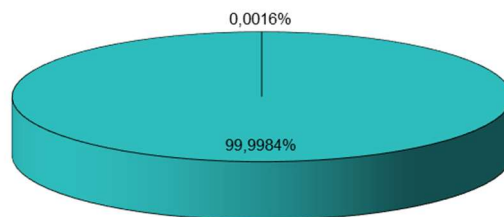
### PREVI-RIO



■ 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\$ 15.153.463,06
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	R\$ 23.701,04
Subtotal Valores Mobiliários Previ-Rio	R\$ 15.177.164,10
Imóveis	R\$ 46.714.291,97
<b>Total Carteira Previ-Rio</b>	<b>R\$ 61.891.456,07</b>

### FASS



■ FI CAIXA PCRJ RF ■ FI Caixa Brasil Disponibilidades RF

Valor da Carteira	
FI CAIXA PCRJ RF	R\$ 40.293.147,98
FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 661,51
<b>Total Carteira FASS</b>	<b>R\$ 40.293.809,49</b>

# Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

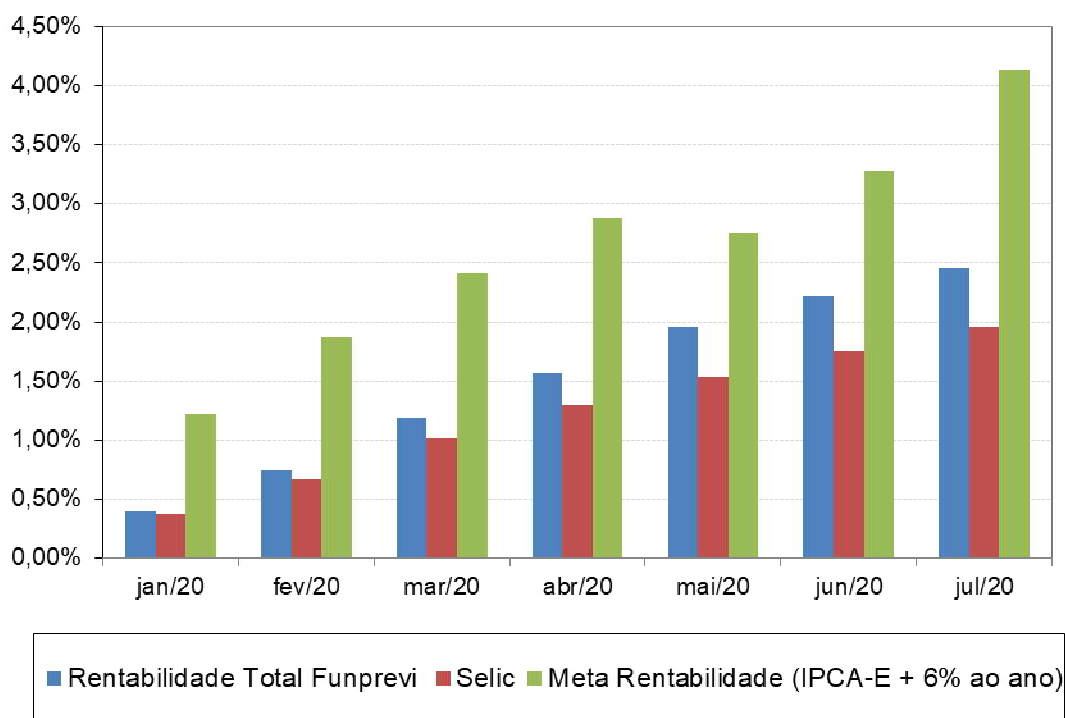
## FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	jul/20	Acum. Ano	jul/20	Acum. 2020	jul/20	Acum. 2020
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,25%	1,62%	29,69%	39,17%	127,85%	83,02%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,12%	1,46%	13,91%	35,23%	59,89%	74,66%
Santander Cash Blue FI RF Referenciado DI	0,16%	1,70%	18,79%	41,01%	80,92%	86,92%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,24%	2,73%	28,80%	66,01%	124,04%	139,91%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Funprevi	0,23%	2,45%	28,01%	59,26%	120,64%	125,61%
Meta Rentabilidade	0,84%	4,14%				
Selic	0,19%	1,95%				

### 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

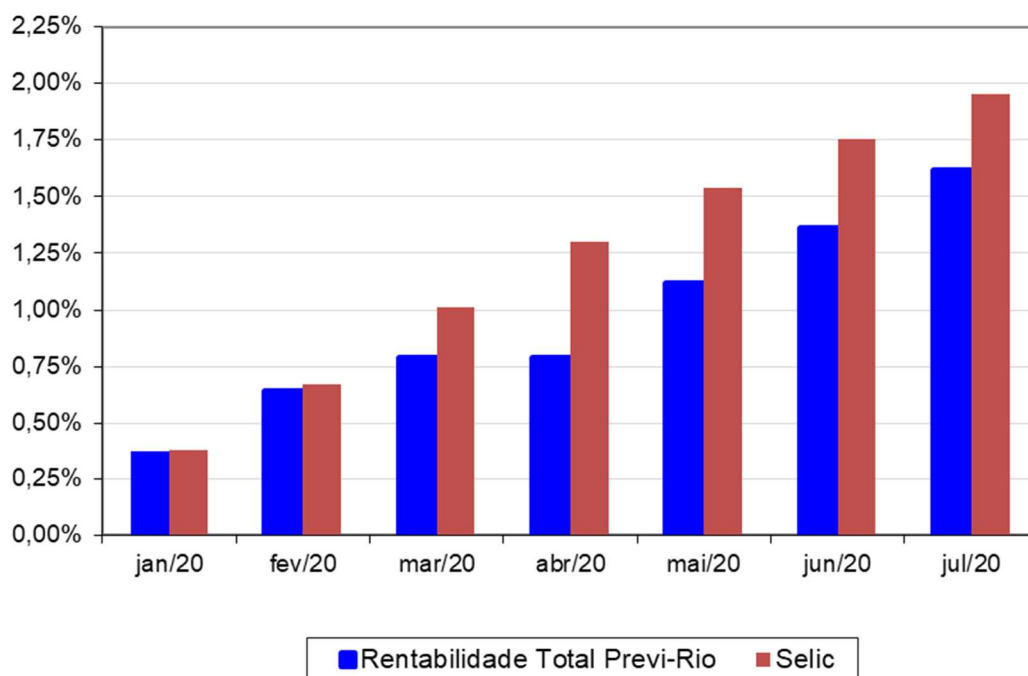
## PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	jul/20	Acum. Ano	jul/20	Acum. 2020
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,25%	1,62%	127,85%	83,02%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,12%	1,46%	59,89%	74,66%
Rentabilidade Total Previ-Rio	0,25%	1,62%	127,76%	82,85%
Selic	0,19%	1,95%		

### OBSERVAÇÕES:

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

### Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



# Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

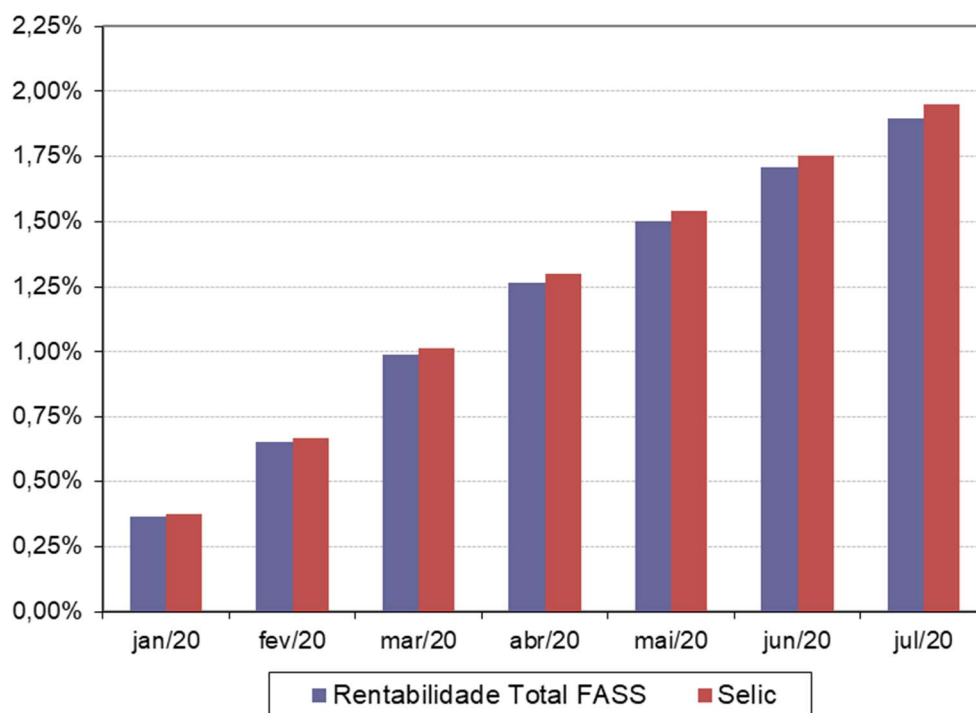
## FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	jul/20	Acum. Ano	jul/20	Acum. 2020
FI CAIXA PCRJ RF	0,18%	1,90%	94,59%	97,14%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,12%	1,46%	59,89%	74,66%
Rentabilidade Total FASS	0,18%	1,90%	94,59%	97,13%
Selic	0,19%	1,95%		

### 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 julho, rentabilidades em relação à meta de rentabilidade <sup>(1)</sup> de 13,91% (Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa), 29,69% (Caixa Brasil Referenciado DI LP) e 28,80% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal; e 18,79% 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 28,01% em relação à meta e de 120,64% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 59,26% e de 125,61% em relação à meta e à taxa Selic, respectivamente.

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