

Relatório Mensal

2020

Outubro

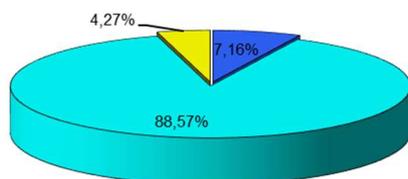
Instituto de Previdência e Assistência do Município do Rio de Janeiro - PREVI-RIO

DIRETORIA DE
INVESTIMENTOS

Composição da Carteira

Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

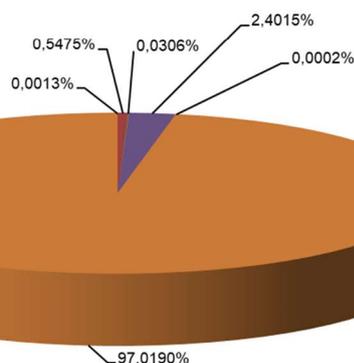
TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)



Valor da Carteira pelo Mercado	
PREVI-RIO	R\$ 69.986.978,31
FUNPREVI	R\$ 865.401.958,60
FASS	R\$ 41.733.264,59



FUNPREVI



Valor por Tipo de Ativo pelo Mercado	
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	R\$ 10.906,12
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 4.737.966,24
Santander Cash Blue FI RF Referenciado DI	R\$ 264.463,19
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 20.782.707,05
Ações	R\$ 1.416,00
Subtotal Valores Mobiliários Funprevi	R\$ 25.797.458,60
Imóveis	R\$ 839.604.500,00
Total Carteira Funprevi	R\$ 865.401.958,60

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

Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos	
Saldo (Outubro 2020)	R\$ 319.571.266,17

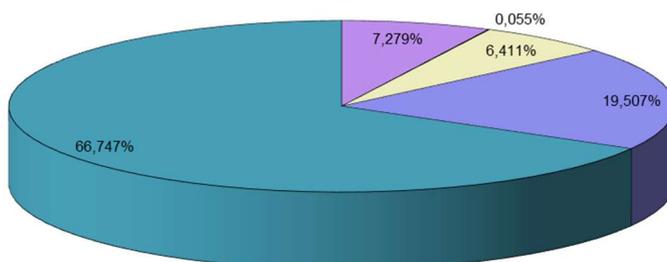
Aluguéis Recebidos	
Outubro 2020	R\$ 4.032.627,58

(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

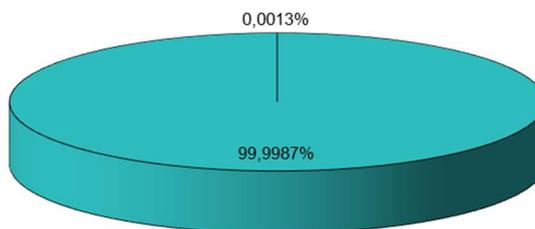
PREVI-RIO



FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	FI Caixa PCRJ RF
Imóveis	

Valor da Carteira	
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R\$ 5.094.438,85
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 38.660,91
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	R\$ 4.487.140,02
FI Caixa PCRJ RF	R\$ 13.652.446,56
Subtotal Valores Mobiliários Previ-Rio	R\$ 23.272.686,34
Imóveis	R\$ 46.714.291,97
Total Carteira Previ-Rio	R\$ 69.986.978,31

FASS



FI CAIXA PCRJ RF	FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF
------------------	---

Valor da Carteira	
FI CAIXA PCRJ RF	R\$ 41.732.715,46
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 549,13
Total Carteira FASS	R\$ 41.733.264,59

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

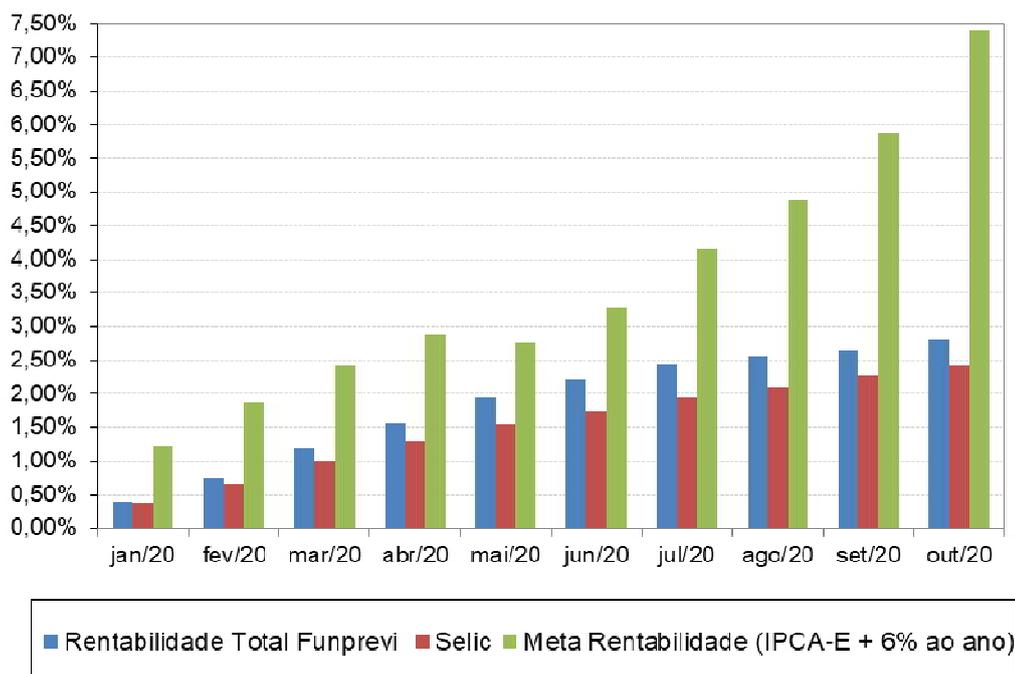
FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	out/20	Acum. Ano	out/20	Acum. 2020	out/20	Acum. 2020
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,12%	1,89%	8,39%	25,54%	76,62%	77,49%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,09%	1,73%	6,06%	23,35%	55,36%	70,85%
Santander Cash Blue FI RF Referenciado DI	0,09%	1,88%	5,99%	25,43%	54,73%	77,17%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,14%	3,11%	9,97%	42,14%	91,03%	127,86%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Funprevi	0,14%	2,80%	9,94%	37,90%	90,75%	115,01%
Meta Rentabilidade	1,43%	7,39%				
Selic	0,16%	2,44%				

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.
- 3) Razão Social do FI Caixa Brasil Disponibilidades RF foi alterado para FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF.

Rentabilidade Acumulada - Funprevi x Meta Rentabilidade x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

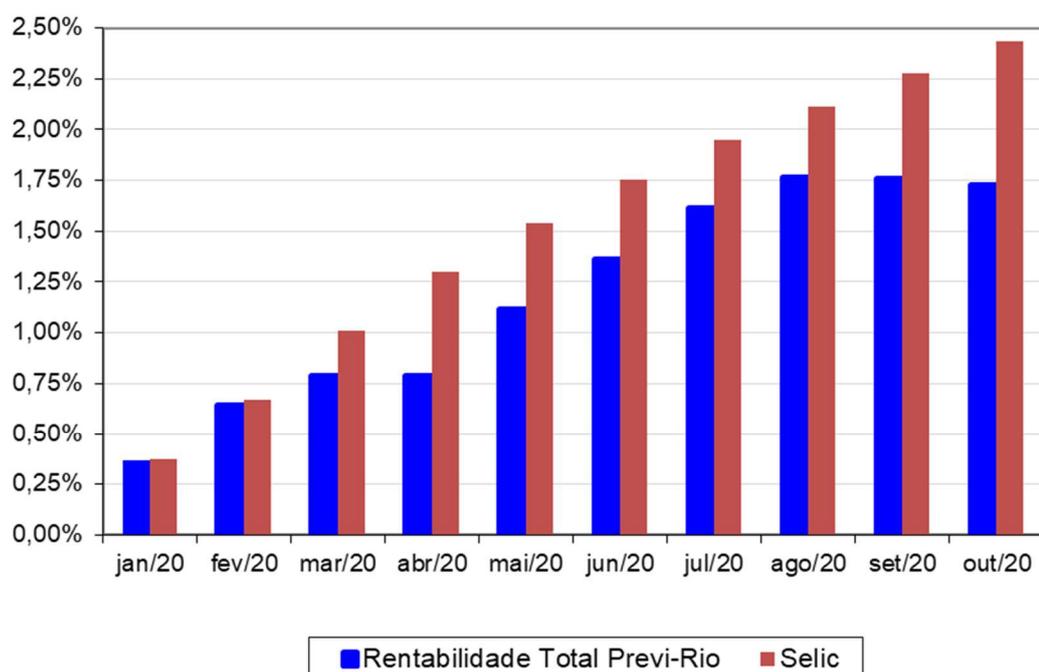
PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	out/20	Acum. Ano	out/20	Acum. 2020
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,12%	1,89%	76,62%	77,49%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,09%	1,73%	55,36%	70,85%
FI Caixa PCRJ RF	0,07%	0,07%	94,44%	94,44%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,05%	0,05%	91,24%	91,24%
Rentabilidade Total Previ-Rio	-0,03%	1,73%	-20,67%	70,97%
Selic	0,16%	2,44%		

OBSERVAÇÕES:

- 1) Aplicações informadas com posição de fechamento do último dia útil.
- 2) A aplicação inicial no Caixa FI PCRJ RF, na carteira do Previ-Rio, ocorreu em 16/10/2020, portanto a rentabilidade do mês de outubro é parcial, assim como a rentabilidade acumulada do ano.
- 3) A aplicação inicial no Fundo de Investimento Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa, na carteira do Previ-Rio, ocorreu em 21/10/2020, portanto a rentabilidade do mês de outubro é parcial, assim como a rentabilidade acumulada do ano.
- 4) Razão Social do FI Caixa Brasil Disponibilidades RF foi alterado para FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF.

Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

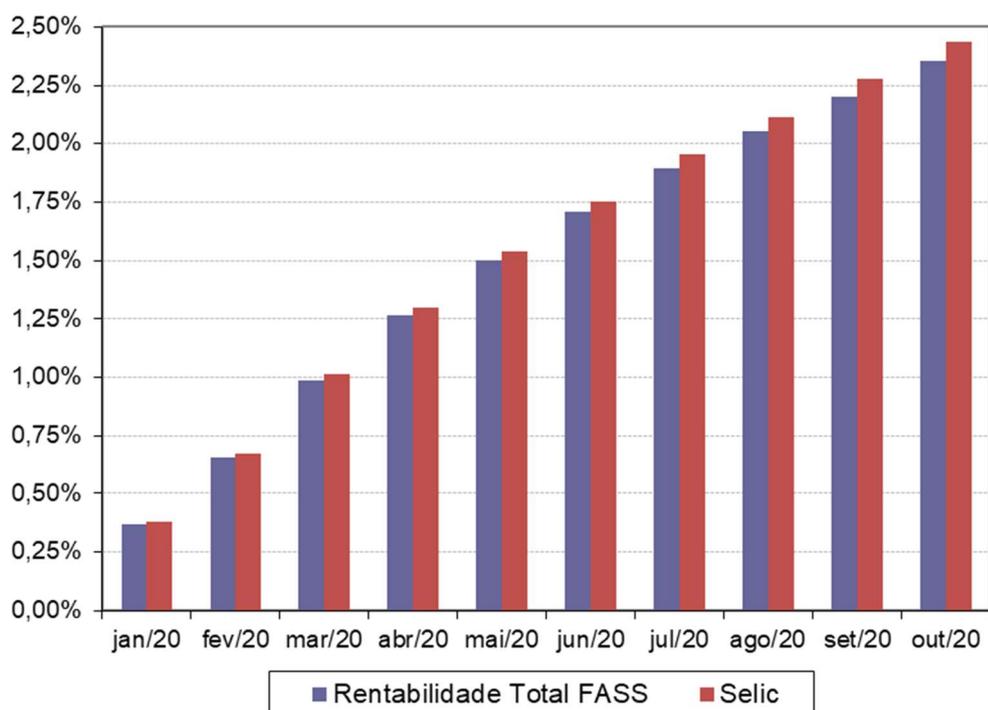
FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	out/20	Acum. Ano	out/20	Acum. 2020
FI Caixa PCRJ RF	0,15%	2,35%	94,38%	96,63%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,09%	1,73%	55,36%	70,85%
Rentabilidade Total FASS	0,15%	2,35%	94,38%	96,62%
Selic	0,16%	2,44%		

OBSERVAÇÕES:

- 1) Aplicações informadas com posição de fechamento do último dia útil.
- 2) Razão Social do FI Caixa Brasil Disponibilidades RF foi alterado para FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF.

Rentabilidade Acumulada - FASS x Selic



CARTEIRA FUNPREVI

Os fundos de investimentos que compõem a carteira do FUNPREVI apresentaram, em outubro, rentabilidades em relação à meta de rentabilidade ⁽¹⁾ de 6,06% (FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF), 8,39% (Caixa Brasil Referenciado DI LP) e 9,97% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal; e 5,99% 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 9,94% em relação à meta e de 90,75% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 37,90% e de 115,01% em relação à meta e à taxa Selic, respectivamente.

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