

Relatório Mensal

2020

Novembro

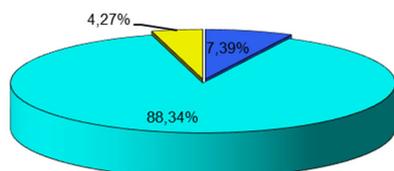
Instituto de Previdência e Assistência do Município do Rio de Janeiro - PREVI-RIO

DIRETORIA DE
INVESTIMENTOS

Composição da Carteira

Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

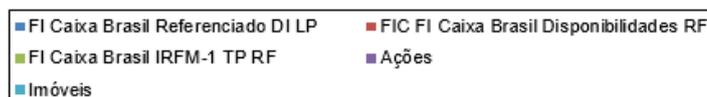
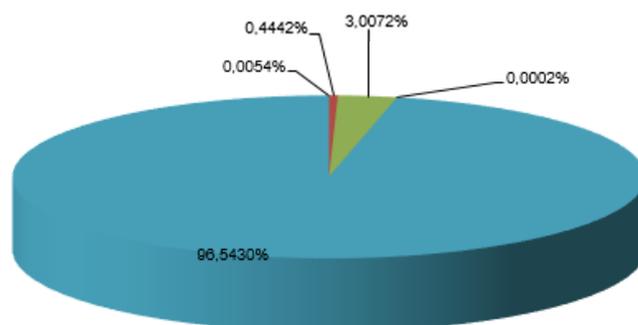
TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)



Valor da Carteira pelo Mercado	
PREVI-RIO	R\$ 72.784.046,55
FUNPREVI	R\$ 869.668.545,69
FASS	R\$ 42.007.760,67



FUNPREVI



Valor por Tipo de Ativo pelo Mercado	
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	R\$ 46.783,86
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 3.863.177,98
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 26.152.667,85
Ações	R\$ 1.416,00
Subtotal Valores Mobiliários Funprevi	R\$ 30.064.045,69
Imóveis	R\$ 839.604.500,00
Total Carteira Funprevi	R\$ 869.668.545,69

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

Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos	
Saldo (Novembro 2020)	R\$ 317.490.701,21

Aluguéis Recebidos	
Novembro 2020	R\$ 8.065.255,16

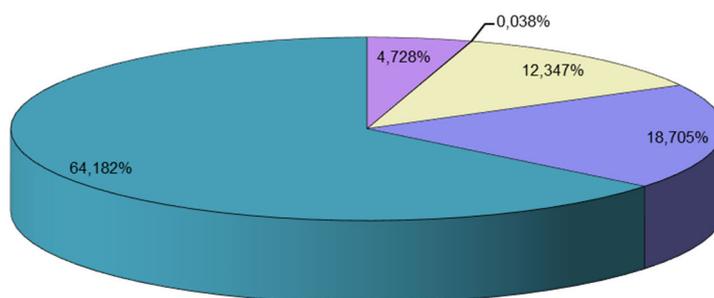
OBSERVAÇÕES:

- (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).
- (2) Os recursos aplicados no Fundo Santander Cash Blue RF Referenciado DI FI foram integralmente resgatados em 11/11/2020 no valor de R\$ 264.549,18.

Composição da Carteira

Ativos Mobiliários e Imobiliários

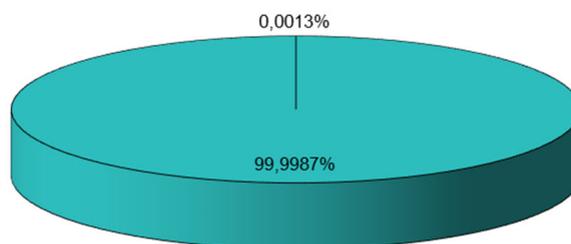
PREVI-RIO



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\$ 3.441.400,50
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 27.485,76
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	R\$ 8.986.375,36
FI Caixa PCRJ RF	R\$ 13.614.492,96
Subtotal Valores Mobiliários Previ-Rio	R\$ 26.069.754,58
Imóveis	R\$ 46.714.291,97
Total Carteira Previ-Rio	R\$ 72.784.046,55

FASS



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

Valor da Carteira	
FI CAIXA PCRJ RF	R\$ 42.007.197,15
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 563,52
Total Carteira FASS	R\$ 42.007.760,67

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

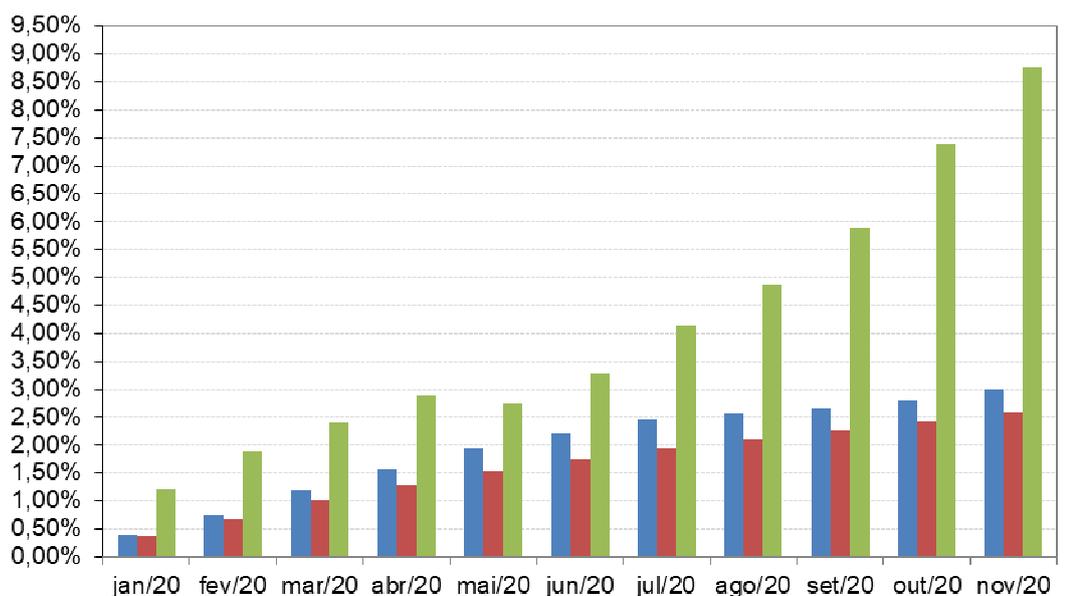
FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	nov/20	Acum. Ano	nov/20	Acum. 2020	nov/20	Acum. 2020
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,15%	2,05%	12,10%	23,33%	103,54%	79,00%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,08%	1,81%	6,43%	20,65%	55,06%	69,89%
Santander Cash Blue FI RF Referenciado DI	0,03%	1,91%	7,29%	24,31%	62,18%	76,84%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,22%	3,34%	16,86%	38,07%	144,23%	128,88%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Funprevi	0,19%	3,00%	15,16%	34,23%	129,69%	115,90%
Meta Rentabilidade	1,28%	8,77%				
Selic	0,15%	2,59%				

OBSERVAÇÕES:

- 1) Aplicações informadas com posição de fechamento do último dia útil.
- 2) Os recursos aplicados no Fundo Santander Cash Blue RF Referenciado DI FI foram integralmente resgatados em 11/11/2020, portanto a rentabilidade do mês assim como a do ano é parcial.
- 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 Total Funprevi ■ Selic ■ Meta Rentabilidade (IPCA-E + 6% ao ano)

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

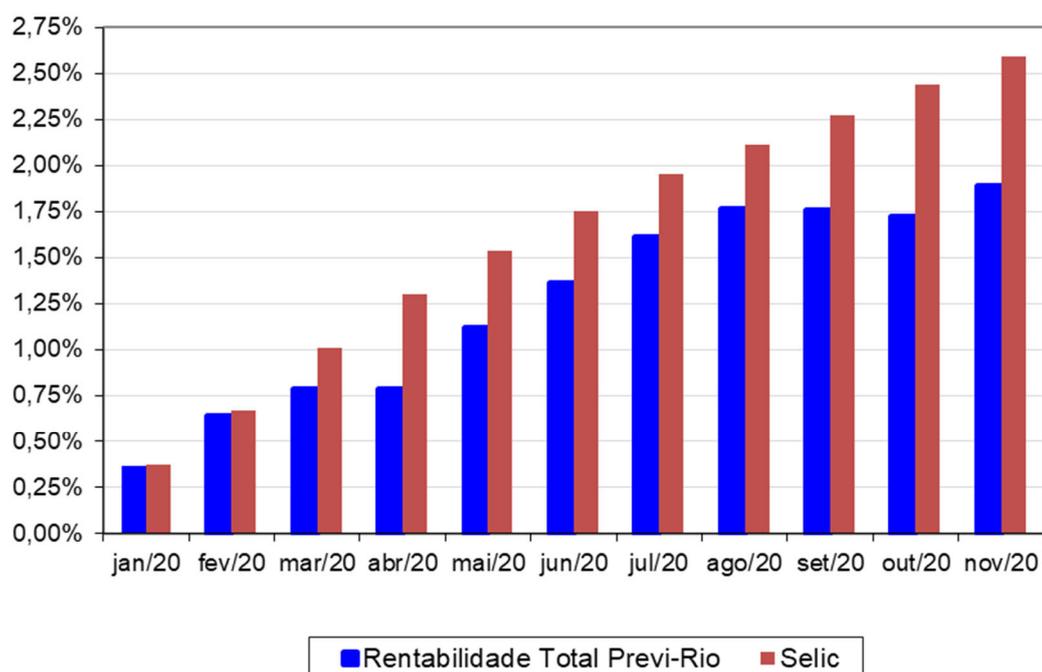
PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	nov/20	Acum. Ano	nov/20	Acum. 2020
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,15%	2,05%	103,54%	79,00%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,08%	1,81%	55,06%	69,89%
FI Caixa PCRJ RF	0,14%	0,21%	94,52%	94,49%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,22%	0,26%	144,23%	130,50%
Rentabilidade Total Previ-Rio	0,16%	1,89%	107,00%	73,06%
Selic	0,15%	2,59%		

OBSERVAÇÕES:

- 1) Aplicações informadas com posição de fechamento do último dia útil.
- 2) A aplicação inicial no Caixa FI PCRJ RF ocorreu em 16/10/2020, portanto a rentabilidade acumulada do ano é parcial.
- 3) A aplicação inicial no Fundo de Investimento Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa ocorreu em 21/10/2020, portanto a rentabilidade acumulada do ano é parcial.
- 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

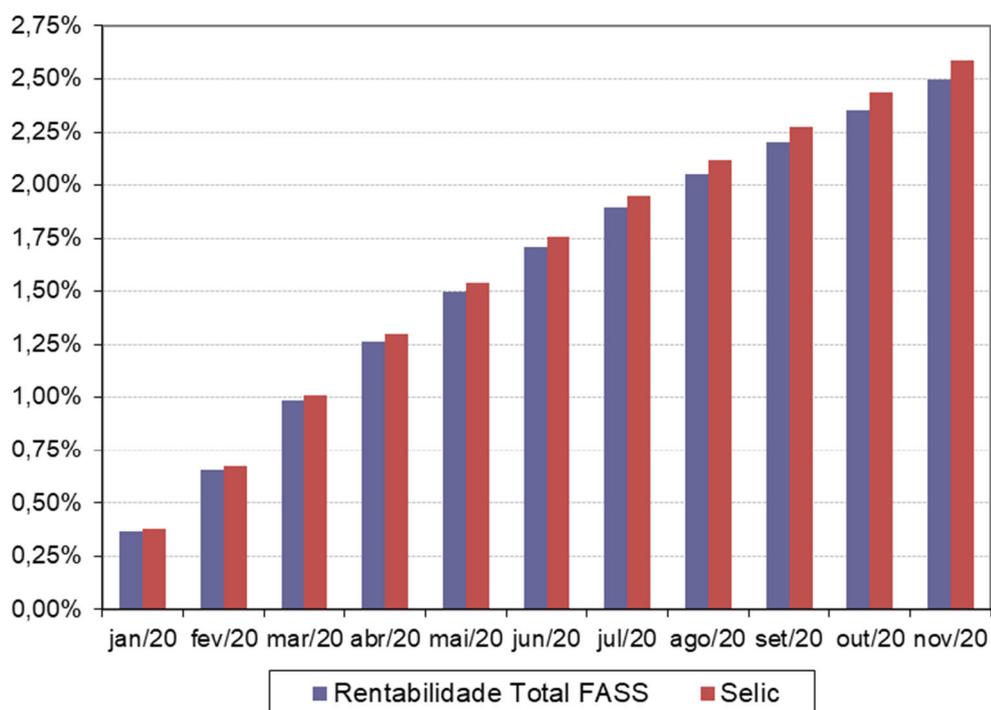
FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	nov/20	Acum. Ano	nov/20	Acum. 2020
FI Caixa PCRJ RF	0,14%	2,50%	94,52%	96,51%
FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	0,08%	1,81%	55,06%	69,89%
Rentabilidade Total FASS	0,14%	2,50%	94,52%	96,50%
Selic	0,15%	2,59%		

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 novembro, rentabilidades em relação à meta de rentabilidade ⁽¹⁾ de 6,43% (FIC FI Caixa Brasil Disponibilidades RF), 12,10% (Caixa Brasil Referenciado DI LP) e 16,86% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal; e 7,29% no fundo onde foram integralmente resgatados em 11/11/2020 (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 15,16% em relação à meta e de 129,69% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 34,23% e de 115,90% em relação à meta e à taxa Selic, respectivamente.

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