# Relatório Mensal

2019

# Abril

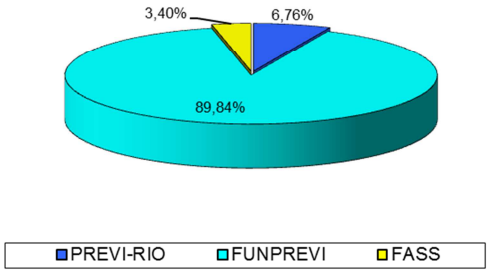
Instituto de Previdência e Assistência do Município do Rio de Janeiro - PREVI-RIO

DIRETORIA DE INVESTIMENTOS

# *Composição da Carteira*

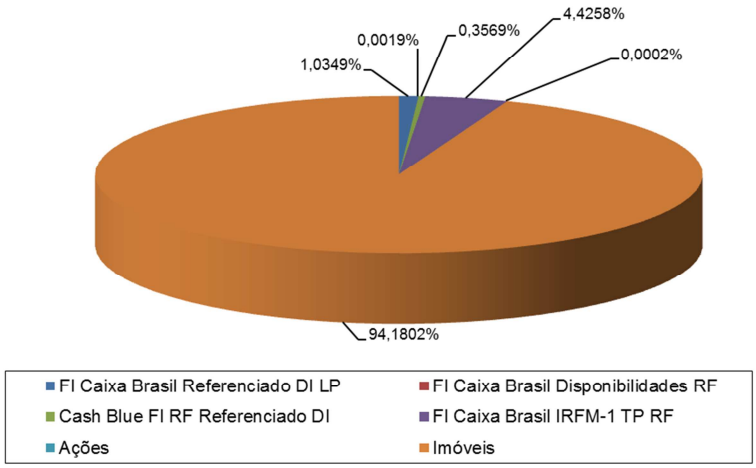
## *Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties*

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




| Valor da Carteira pelo Mercado | | |
|---|---|---|
| PREVI-RIO | R$ | 45.052.432,87 |
| FUNPREVI | R$ | 599.142.804,54 |
| FASS | R$ | 22.686.353,93 |

## FUNPREVI




| Valor por Tipo de Ativo pelo Mercado | | |
|---|---|---|
| FI Caixa Brasil Referenciado DI LP | R$ | 6.200.763,50 |
| FI Caixa Brasil Disponibilidades RF | R$ | 11.536,17 |
| Cash Blue FI RF Referenciado DI | R$ | 2.138.132,17 |
| FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF | R$ | 26.516.956,70 |
| Ações | R$ | 1.416,00 |
| Subtotal Valores Mobiliários Funprevi | R$ | 34.868.804,54 |
| Imóveis | R$ | 564.274.000,00 |
| Total Carteira Funprevi | R$ | 599.142.804,54 |

| Estoque de Royalties de Petróleo (a vencer) | | |
|---|---|---|
| Valor Presente | R$ | 4.568.938.495,94 |

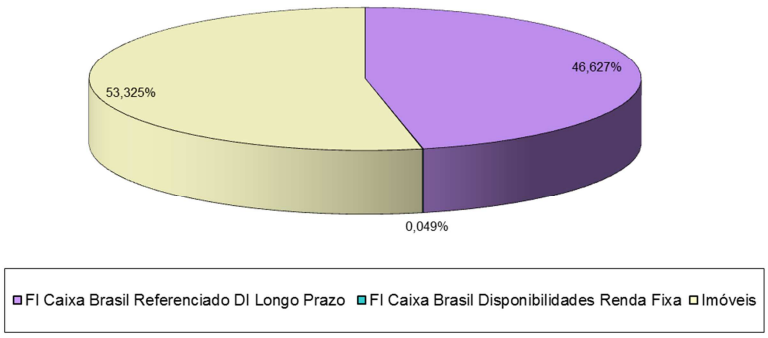
| Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos | | |
|---|---|---|
| Saldo (abril 2019) | R$ | 403.996.553,27 |

| Valor de Aluguel Mensal dos Imóveis | | |
|---|---|---|
| Abril 2019 | R$ | 3.880.764,99 |

# Composição da Carteira

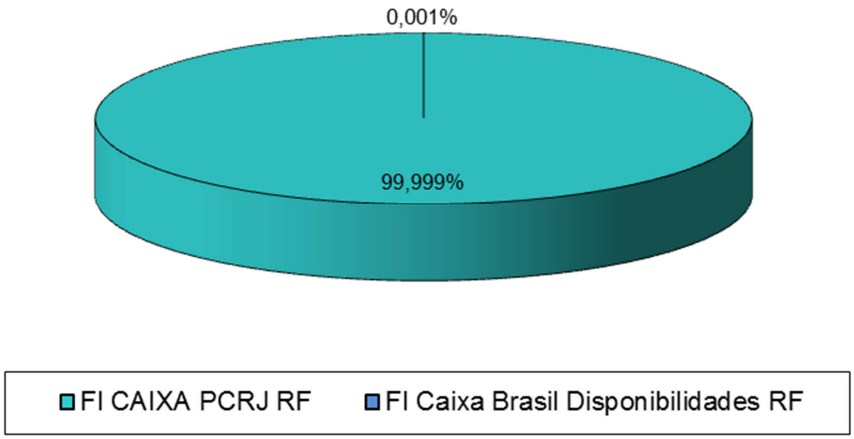
# Ativos Mobiliários e Imobiliários

## PREVI-RIO




| Valor da Carteira | | |
|---|---|---|
| FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo | R$ | 21.006.436,70 |
| FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa | R$ | 22.004,20 |
| Subtotal Valores Mobiliários Previ-Rio | R$ | 21.028.440,90 |
| Imóveis | R$ | 24.023.991,97 |
| Total Carteira Previ-Rio | R$ | 45.052.432,87 |

## FASS




| Valor da Carteira | | |
|---|---|---|
| FI CAIXA PCRJ RF | R$ | 22.686.188,69 |
| FI Caixa Brasil Disponibilidades RF | R$ | 165,24 |
| Total Carteira FASS | R$ | 22.686.353,93 |

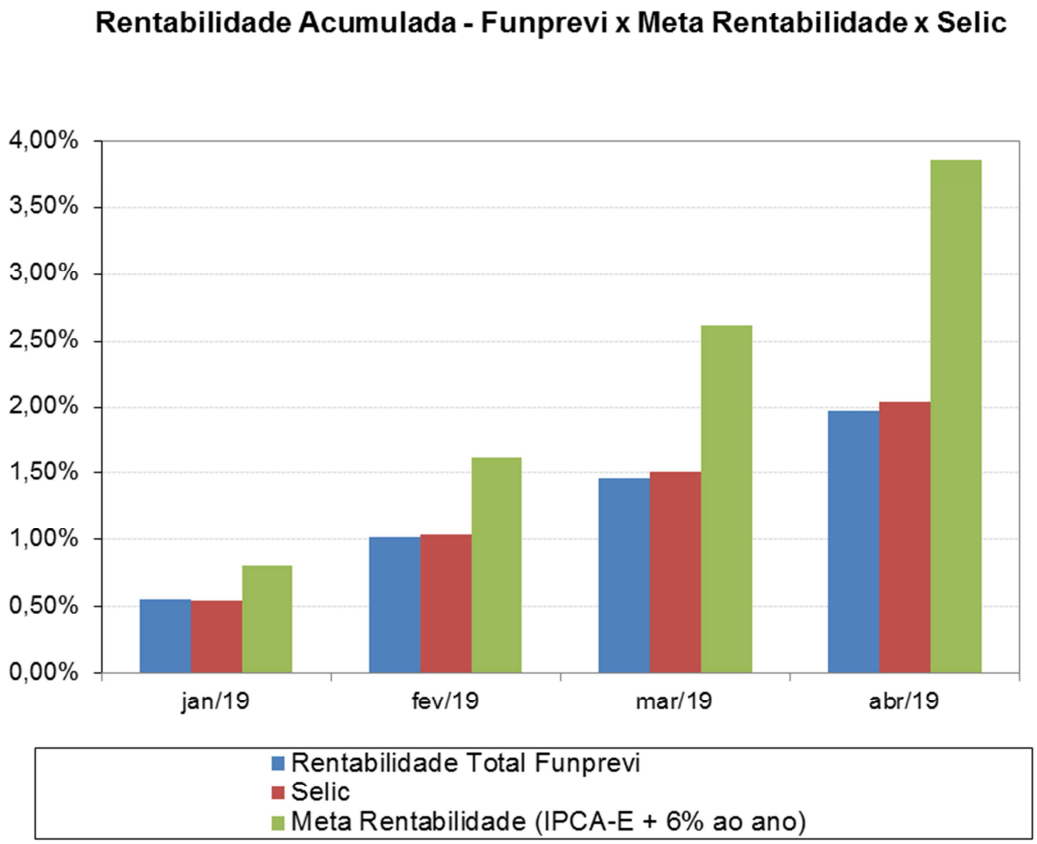
# Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

## FUNPREVI

| ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI | Rentabilidade Nominal | | Rentabilidade em relação à Meta | | Rentabilidade em relação à Selic | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | abr/19 | Acum. Ano | abr/19 | Acum. 2019 | abr/19 | Acum. 2019 |
| FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo | 0,51% | 2,00% | 41,93% | 51,86% | 97,74% | 98,07% |
| FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa | 0,45% | 1,76% | 37,09% | 45,63% | 86,47% | 86,29% |
| Santander Cash Blue RF Referenciado DI FI | 0,48% | 1,90% | 40,08% | 49,36% | 93,43% | 93,35% |
| FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa | 0,50% | 1,98% | 41,50% | 51,23% | 96,75% | 96,87% |
| Ações | Não aplicável | Não aplicável | Não aplicável | Não aplicável | Não aplicável | Não aplicável |
| Rentabilidade Total Funprevi | 0,50% | 1,97% | 41,17% | 51,03% | 95,97% | 96,49% |
| Meta Rentabilidade | 1,21% | 3,86% | | | | |
| Selic | 0,52% | 2,04% | | | | |

OBSERVAÇÕES::

1) Aplicações informadas com posição de fechamento do último dia útil.
2) Os recursos aplicados no Santander Cash Blue RF Referenciado DI FI (antigo Fundo 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.



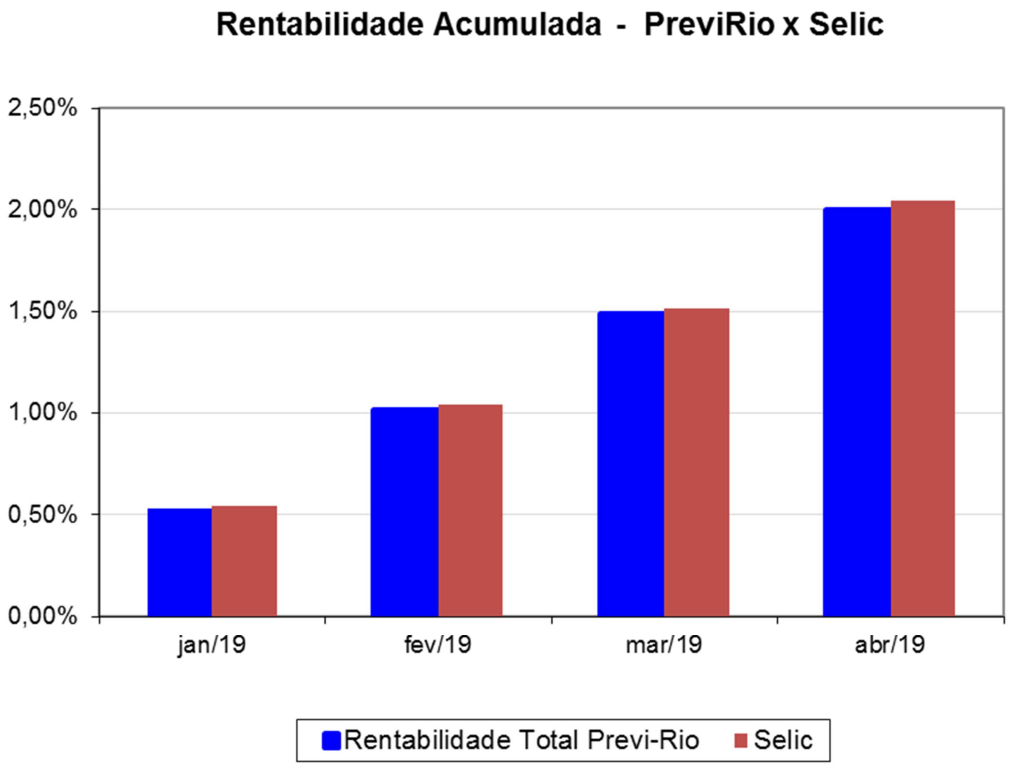
# Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

## PREVI-RIO

| ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO | Rentabilidade Nominal | | Rentabilidade em relação à Selic | |
|---|---|---|---|---|
| | abr/19 | Acum. Ano | abr/19 | Acum. 2019 |
| FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo | 0,51% | 2,00% | 97,74% | 98,07% |
| FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa | 0,45% | 1,76% | 86,47% | 86,29% |
| Rentabilidade Total Previ-Rio | 0,51% | 2,00% | 97,73% | 98,06% |
| Selic | 0,52% | 2,04% | | |

OBSERVAÇÔES:

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



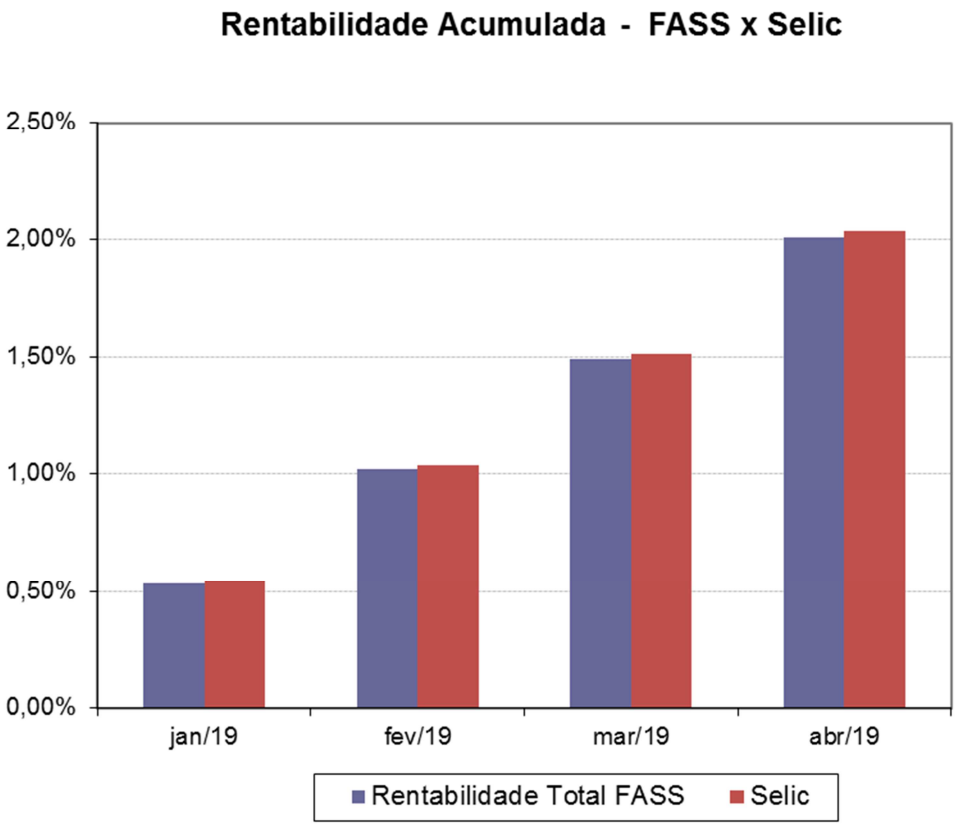
# Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

## FASS

| ATIVOS FINANCEIROS - FASS | Rentabilidade Nominal | | Rentabilidade em relação à Selic | |
|---|---|---|---|---|
| | abr/19 | Acum. Ano | abr/19 | Acum. 2019 |
| FI CAIXA PCRJ RF | 0,51% | 2,01% | 98,61% | 98,50% |
| FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa | 0,45% | 1,76% | 86,47% | 86,29% |
| Rentabilidade Total FASS | 0,51% | 2,01% | 98,60% | 98,50% |
| Selic | 0,52% | 2,04% | | |

OBSERVAÇÕES:

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



**CARTEIRA FUNPREVI**

Os fundos de investimentos que compõem a carteira do FUNPREVI apresentaram, em abril, rentabilidades em relação à meta de rentabilidade [(1)] de 37,09% (Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa), 41,93% (Caixa Brasil Referenciado DI LP) e 41,50% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal; e 40,08% 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 de no mês 41,17% em relação à meta e 95,97% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 51,03% e 96,49% em relação à meta e à taxa Selic, respectivamente.

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