

Relatório Mensal

2019
Maio

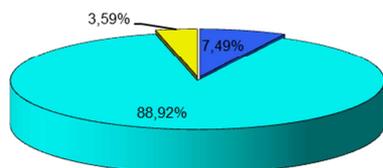
Instituto de Previdência e Assistência do Município do Rio de Janeiro - PREVI-RIO

DIRETORIA DE
INVESTIMENTOS

Composição da Carteira

Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

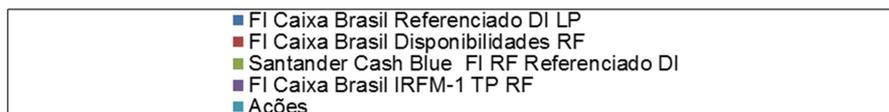
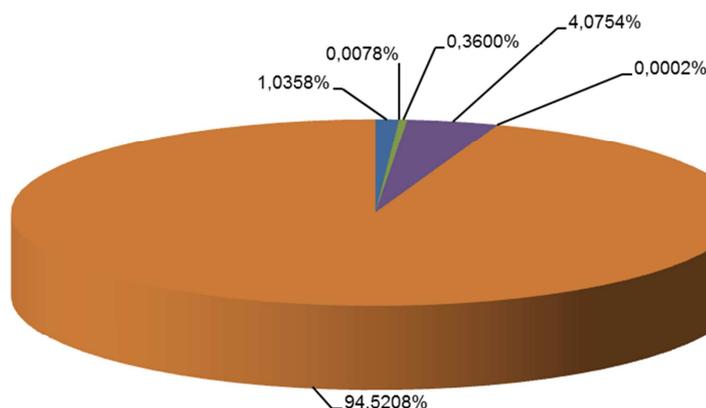
TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)



Valor da Carteira pelo Mercado	
PREVI-RIO	R\$ 50.306.456,66
FUNPREVI	R\$ 596.984.096,46
FASS	R\$ 24.116.034,00



FUNPREVI



Valor por Tipo de Ativo pelo Mercado	
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	R\$ 6.183.272,95
FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 46.810,99
Santander Cash Blue FI RF Referenciado DI	R\$ 2.148.985,17
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 24.329.611,35
Ações	R\$ 1.416,00
Subtotal Valores Mobiliários Funprevi	R\$ 32.710.096,46
Imóveis	R\$ 564.274.000,00
Total Carteira Funprevi	R\$ 596.984.096,46

Estoque de Royalties de Petróleo (a vencer)	
Valor Presente	R\$ 4.506.769.160,85

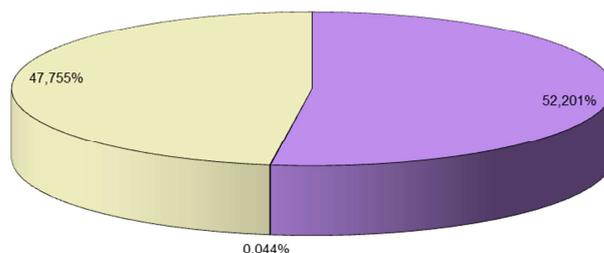
Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos	
Saldo (maio 2019)	R\$ 399.486.341,96

Valor de Aluguel Mensal dos Imóveis	
Maio 2019	R\$ 3.880.764,99

Composição da Carteira

Ativos Mobiliários e Imobiliários

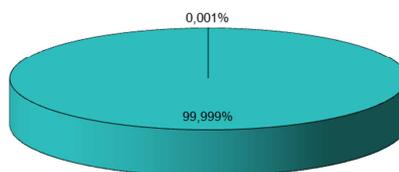
PREVI-RIO



■ 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\$ 26.260.302,98
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	R\$ 22.161,71
Subtotal Valores Mobiliários Previ-Rio	R\$ 26.282.464,69
Imóveis	R\$ 24.023.991,97
Total Carteira Previ-Rio	R\$ 50.306.456,66

FASS



■ FI CAIXA PCRJ RF ■ FI Caixa Brasil Disponibilidades RF

Valor da Carteira	
FI CAIXA PCRJ RF	R\$ 24.115.771,72
FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 262,28
Total Carteira FASS	R\$ 24.116.034,00

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

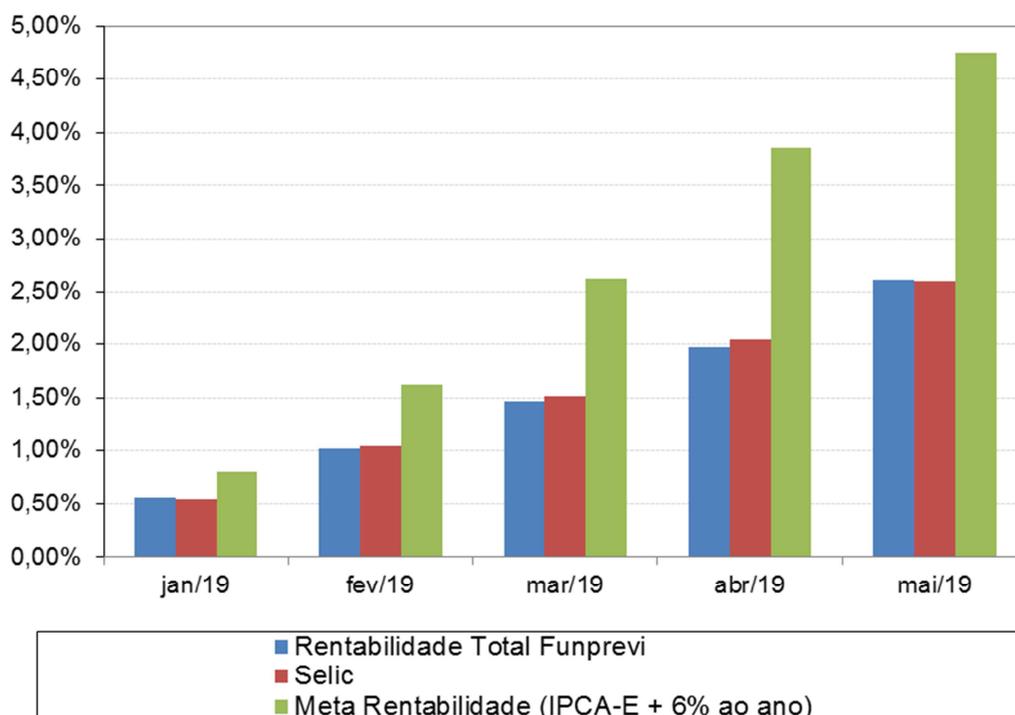
FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	mai/19	Acum. Ano	mai/19	Acum. 2019	mai/19	Acum. 2019
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,54%	2,55%	62,33%	53,62%	98,69%	98,20%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,47%	2,24%	54,55%	47,10%	86,36%	86,25%
Santander Cash Blue FI RF Referenciado DI	0,51%	2,42%	59,04%	50,97%	93,47%	93,35%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,65%	2,64%	76,09%	55,64%	120,46%	101,90%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Funprevi	0,62%	2,60%	72,42%	54,80%	114,65%	100,35%
Meta Rentabilidade	0,86%	4,75%				
Selic	0,54%	2,59%				

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 Acumulada - Funprevi x Meta Rentabilidade x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

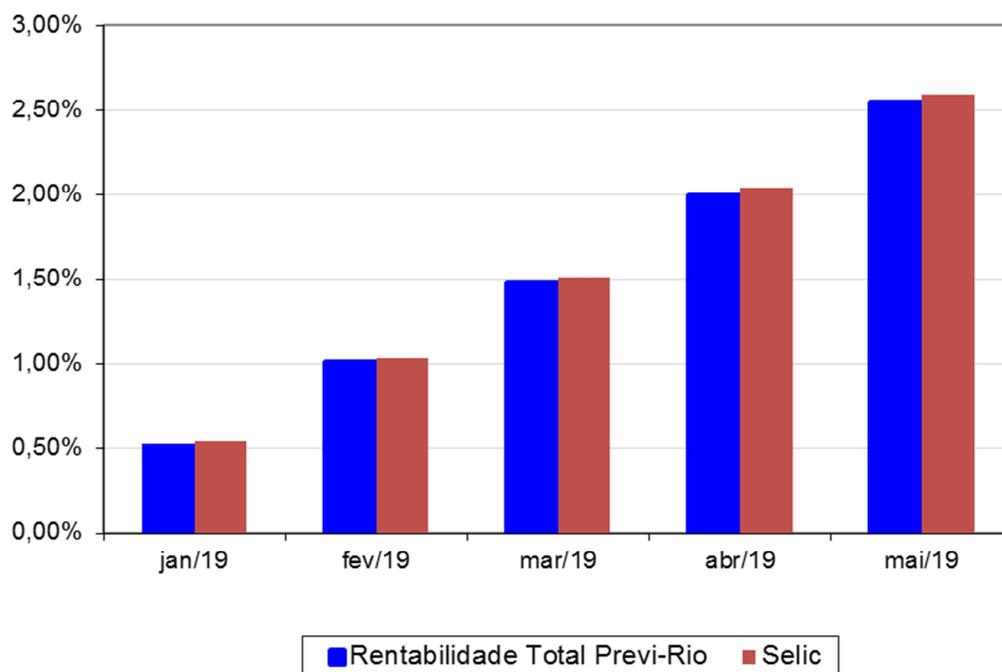
PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	mai/19	Acum. Ano	mai/19	Acum. 2019
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,54%	2,55%	98,69%	98,20%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,47%	2,24%	86,36%	86,25%
Rentabilidade Total Previ-Rio	0,54%	2,55%	98,68%	98,18%
Selic	0,54%	2,59%		

OBSERVAÇÕES:

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

Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

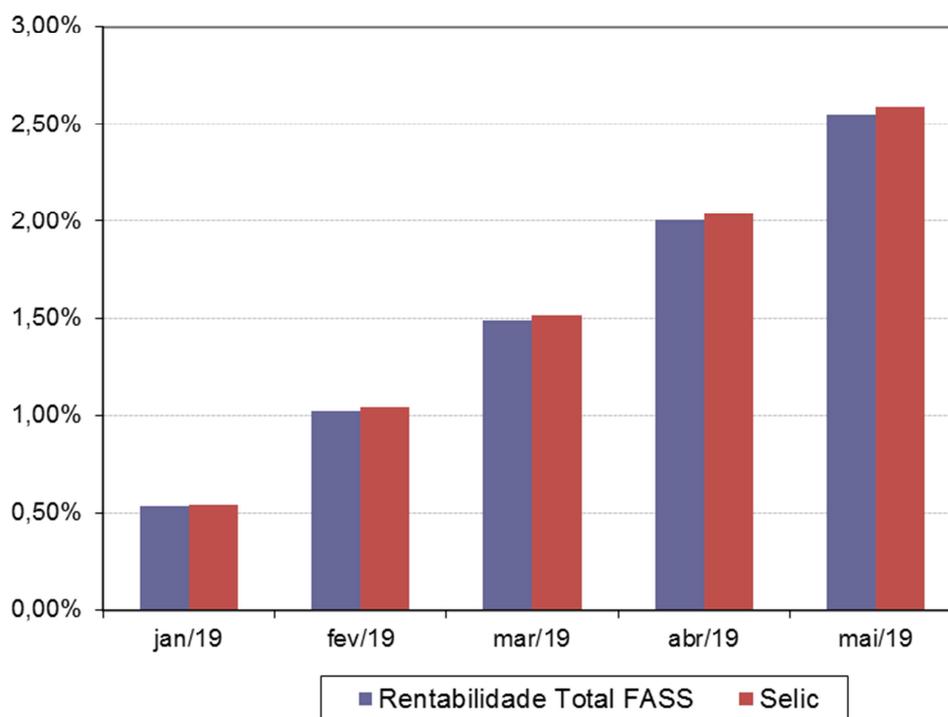
FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	mai/19	Acum. Ano	mai/19	Acum. 2019
FI CAIXA PCRJ RF	0,53%	2,55%	98,48%	98,49%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,47%	2,24%	86,36%	86,25%
Rentabilidade Total FASS	0,53%	2,55%	98,48%	98,49%
Selic	0,54%	2,59%		

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 maio, rentabilidades em relação à meta de rentabilidade ⁽¹⁾ de 54,55% (Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa), 62,33% (Caixa Brasil Referenciado DI LP) e 76,09% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal; e 59,04% 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 72,42% em relação à meta e 114,65% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 54,80% e 100,35% em relação à meta e à taxa Selic, respectivamente.

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