

Relatório Mensal

2019

Junho

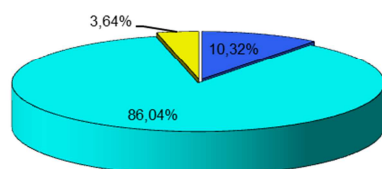
Instituto de Previdência e Assistência do Município do Rio de
Janeiro - PREVI-RIO

DIRETORIA DE
INVESTIMENTOS

Composição da Carteira

Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

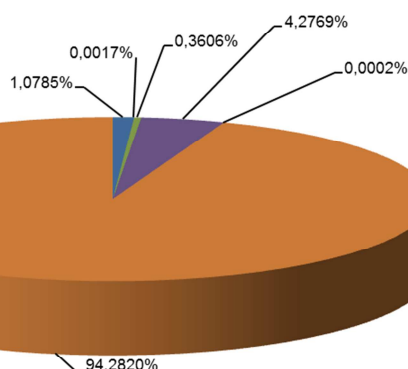
TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)



Valor da Carteira pelo Mercado	
PREVI-RIO	R\$ 71.797.706,89
FUNPREVI	R\$ 598.496.301,72
FASS	R\$ 25.320.248,04

■ PREVI-RIO ■ FUNPREVI ■ FASS

FUNPREVI



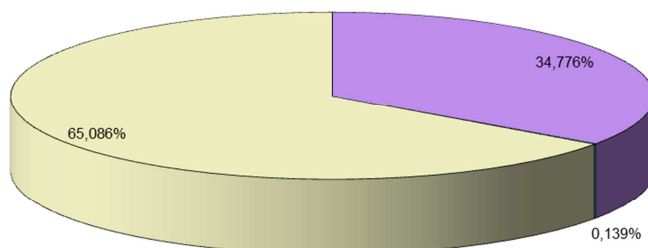
■ FI Caixa Brasil Referenciado DI LP ■ FI Caixa Brasil Disponibilidades RF
■ Santander Cash Blue FI RF Referenciado DI ■ FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF
■ Ações ■ Imóveis

Valor por Tipo de Ativo pelo Mercado	
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	R\$ 6.454.756,26
FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 10.377,29
Santander Cash Blue FI RF Referenciado DI	R\$ 2.158.398,85
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 25.597.353,32
Ações	R\$ 1.416,00
Subtotal Valores Mobiliários Funprevi	R\$ 34.222.301,72
Imóveis	R\$ 564.274.000,00
Total Carteira Funprevi	R\$ 598.496.301,72
Estoque de Royalties de Petróleo (a vencer)	
Valor Presente	R\$ 4.440.277.743,18
Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos	
Saldo (junho 2019)	R\$ 393.026.839,60
Valor de Aluguel Mensal dos Imóveis	
Junho 2019	R\$ 3.880.764,99

Composição da Carteira

Ativos Mobiliários e Imobiliários

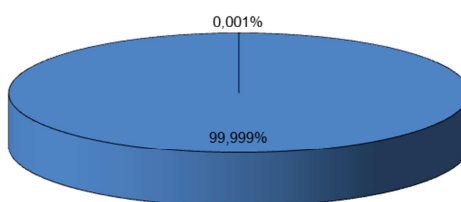
PREVI-RIO



■ 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\$ 24.968.082,49
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	R\$ 99.632,43
Subtotal Valores Mobiliários Previ-Rio	R\$ 25.067.714,92
Imóveis	R\$ 46.729.991,97
Total Carteira Previ-Rio	R\$ 71.797.706,89

FASS



■ FI CAIXA PCRJ RF ■ FI Caixa Brasil Disponibilidades RF

Valor da Carteira	
FI CAIXA PCRJ RF	R\$ 303,59
FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 25.319.944,45
Total Carteira FASS	R\$ 25.320.248,04

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

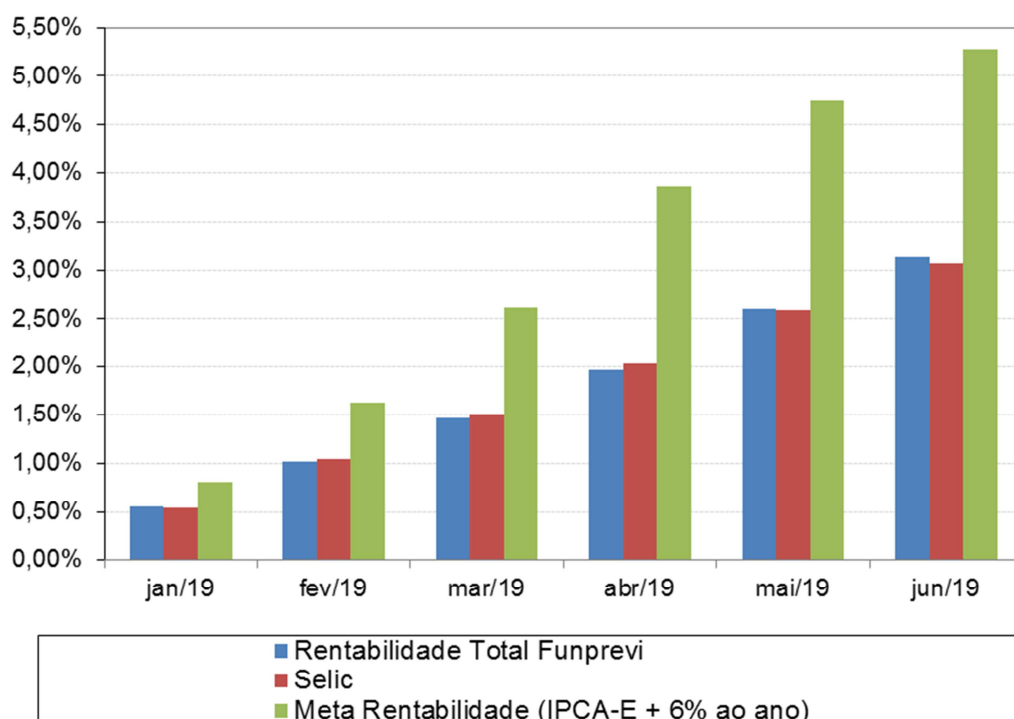
FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	jun/19	Acum. Ano	jun/19	Acum. 2019	jun/19	Acum. 2019
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,45%	3,01%	91,03%	57,14%	96,86%	97,98%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,41%	2,65%	81,27%	50,29%	86,46%	86,24%
Santander Cash Blue FI RF Referenciado DI	0,44%	2,87%	87,82%	54,43%	93,44%	93,34%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,57%	3,23%	114,96%	61,29%	122,32%	105,10%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Funprevi	0,52%	3,14%	104,78%	59,54%	111,48%	102,10%
Meta Rentabilidade	0,50%	5,27%				
Selic	0,47%	3,07%				

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

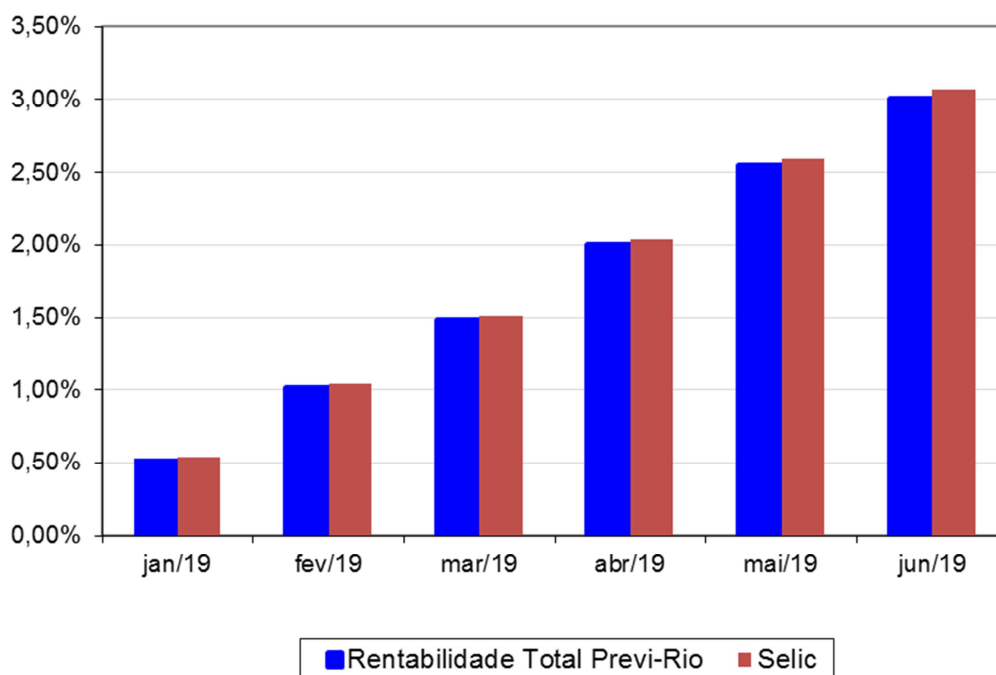
PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	jun/19	Acum. Ano	jun/19	Acum. 2019
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,45%	3,01%	96,86%	97,98%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,41%	2,65%	86,46%	86,24%
Rentabilidade Total Previ-Rio	0,45%	3,01%	96,85%	97,97%
Selic	0,47%	3,07%		

OBSERVAÇÕES:

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

Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

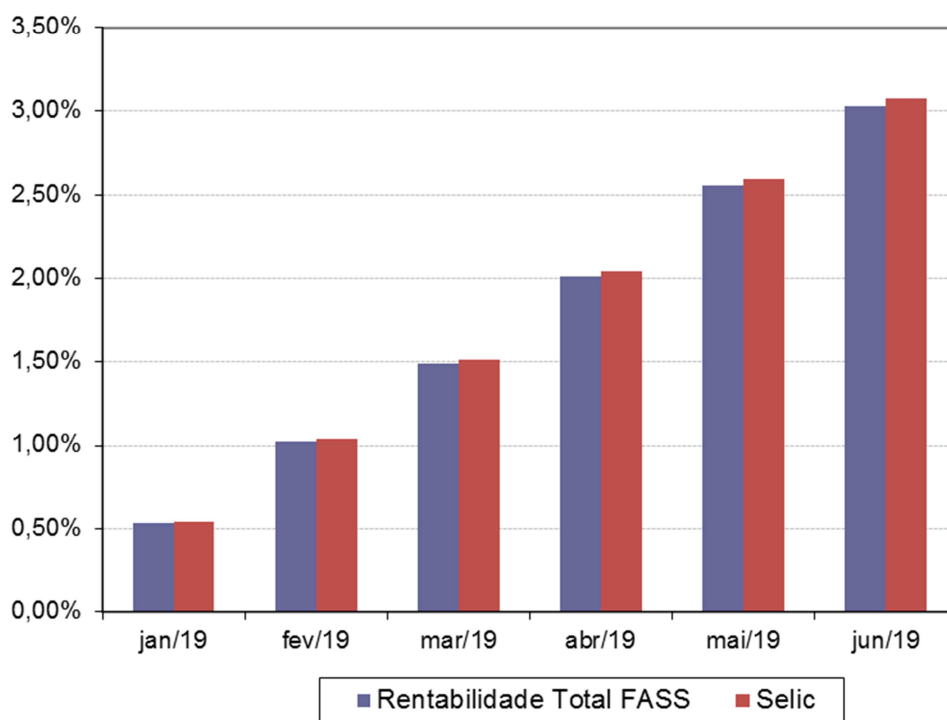
FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	jun/19	Acum. Ano	jun/19	Acum. 2019
FI CAIXA PCRJ RF	0,46%	3,03%	98,51%	98,49%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,41%	2,65%	86,46%	86,24%
Rentabilidade Total FASS	0,46%	3,03%	98,51%	98,49%
Selic	0,47%	3,07%		

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 junho, rentabilidades em relação à meta de rentabilidade ⁽¹⁾ de 81,27% (Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa), 91,03% (Caixa Brasil Referenciado DI LP) e 114,96% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal; e 87,82% 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 104,78% em relação à meta e de 111,48% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 59,54% e de 102,10% em relação à meta e à taxa Selic, respectivamente.

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