

Relatório Mensal

2019

Outubro

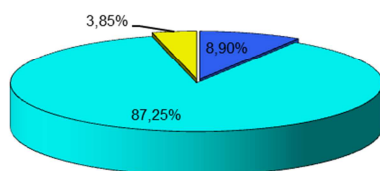
Instituto de Previdência e Assistência do Município do Rio de
Janeiro - PREVI-RIO

DIRETORIA DE
INVESTIMENTOS

Composição da Carteira

Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

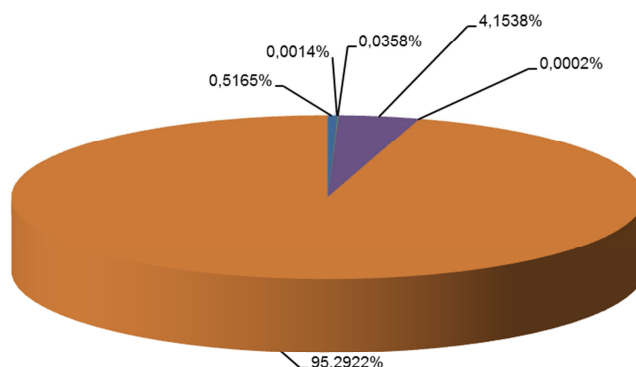
TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)



Valor da Carteira pelo Mercado		
PREVI-RIO	R\$	73.378.229,33
FUNPREVI	R\$	719.384.140,87
FASS	R\$	31.764.141,80

■ PREVI-RIO ■ FUNPREVI ■ FASS

FUNPREVI



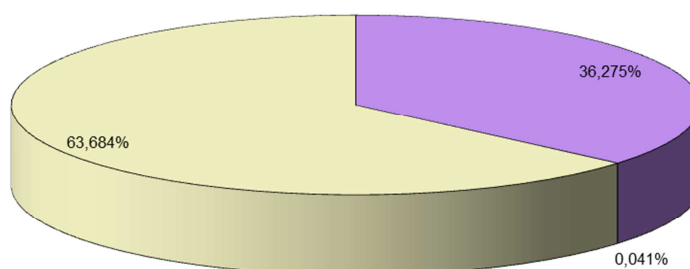
■ FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	■ FI Caixa Brasil Disponibilidades RF
■ Santander Cash Blue FI RF Referenciado DI	■ FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF
■ Ações	■ Imóveis

Valor por Tipo de Ativo pelo Mercado	
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	R\$ 3.715.499,46
FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 10.333,46
Santander Cash Blue FI RF Referenciado DI	R\$ 257.798,31
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 29.882.093,64
Ações	R\$ 1.416,00
Subtotal Valores Mobiliários Funprevi	R\$ 33.867.140,87
Imóveis	R\$ 685.517.000,00
Total Carteira Funprevi	R\$ 719.384.140,87
Estoque de Royalties de Petróleo (a vencer)	
Valor Presente	R\$ 4.205.426.123,65
Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos	
Saldo (outubro 2019)	R\$ 371.636.840,17
Valor de Aluguel Mensal dos Imóveis	
Outubro 2019	R\$ 3.946.875,46

Composição da Carteira

Ativos Mobiliários e Imobiliários

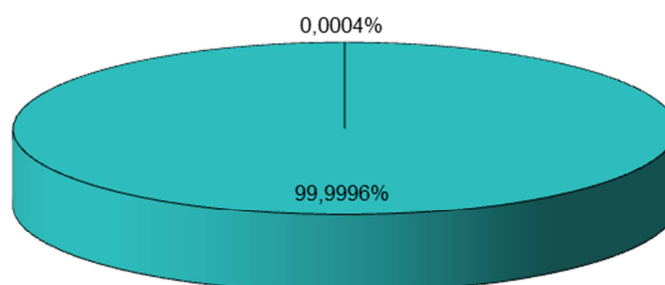
PREVI-RIO



■ 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\$ 26.618.053,17
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	R\$ 30.184,19
Subtotal Valores Mobiliários Previ-Rio	R\$ 26.648.237,36
Imóveis	R\$ 46.729.991,97
Total Carteira Previ-Rio	R\$ 73.378.229,33

FASS



■ FI CAIXA PCRJ RF ■ FI Caixa Brasil Disponibilidades RF

Valor da Carteira	
FI CAIXA PCRJ RF	R\$ 31.764.007,02
FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 134,78
Total Carteira FASS	R\$ 31.764.141,80

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

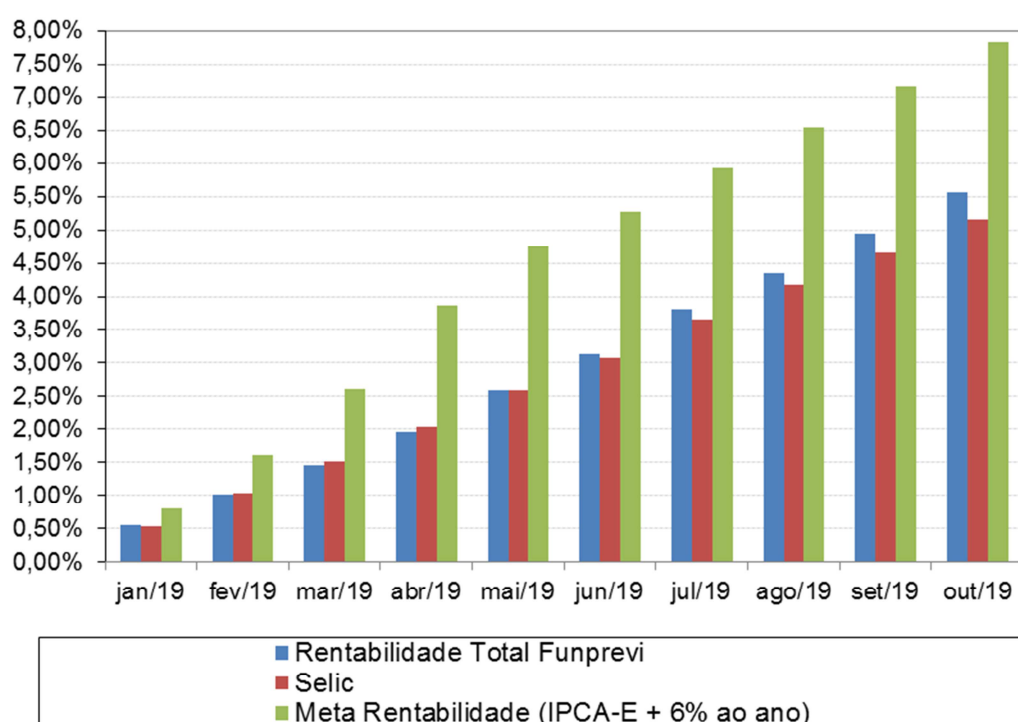
FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	out/19	Acum. Ano	out/19	Acum. 2019	out/19	Acum. 2019
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,45%	5,02%	72,31%	64,14%	93,79%	97,22%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,40%	4,43%	64,93%	56,54%	84,21%	85,71%
Santander Cash Blue FI RF Referenciado DI	0,44%	4,81%	71,56%	61,47%	92,81%	93,18%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,61%	5,79%	97,62%	73,99%	126,61%	112,16%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Funprevi	0,58%	5,56%	93,00%	71,02%	120,61%	107,65%
Meta Rentabilidade	0,62%	7,83%				
Selic	0,48%	5,16%				

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

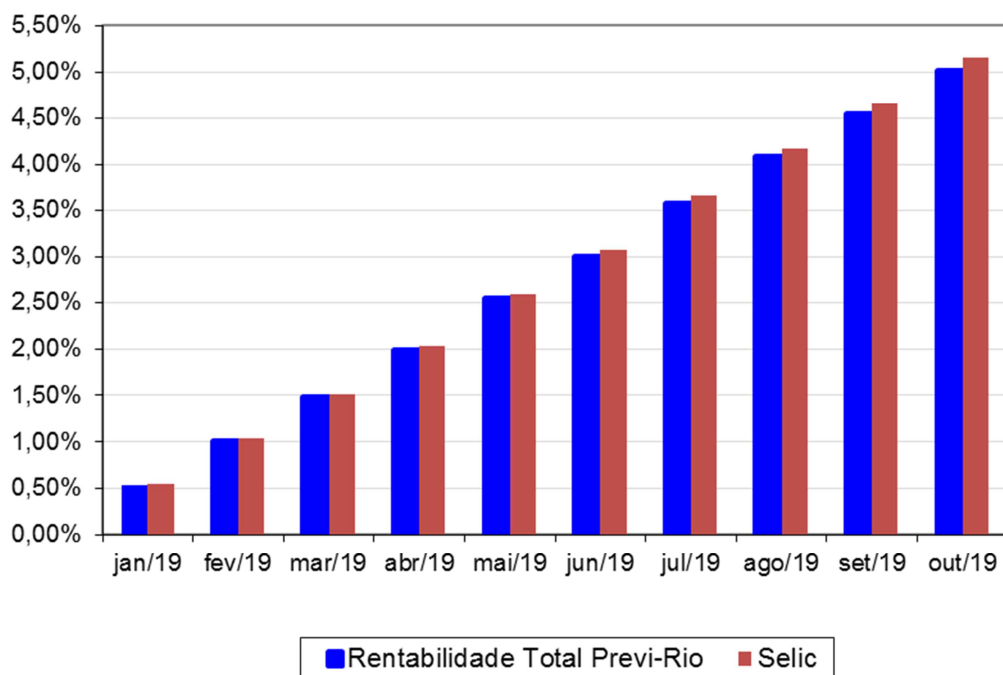
PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	out/19	Acum. Ano	out/19	Acum. 2019
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,45%	5,02%	93,79%	97,22%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,40%	4,43%	84,21%	85,71%
Rentabilidade Total Previ-Rio	0,45%	5,02%	93,78%	97,21%
Selic	0,48%	5,16%		

OBSERVAÇÕES:

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

Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

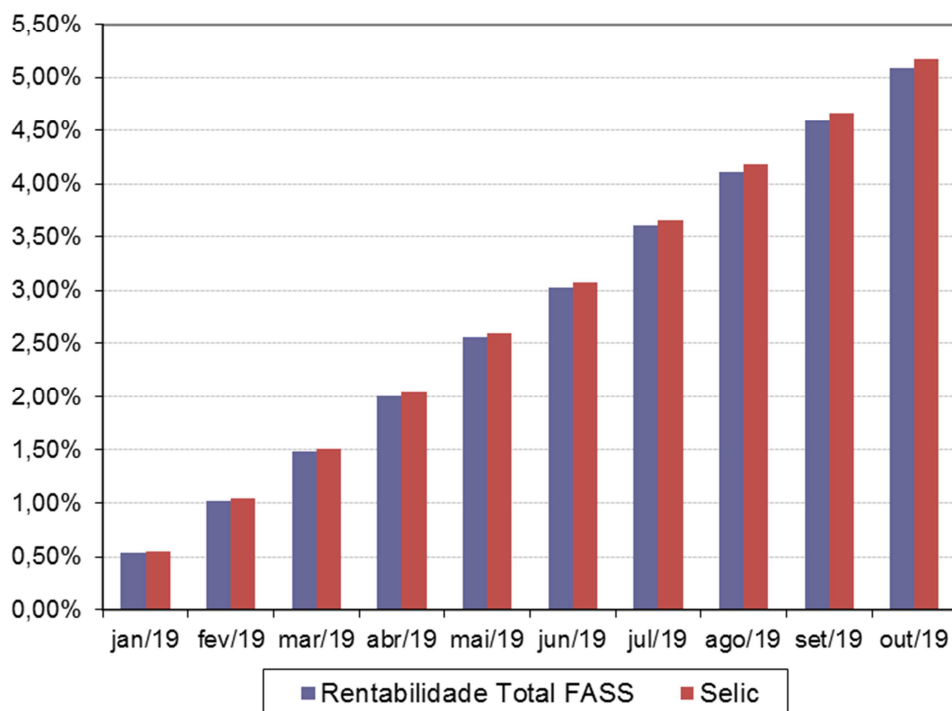
FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	out/19	Acum. Ano	out/19	Acum. 2019
FI CAIXA PCRJ RF	0,47%	5,09%	98,54%	98,50%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,40%	4,43%	84,21%	85,71%
Rentabilidade Total FASS	0,47%	5,09%	98,54%	98,50%
Selic	0,48%	5,16%		

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 outubro, rentabilidades em relação à meta de rentabilidade ⁽¹⁾ de 64,93% (Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa), 72,31% (Caixa Brasil Referenciado DI LP) e 97,62% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal; e 71,56% 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 93,00% em relação à meta e de 120,61% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 71,02% e de 107,65% em relação à meta e à taxa Selic, respectivamente.

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