

Relatório Mensal

2019

Dezembro

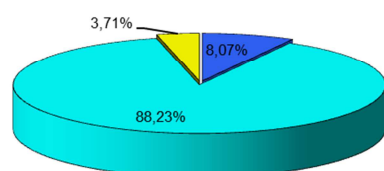
Instituto de Previdência e Assistência do Município do Rio de
Janeiro - PREVI-RIO

DIRETORIA DE
INVESTIMENTOS

Composição da Carteira

Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

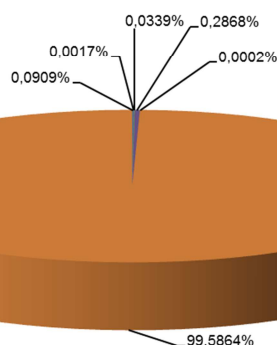
TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)



Valor da Carteira pelo Mercado		
PREVI-RIO	R\$	70.027.505,27
FUNPREVI	R\$	765.916.630,23
FASS	R\$	32.170.581,35



FUNPREVI



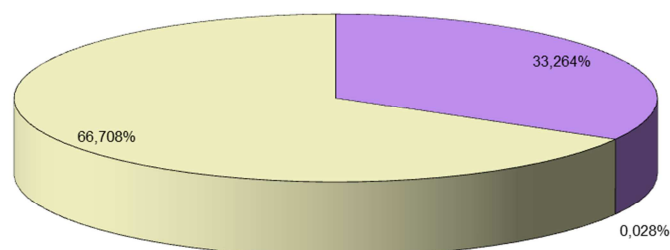
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	FI Caixa Brasil Disponibilidades RF
Santander Cash Blue FI RF Referenciado DI	FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF
Ações	Imóveis

Valor por Tipo de Ativo pelo Mercado		
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	R\$	696.504,03
FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$	13.245,84
Santander Cash Blue FI RF Referenciado DI	R\$	259.583,37
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$	2.196.780,99
Ações	R\$	1.416,00
Subtotal Valores Mobiliários Funprevi	R\$	3.167.530,23
Imóveis	R\$	762.749.100,00
Total Carteira Funprevi	R\$	765.916.630,23
Estoque de Royalties de Petróleo (a vencer)		
Valor Presente	R\$	4.342.856.232,52
Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos		
Saldo (Dezembro 2019)	R\$	364.250.869,09
Aluguéis Recebidos		
Dezembro 2019	R\$	3.891.573,30

Composição da Carteira

Ativos Mobiliários e Imobiliários

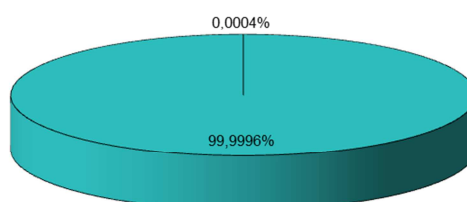
PREVI-RIO



■ 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\$	23.293.818,60
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	R\$	19.394,70
Subtotal Valores Mobiliários Previ-Rio	R\$	23.313.213,30
Imóveis	R\$	46.714.291,97
Total Carteira Previ-Rio	R\$	70.027.505,27

FASS



■ FI CAIXA PCRJ RF ■ FI Caixa Brasil Disponibilidades RF

Valor da Carteira		
FI CAIXA PCRJ RF	R\$	32.170.460,03
FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$	121,32
Total Carteira FASS	R\$	32.170.581,35

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

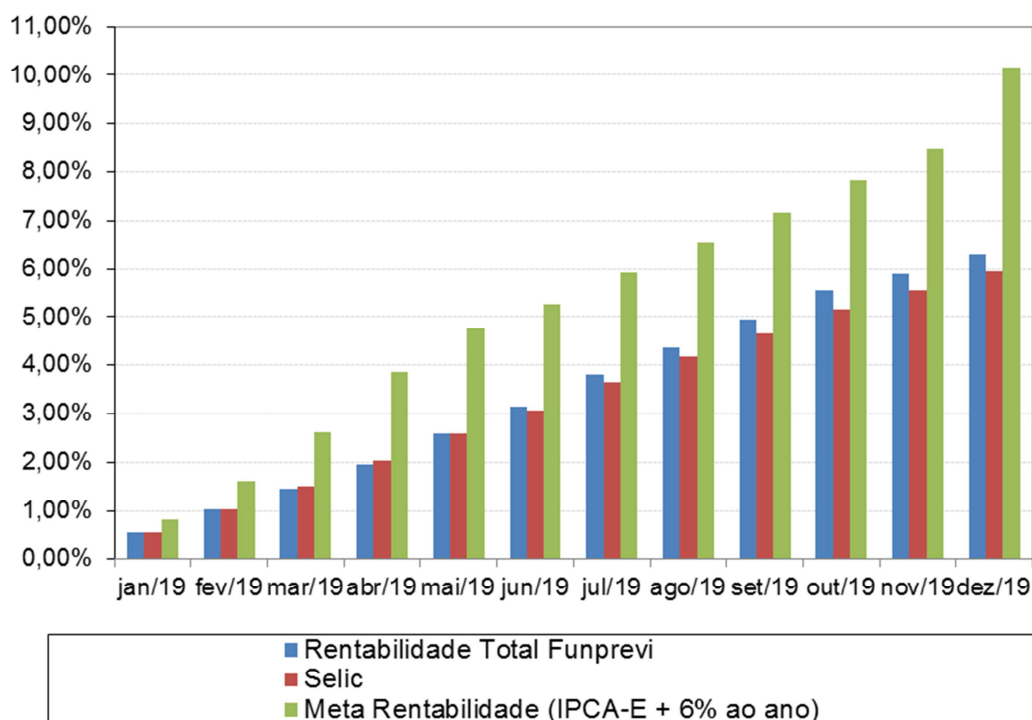
FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	dez/19	Acum. Ano	dez/19	Acum. 2019	dez/19	Acum. 2019
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,35%	5,72%	22,85%	56,32%	93,90%	95,90%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,31%	5,07%	19,87%	50,00%	81,65%	85,13%
Santander Cash Blue FI RF Referenciado DI	0,34%	5,54%	22,24%	54,57%	91,41%	92,92%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,40%	6,55%	26,13%	64,56%	107,40%	109,93%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Funprevi	0,38%	6,30%	24,96%	62,05%	102,58%	105,66%
Meta Rentabilidade	1,54%	10,15%				
Selic	0,37%	5,96%				

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

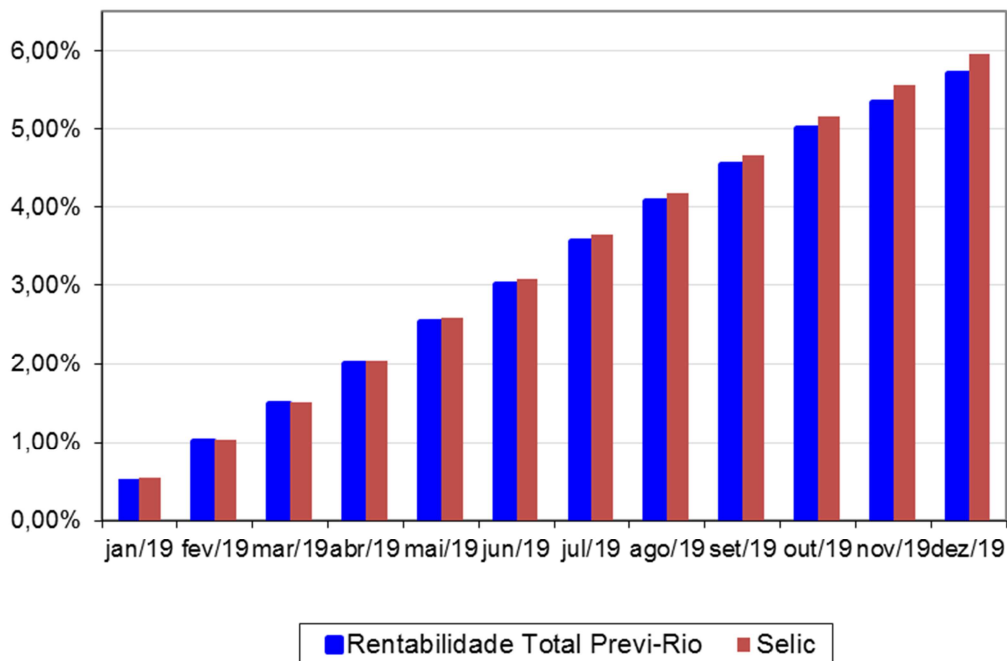
PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	dez/19	Acum. Ano	dez/19	Acum. 2019
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,35%	5,72%	93,90%	95,90%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,31%	5,07%	81,65%	85,13%
Rentabilidade Total Previ-Rio	0,35%	5,71%	93,89%	95,88%
Selic	0,37%	5,96%		

OBSERVAÇÕES:

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

Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

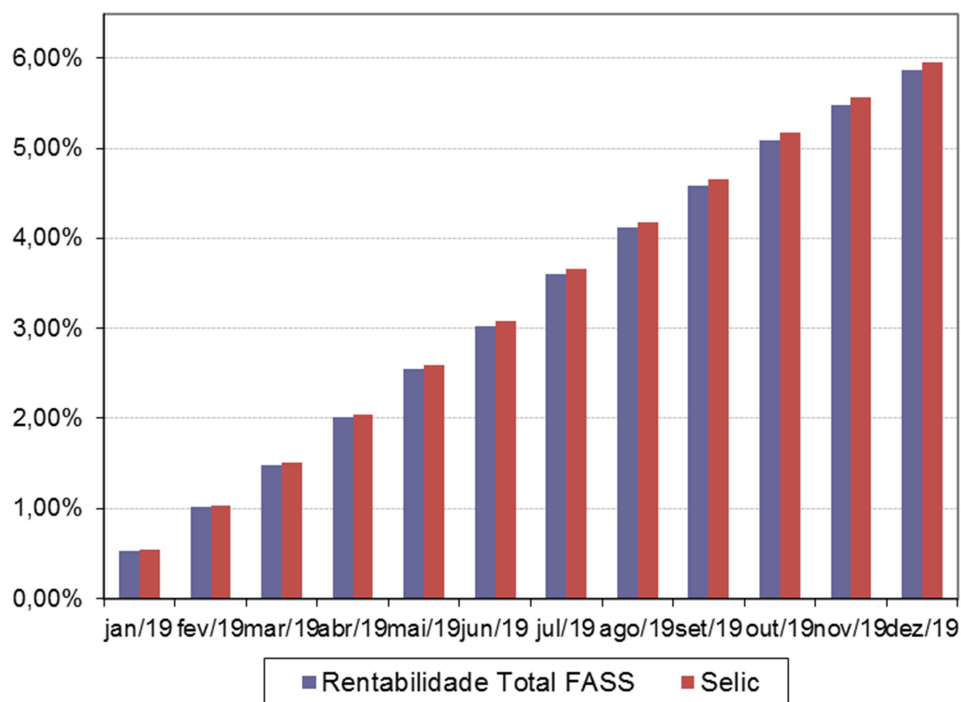
FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	dez/19	Acum. Ano	dez/19	Acum. 2019
FI CAIXA PCRJ RF	0,37%	5,87%	97,85%	98,41%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,31%	5,07%	81,65%	85,13%
Rentabilidade Total FASS	0,37%	5,87%	97,84%	98,41%
Selic	0,37%	5,96%		

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 dezembro, rentabilidades em relação à meta de rentabilidade ⁽¹⁾ de 19,87% (Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa), 22,85% (Caixa Brasil Referenciado DI LP) e 26,13% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal; e 22,24% 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 24,96% em relação à meta e de 102,58% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 62,05% e de 105,66% em relação à meta e à taxa Selic, respectivamente.

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