

Relatório Mensal

2018 Julho

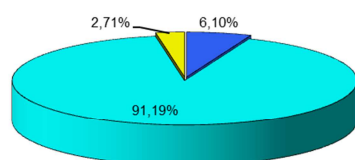
Instituto de Previdência e Assistência do Município do Rio de
Janeiro - PREVI-RIO

DIRETORIA DE
INVESTIMENTOS

Composição da Carteira

Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

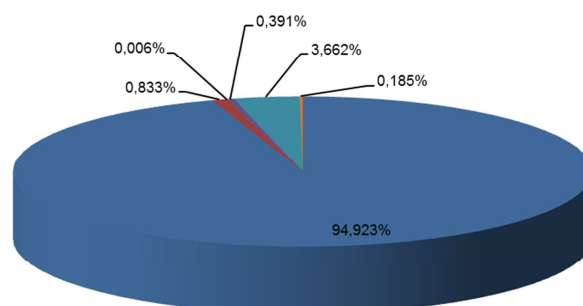
TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)



■ PREVI-RIO ■ FUNPREVI ■ FASS

Valor da Carteira pelo Mercado		
PREVI-RIO	R\$	35.028.268,15
FUNPREVI	R\$	523.421.788,68
FASS	R\$	15.534.093,82

FUNPREVI



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

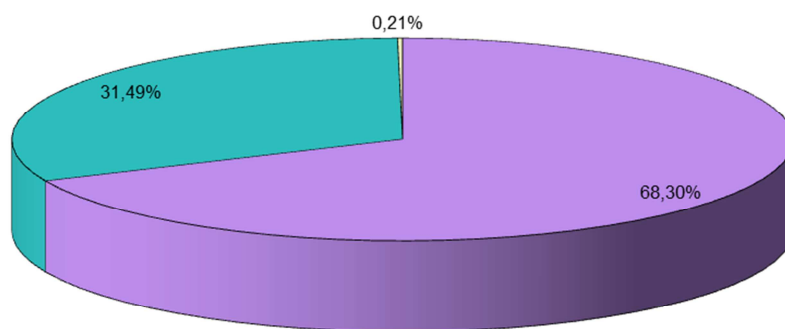
Valor por Tipo de Ativo pelo Mercado		
Imóveis	R\$	496.846.000,00
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	R\$	4.359.396,15
FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$	29.342,79
Cash Blue FI RF Referenciado DI	R\$	2.048.507,30
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$	19.169.126,44
Ações	R\$	969.416,00
Estoque de Royalties de Petróleo (a vencer)		
Valor Presente (ago/2018 a dez/2059)	R\$	4.705.383.903,40
Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos		
Saldo (julho 2018)	R\$	447.217.773,72
Valor de Aluguel Mensal dos Imóveis		
Julho 2018	R\$	3.736.515,15

Obs: Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos é composto por saldos devedores por empreendimento (R\$ 447.105.409,06) e outros empréstimos concedidos a funcionários (R\$ 112.364,66).

Composição da Carteira

Ativos Mobiliários e Imobiliários

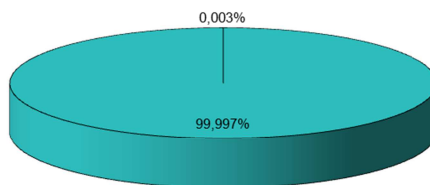
PREVI-RIO



Imóveis	FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	

Valor da Carteira		
Imóveis	R\$	23.923.991,97
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R\$	11.031.429,60
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	R\$	72.846,58

FASS



FI CAIXA PCRJ RF	FI Caixa Brasil Disponibilidades RF
------------------	-------------------------------------

Valor da Carteira		
FI CAIXA PCRJ RF	R\$	15.533.644,39
FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$	449,43

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

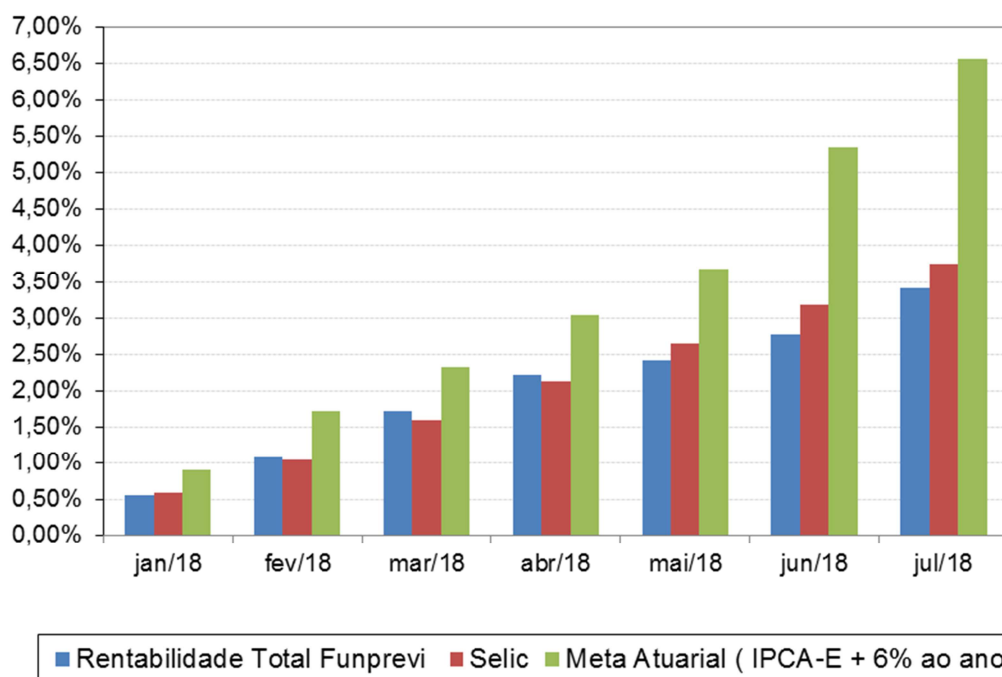
FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	jul/18	Acum. Ano	jul/18	Acum. 2018	jul/18	Acum. 2018
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,52%	3,61%	45,36%	55,02%	96,67%	96,64%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,47%	3,24%	40,56%	49,25%	86,44%	86,50%
Santander Cash Blue RF Referenciado DI FI	0,51%	3,47%	43,89%	52,78%	93,53%	92,70%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,68%	3,66%	59,06%	55,68%	125,87%	97,79%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Funprevi	0,62%	3,42%	53,44%	52,03%	113,89%	91,38%
Meta Atuarial	1,16%	6,57%				
Selic	0,54%	3,74%				

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 uma conta controlada no Banco Citibank em garantia ao atendimento de exigências contratuais que após cumpridas poderão ter o saldo disponível para movimentação.

Rentabilidade Acumulada - Funprevi x Meta Atuarial x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

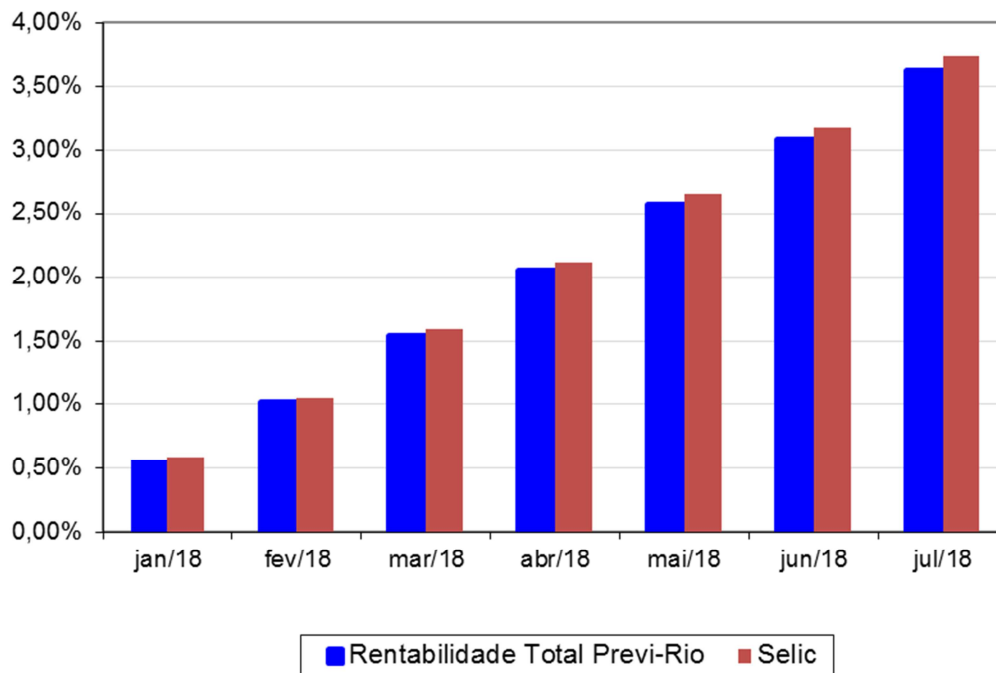
PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	jul/18	Acum. Ano	jul/18	Acum. 2018
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,52%	3,61%	96,67%	96,64%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,47%	3,24%	86,44%	86,50%
Rentabilidade Total Previ-Rio	0,52%	3,63%	96,62%	96,96%
Selic	0,54%	3,74%		

OBSERVAÇÕES:

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

Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

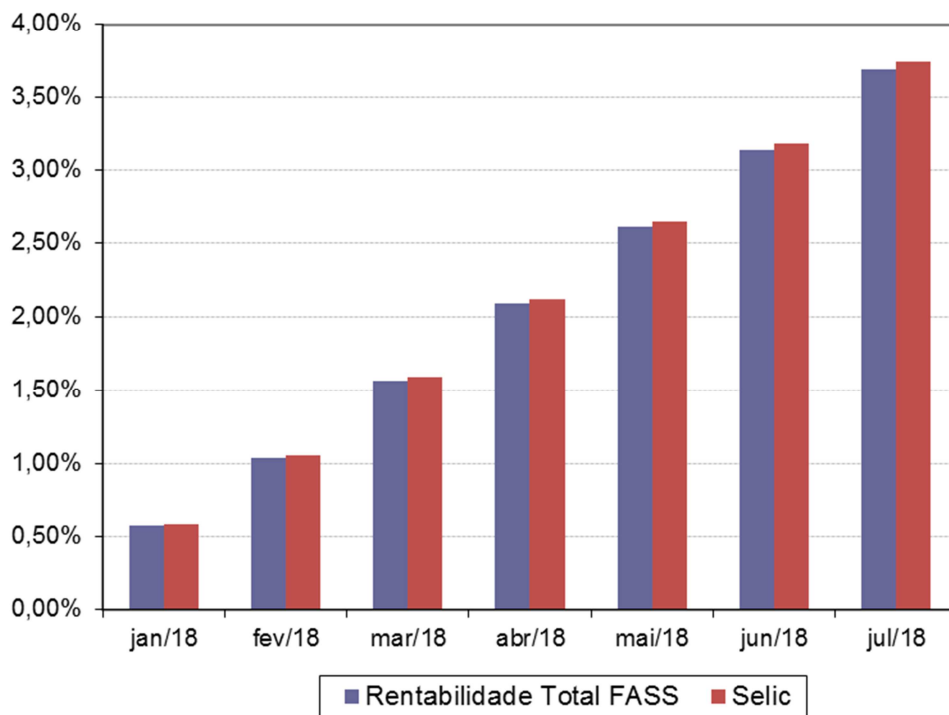
FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	jul/18	Acum. Ano	jul/18	Acum. 2018
FI CAIXA PCRJ RF	0,54%	3,69%	98,90%	98,68%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,47%	3,24%	86,44%	86,50%
Rentabilidade Total FASS	0,54%	3,69%	98,90%	98,67%
Selic	0,54%	3,74%		

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 julho, rentabilidades em relação à meta atuarial de 40,56% (Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa), 45,36% (Caixa Brasil Referenciado DI LP) e 59,06% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal e 43,89% o 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 53,44% no mês em relação à meta e 113,89% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 52,03% e 91,38% em relação à meta e à taxa Selic, respectivamente.