

Relatório Mensal

2018

Agosto

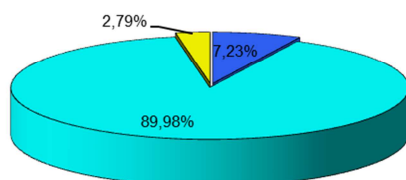
Instituto de Previdência e Assistência do Município do Rio de
Janeiro - PREVI-RIO

DIRETORIA DE
INVESTIMENTOS

Composição da Carteira

Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

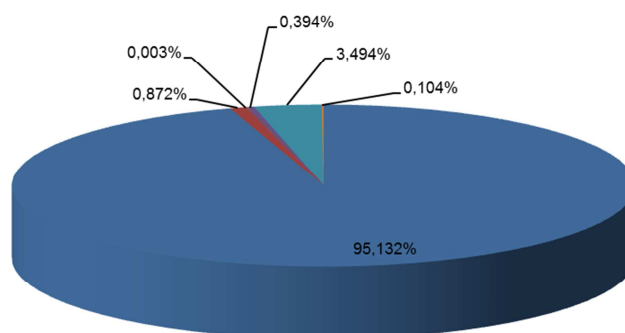
TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)



Valor da Carteira pelo Mercado		
PREVI-RIO	R\$	41.992.495,49
FUNPREVI	R\$	522.268.488,13
FASS	R\$	16.185.907,45

■ PREVI-RIO ■ FUNPREVI ■ FASS

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\$ 4.554.613,74
FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 16.781,00
Cash Blue FI RF Referenciado DI	R\$ 2.059.413,21
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 18.249.514,18
Ações	R\$ 542.166,00

Estoque de Royalties de Petróleo (a vencer)	
Valor Presente (set/2018 a dez/2059)	R\$ 4.728.287.597,48

Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos	
Saldo (agosto 2018)	R\$ 440.568.384,07

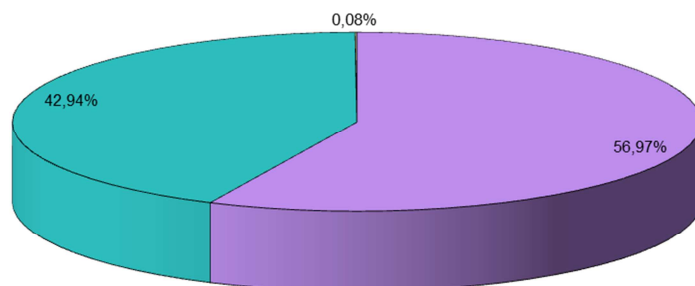
Valor de Aluguel Mensal dos Imóveis	
Agosto 2018	R\$ 3.736.515,15

Obs: Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos é composto por saldos devedores por empreendimento (R\$ 440.456.019,41) e outros empréstimos concedidos a funcionários (R\$ 112.364,66).

Composição da Carteira

Ativos Mobiliários e Imobiliários

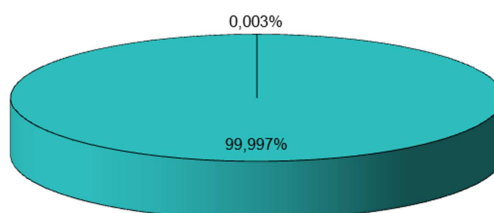
PREVI-RIO



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\$	18.033.270,32
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	R\$	35.233,20

FASS



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

Valor da Carteira		
FI CAIXA PCRJ RF	R\$	16.185.410,09
FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$	497,36

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

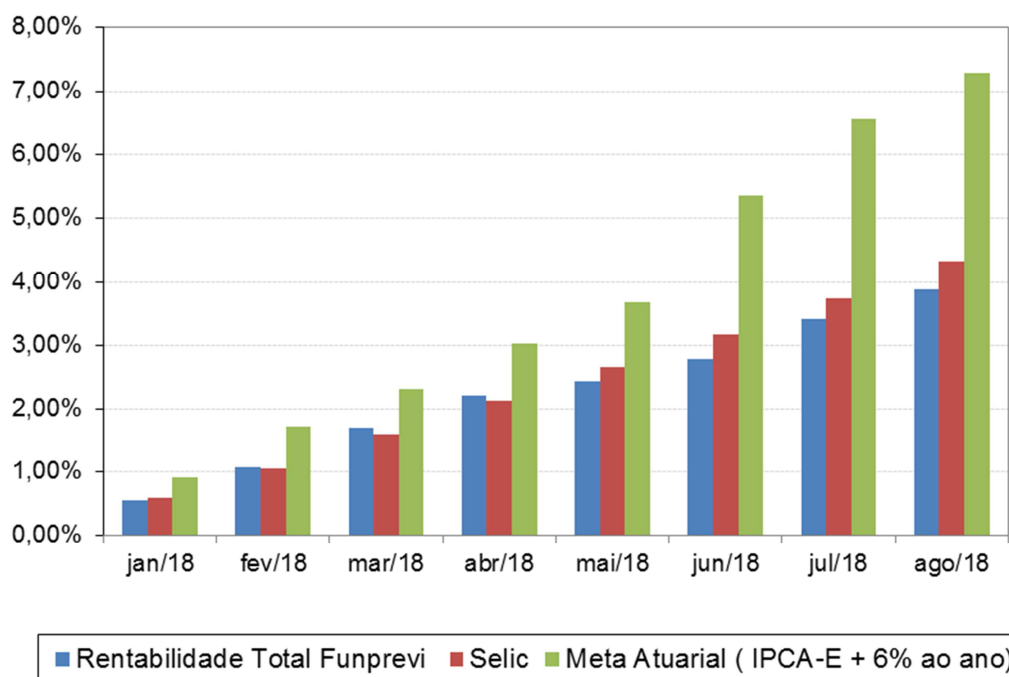
FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	ago/18	Acum. Ano	ago/18	Acum. 2018	ago/18	Acum. 2018
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,56%	4,19%	83,26%	57,56%	97,98%	96,81%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,49%	3,74%	73,41%	51,39%	86,40%	86,43%
Santander Cash Blue RF Referenciado DI FI	0,53%	4,02%	79,67%	55,18%	93,76%	92,81%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,41%	4,08%	60,83%	56,02%	71,58%	94,21%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Funprevi	0,44%	3,88%	66,20%	53,22%	77,91%	89,52%
Meta Atuarial	0,67%	7,28%				
Selic	0,57%	4,33%				

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 Atuarial x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

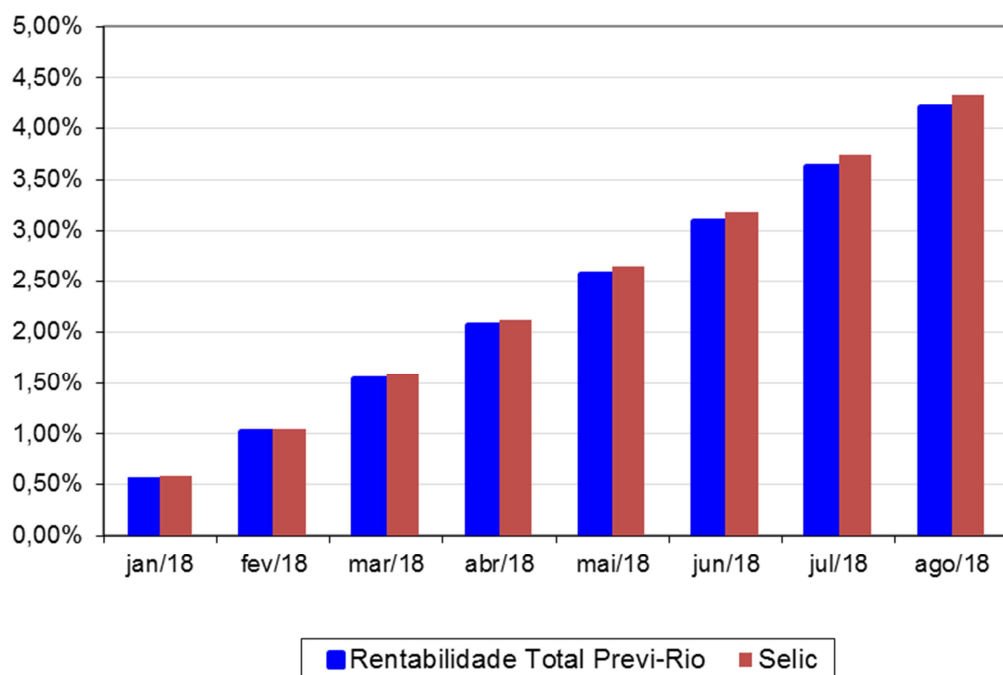
PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	ago/18	Acum. Ano	ago/18	Acum. 2018
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,56%	4,19%	97,98%	96,81%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,49%	3,74%	86,40%	86,43%
Rentabilidade Total Previ-Rio	0,56%	4,20%	97,96%	97,09%
Selic	0,57%	4,33%		

OBSERVAÇÕES:

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

Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

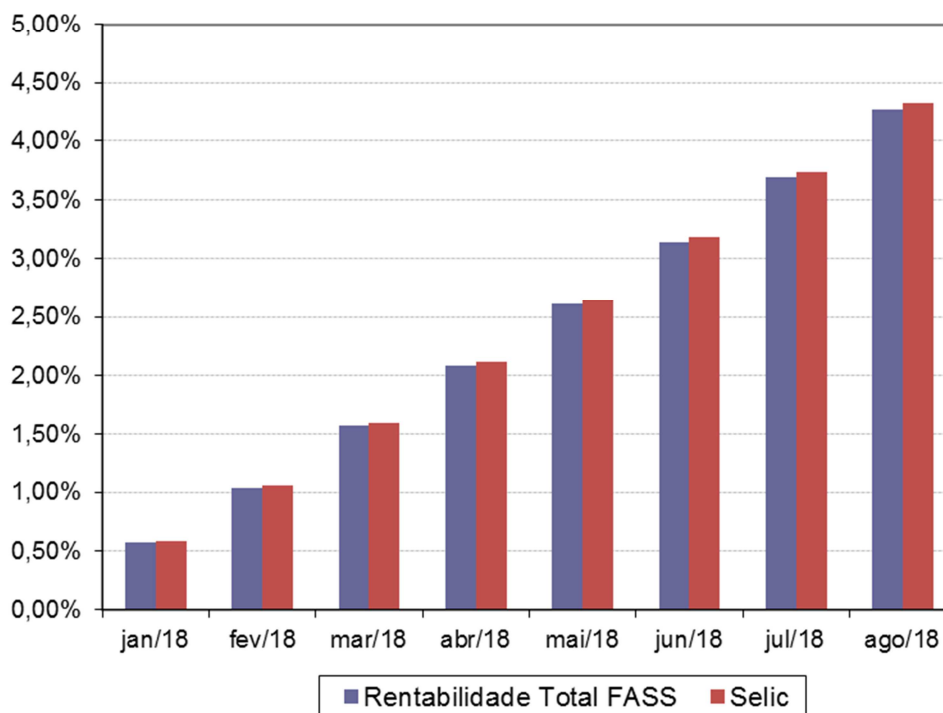
FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	ago/18	Acum. Ano	ago/18	Acum. 2018
FI CAIXA PCRJ RF	0,56%	4,27%	98,94%	98,70%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,49%	3,74%	86,40%	86,43%
Rentabilidade Total FASS	0,56%	4,27%	98,94%	98,70%
Selic	0,57%	4,33%		

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 agosto, rentabilidades em relação à meta atuarial de 73,41% (Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa), 83,26% (Caixa Brasil Referenciado DI LP) e 60,83% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal e 79,67% 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 66,20% no mês em relação à meta e 77,91% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 53,22% e 89,52% em relação à meta e à taxa Selic, respectivamente.