

Relatório Mensal

2018

Setembro

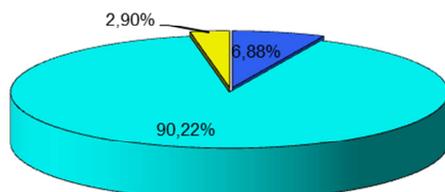
Instituto de Previdência e Assistência do Município do Rio de Janeiro - PREVI-RIO

DIRETORIA DE
INVESTIMENTOS

Composição da Carteira

Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

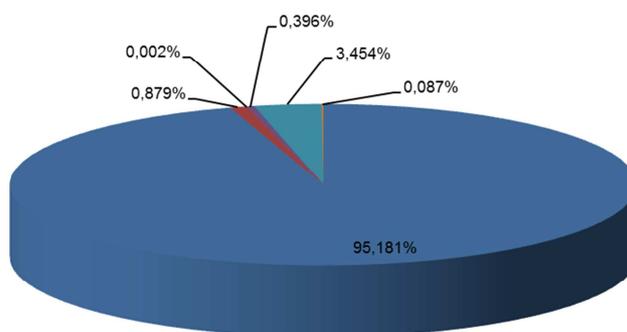
TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)



Valor da Carteira pelo Mercado	
PREVI-RIO	R\$ 39.822.647,23
FUNPREVI	R\$ 522.002.100,99
FASS	R\$ 16.787.835,94



FUNPREVI



Valor por Tipo de Ativo pelo Mercado	
Imóveis	R\$ 496.846.000,00
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	R\$ 4.590.429,27
FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 10.153,34
Cash Blue FI RF Referenciado DI	R\$ 2.068.466,85
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 18.031.225,53
Ações	R\$ 455.826,00

Estoque de Royalties de Petróleo (a vencer)	
Valor Presente (out/2018 a dez/2059)	R\$ 4.751.302.776,45

Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos	
Saldo (setembro 2018)	R\$ 434.448.260,23

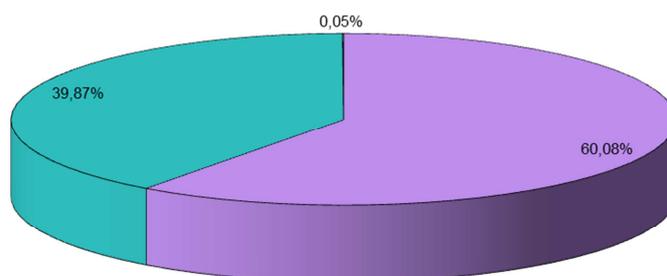
Valor de Aluguel Mensal dos Imóveis	
Setembro 2018	R\$ 3.736.515,15

Obs: Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos é composto por saldos devedores por empreendimento (R\$ 434.335.895,57) e outros empréstimos concedidos a funcionários (R\$ 112.364,66).

Composição da Carteira

Ativos Mobiliários e Imobiliários

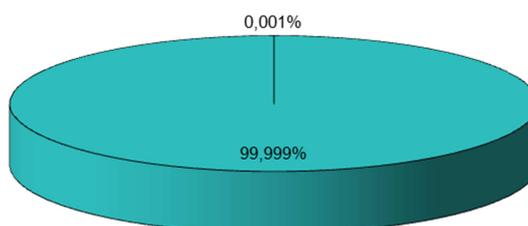
PREVI-RIO



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\$ 15.878.137,65
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	R\$ 20.517,61

FASS



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

Valor da Carteira	
FI CAIXA PCRJ RF	R\$ 16.787.632,70
FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 203,24

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

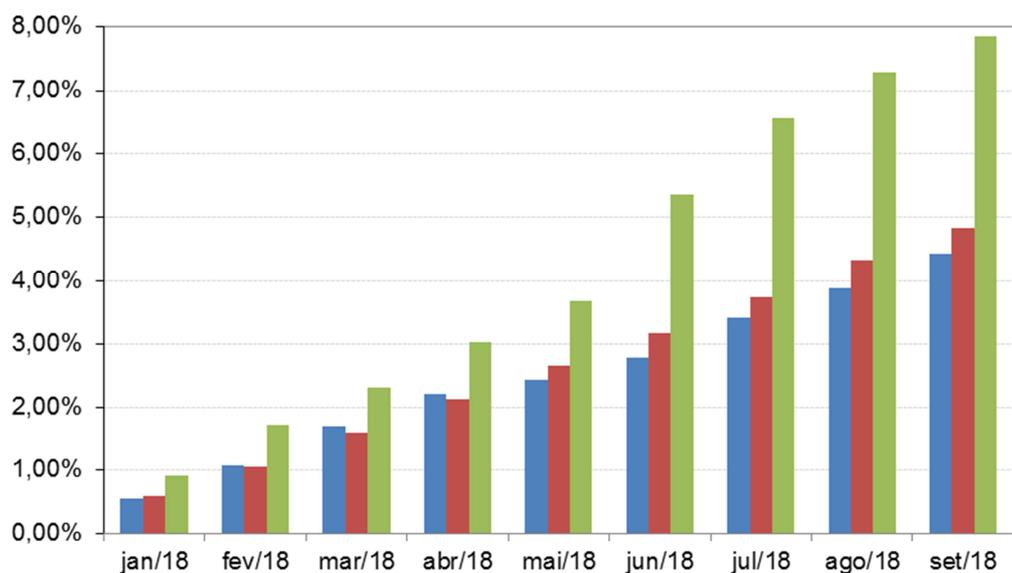
FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	set/18	Acum. Ano	set/18	Acum. 2018	set/18	Acum. 2018
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,44%	4,65%	83,21%	59,25%	94,81%	96,59%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,40%	4,16%	75,79%	52,99%	86,37%	86,38%
Santander Cash Blue RF Referenciado DI FI	0,44%	4,48%	82,29%	56,98%	93,77%	92,88%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,59%	4,69%	110,20%	59,73%	125,57%	97,37%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Funprevi	0,53%	4,43%	100,04%	56,41%	113,99%	91,95%
Meta Atuarial	0,53%	7,85%				
Selic	0,47%	4,82%				

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 Total Funprevi ■ Selic ■ Meta Atuarial (IPCA-E + 6% ao ano)

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

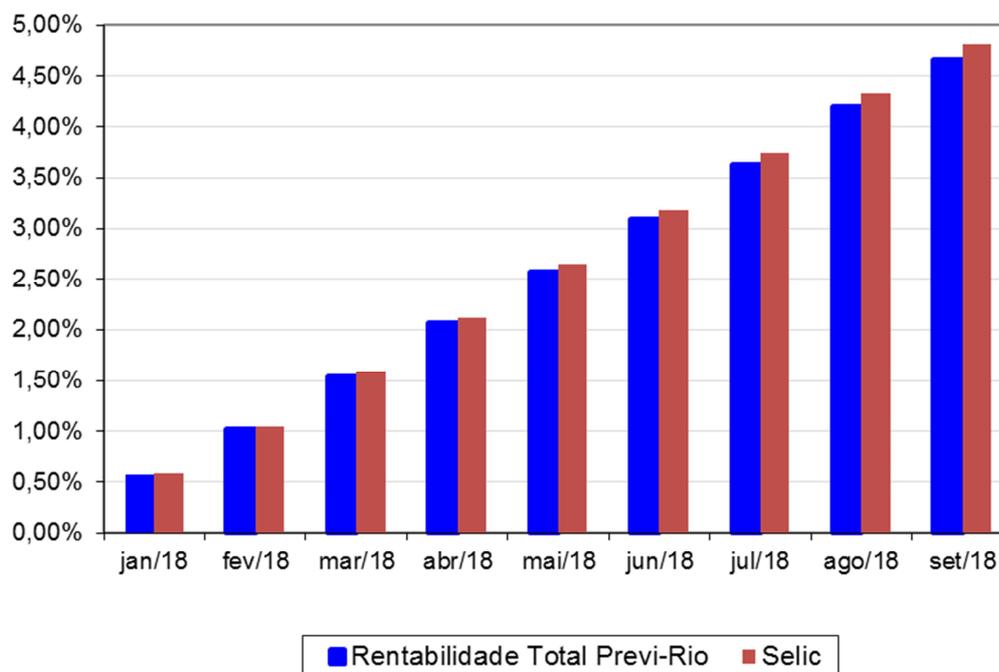
PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	set/18	Acum. Ano	set/18	Acum. 2018
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,44%	4,65%	94,81%	96,59%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,40%	4,16%	86,37%	86,38%
Rentabilidade Total Previ-Rio	0,44%	4,67%	94,79%	96,84%
Selic	0,47%	4,82%		

OBSERVAÇÕES:

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

Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

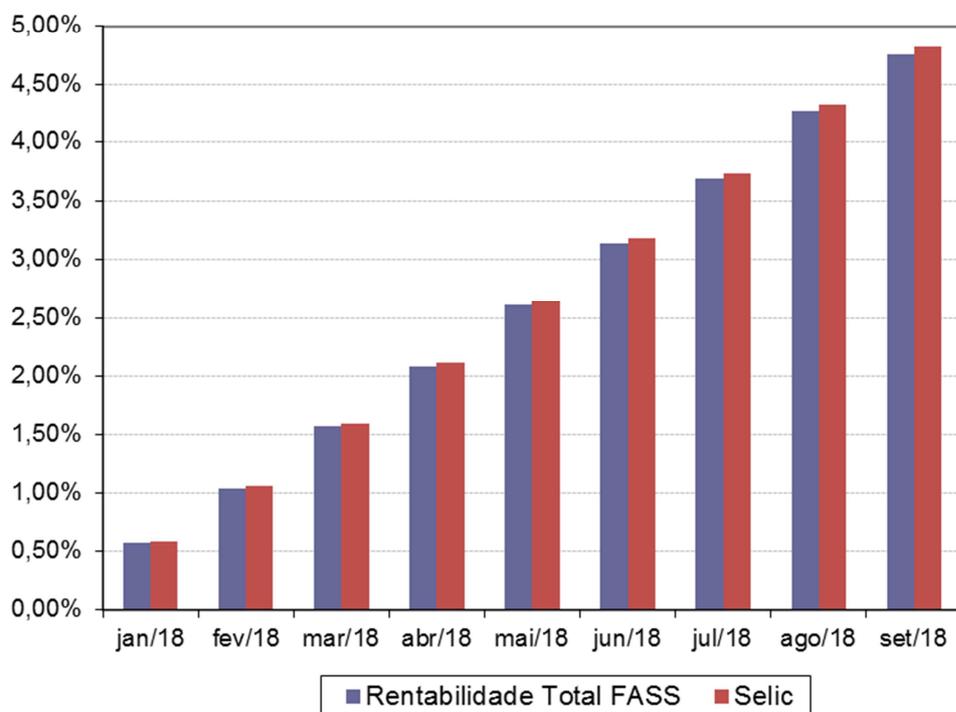
FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	set/18	Acum. Ano	set/18	Acum. 2018
FI CAIXA PCRJ RF	0,46%	4,76%	98,60%	98,69%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,40%	4,16%	86,37%	86,38%
Rentabilidade Total FASS	0,46%	4,76%	98,60%	98,69%
Selic	0,47%	4,82%		

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 setembro, rentabilidades em relação à meta atuarial de 75,79% (Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa), 83,21% (Caixa Brasil Referenciado DI LP) e 110,20% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal e 82,29% 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 100,04% no mês em relação à meta e 113,99% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 56,41% e 91,95% em relação à meta e à taxa Selic, respectivamente.