

# Relatório Mensal

2018

# Outubro

---

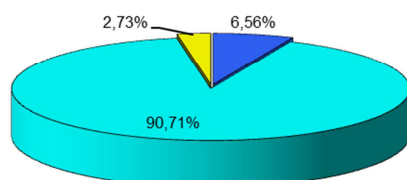
Instituto de Previdência e Assistência do Município do Rio de  
Janeiro - PREVI-RIO

DIRETORIA DE  
INVESTIMENTOS

# Composição da Carteira

## Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

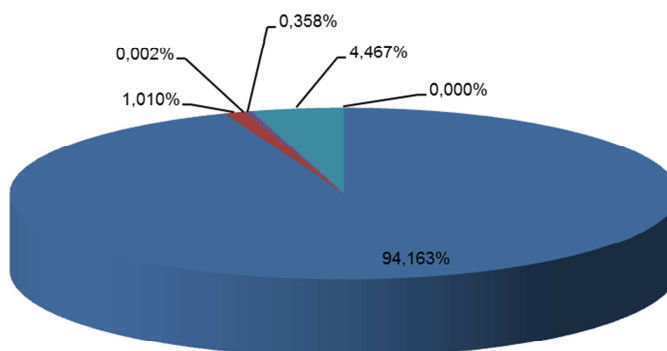
### TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)



| Valor da Carteira pelo Mercado |     |                |
|--------------------------------|-----|----------------|
| PREVI-RIO                      | R\$ | 41.971.834,82  |
| FUNPREVI                       | R\$ | 580.110.068,64 |
| FASS                           | R\$ | 17.431.801,95  |



### 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                              |

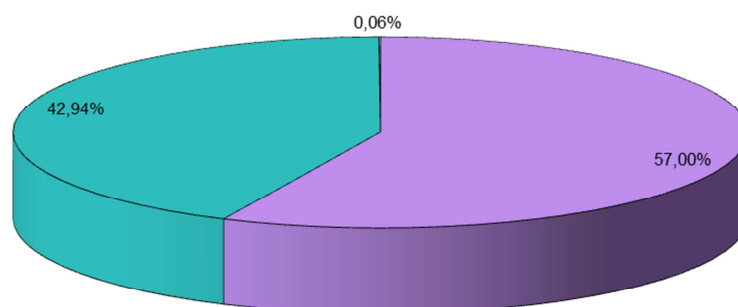
| Valor por Tipo de Ativo pelo Mercado        |                      |
|---------------------------------------------|----------------------|
| Imóveis                                     | R\$ 546.249.000,00   |
| FI Caixa Brasil Referenciado DI LP          | R\$ 5.858.326,99     |
| FI Caixa Brasil Disponibilidades RF         | R\$ 10.074,92        |
| Cash Blue FI RF Referenciado DI             | R\$ 2.078.981,06     |
| FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF                | R\$ 25.912.269,67    |
| Ações                                       | R\$ 1.416,00         |
| Estoque de Royalties de Petróleo (a vencer) |                      |
| Valor Presente (nov/2018 a dez/2059)        | R\$ 4.774.429.982,96 |
| Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos  |                      |
| Saldo (outubro 2018)                        | R\$ 430.421.229,03   |
| Valor de Aluguel Mensal dos Imóveis         |                      |
| Outubro 2018                                | R\$ 3.736.515,15     |

Obs: Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos é composto por saldos devedores por empreendimento (R\$ 430.308.864,37) e outros empréstimos concedidos a funcionários (R\$ 112.364,66).

# Composição da Carteira

## Ativos Mobiliários e Imobiliários

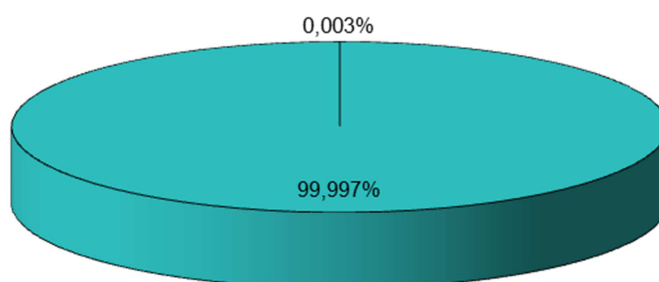
### PREVI-RIO



|                                             |                                             |
|---------------------------------------------|---------------------------------------------|
| 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\$ | 18.020.922,32 |
| FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa | R\$ | 26.920,53     |

### FASS



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

| Valor da Carteira                   |     |               |
|-------------------------------------|-----|---------------|
| FI CAIXA PCRJ RF                    | R\$ | 17.431.314,34 |
| FI Caixa Brasil Disponibilidades RF | R\$ | 487,61        |

# Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

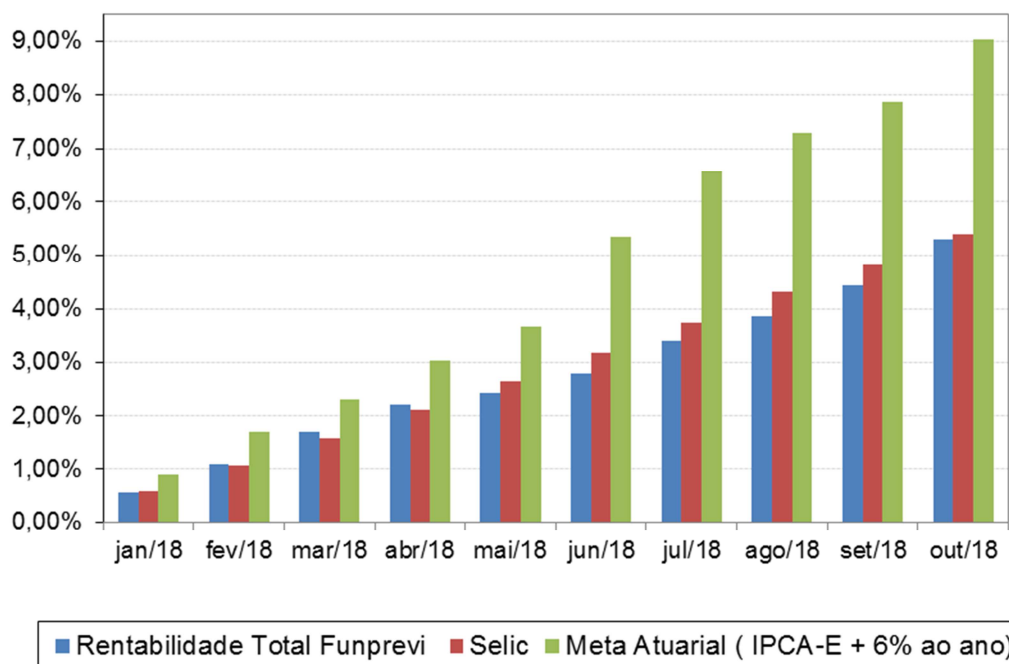
## FUNPREVI

| ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI               | Rentabilidade Nominal |               | Rentabilidade em relação à Meta |               | Rentabilidade em relação à Selic |               |
|---------------------------------------------|-----------------------|---------------|---------------------------------|---------------|----------------------------------|---------------|
|                                             | out/18                | Acum. Ano     | out/18                          | Acum. 2018    | out/18                           | Acum. 2018    |
| FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo | 0,53%                 | 5,21%         | 48,50%                          | 57,66%        | 97,98%                           | 96,72%        |
| FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa | 0,47%                 | 4,65%         | 42,83%                          | 51,47%        | 86,53%                           | 86,33%        |
| Santander Cash Blue RF Referenciado DI FI   | 0,51%                 | 5,01%         | 46,33%                          | 55,39%        | 93,60%                           | 92,92%        |
| FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa        | 0,94%                 | 5,67%         | 85,23%                          | 62,74%        | 172,19%                          | 105,25%       |
| Ações                                       | Não aplicável         | Não aplicável | Não aplicável                   | Não aplicável | Não aplicável                    | Não aplicável |
| Rentabilidade Total Funprevi                | 0,83%                 | 5,29%         | 75,39%                          | 58,58%        | 152,30%                          | 98,27%        |
| Meta Atuarial                               | 1,10%                 | 9,04%         |                                 |               |                                  |               |
| Selic                                       | 0,54%                 | 5,39%         |                                 |               |                                  |               |

### 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

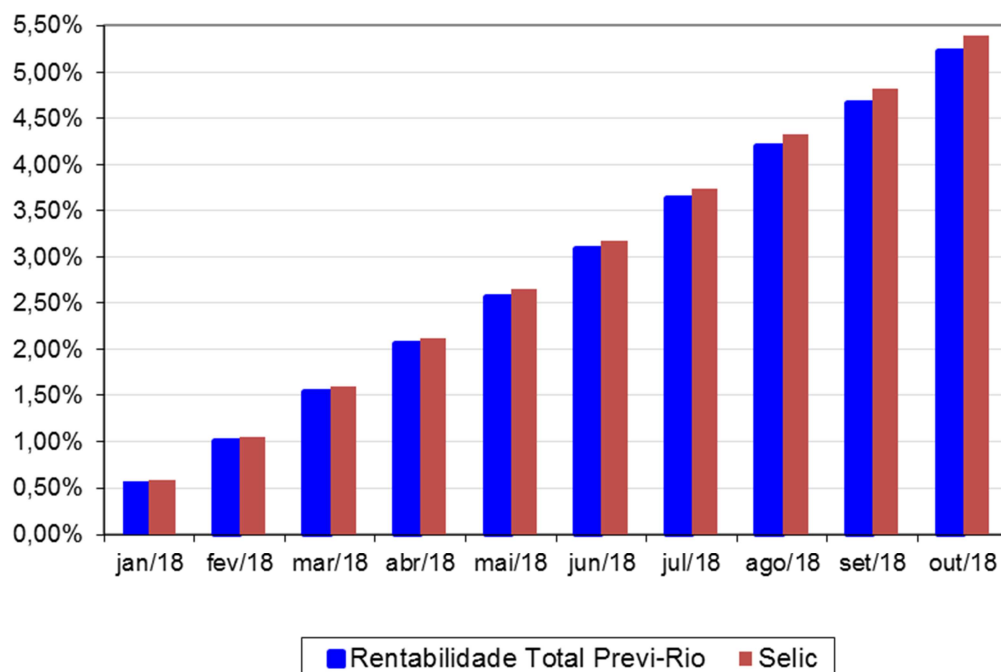
## PREVI-RIO

| ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO              | Rentabilidade Nominal |           | Rentabilidade em relação à Selic |            |
|---------------------------------------------|-----------------------|-----------|----------------------------------|------------|
|                                             | out/18                | Acum. Ano | out/18                           | Acum. 2018 |
| FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo | 0,53%                 | 5,21%     | 97,98%                           | 96,72%     |
| FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa | 0,47%                 | 4,65%     | 86,53%                           | 86,33%     |
| Rentabilidade Total Previ-Rio               | 0,53%                 | 5,22%     | 97,92%                           | 96,94%     |
| Selic                                       | 0,54%                 | 5,39%     |                                  |            |

### OBSERVAÇÕES:

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

### Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



# Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

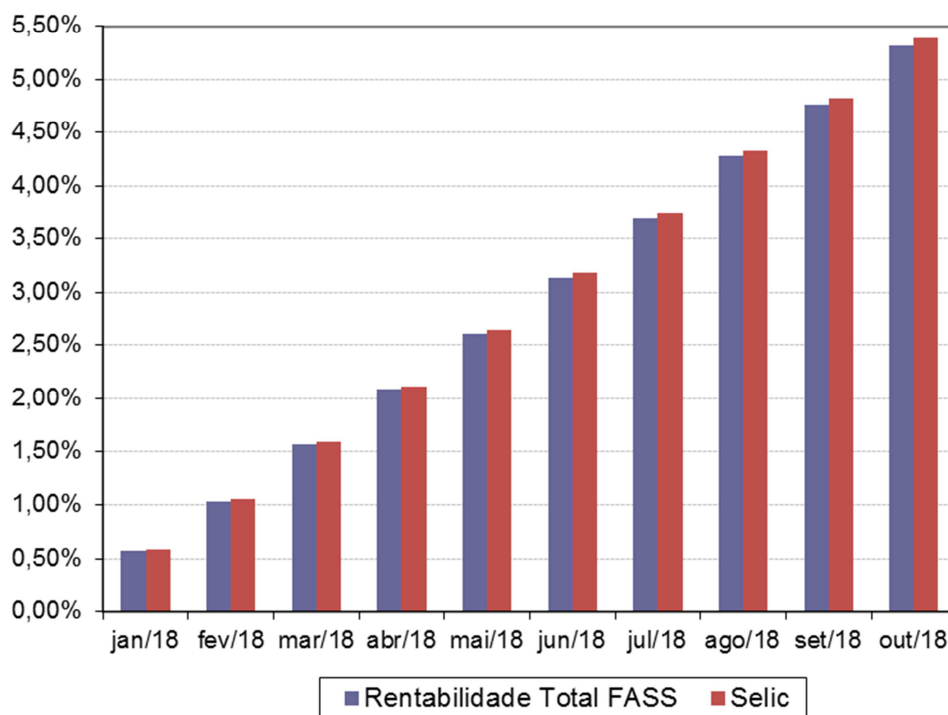
## FASS

| ATIVOS FINANCEIROS - FASS                   | Rentabilidade Nominal |           | Rentabilidade em relação à Selic |            |
|---------------------------------------------|-----------------------|-----------|----------------------------------|------------|
|                                             | out/18                | Acum. Ano | out/18                           | Acum. 2018 |
| FI CAIXA PCRJ RF                            | 0,53%                 | 5,31%     | 98,34%                           | 98,65%     |
| FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa | 0,47%                 | 4,65%     | 86,53%                           | 86,33%     |
| Rentabilidade Total FASS                    | 0,53%                 | 5,31%     | 98,34%                           | 98,64%     |
| Selic                                       | 0,54%                 | 5,39%     |                                  |            |

### 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 atuarial de 42,83% (Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa), 48,50%(Caixa Brasil Referenciado DI LP) e 85,23% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal e 46,33% 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 75,39% no mês em relação à meta e 152,30% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 58,58% e 98,27% em relação à meta e à taxa Selic, respectivamente.