

Relatório Mensal

2019

Setembro

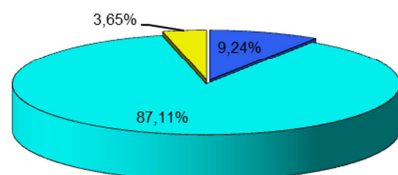
Instituto de Previdência e Assistência do Município do Rio de Janeiro - PREVI-RIO

DIRETORIA DE
INVESTIMENTOS

Composição da Carteira

Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)

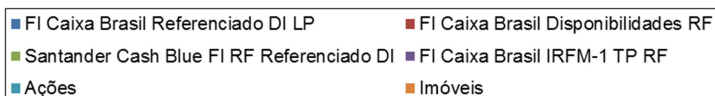
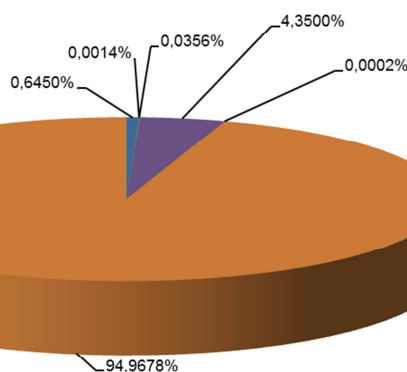


Valor da Carteira pelo Mercado

PREVI-RIO	R\$	76.558.577,44
FUNPREVI	R\$	721.841.430,34
FASS	R\$	30.247.266,41



FUNPREVI



Valor por Tipo de Ativo pelo Mercado

FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	R\$	4.655.991,93
FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$	10.125,74
Santander Cash Blue FI RF Referenciado DI	R\$	256.656,70
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$	31.400.239,97
Ações	R\$	1.416,00
Subtotal Valores Mobiliários Funprevi	R\$	36.324.430,34
Imóveis	R\$	685.517.000,00
Total Carteira Funprevi	R\$	721.841.430,34

Estoque de Royalties de Petróleo (a vencer)

Valor Presente	R\$	4.263.055.156,05
----------------	-----	------------------

Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos

Saldo (setembro 2019)	R\$	376.347.252,10
-----------------------	-----	----------------

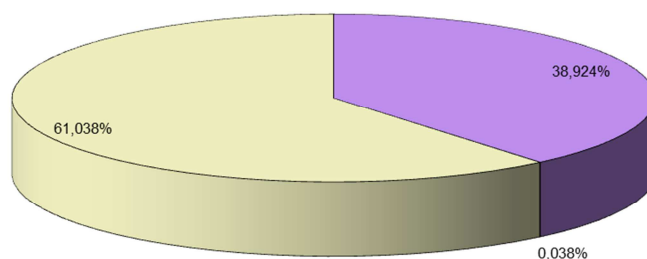
Valor de Aluguel Mensal dos Imóveis

Setembro 2019	R\$	3.946.875,46
---------------	-----	--------------

Composição da Carteira

Ativos Mobiliários e Imobiliários

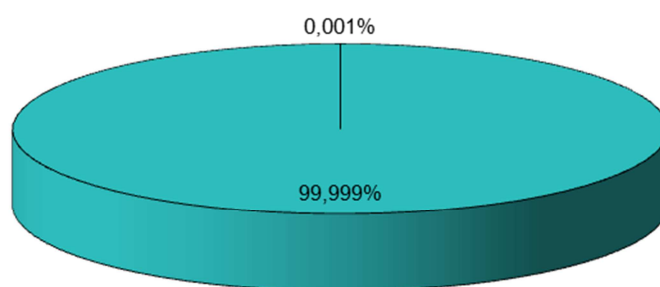
PREVI-RIO



■ 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\$ 29.799.315,74
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	R\$ 29.269,73
Subtotal Valores Mobiliários Previ-Rio	R\$ 29.828.585,47
Imóveis	R\$ 46.729.991,97
Total Carteira Previ-Rio	R\$ 76.558.577,44

FASS



■ FI CAIXA PCRJ RF ■ FI Caixa Brasil Disponibilidades RF

Valor da Carteira	
FI CAIXA PCRJ RF	R\$ 30.247.077,16
FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 189,25
Total Carteira FASS	R\$ 30.247.266,41

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

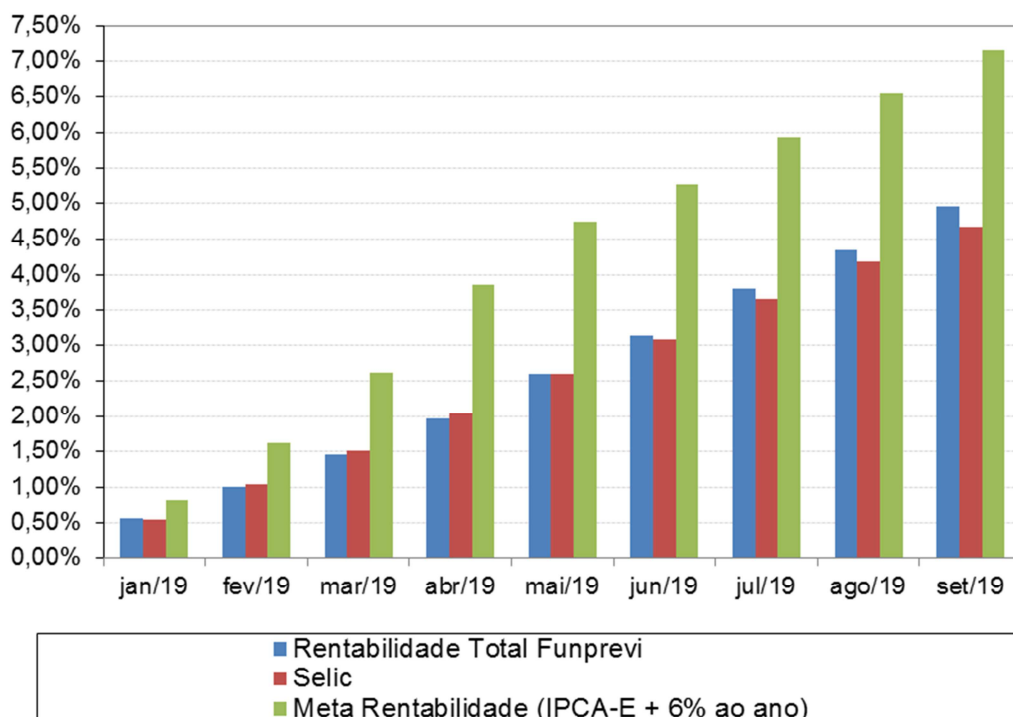
FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	set/19	Acum. Ano	set/19	Acum. 2019	set/19	Acum. 2019
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,45%	4,55%	77,55%	63,54%	96,19%	97,60%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,39%	4,01%	68,62%	55,94%	85,12%	85,92%
Santander Cash Blue FI RF Referenciado DI	0,43%	4,35%	75,14%	60,71%	93,21%	93,25%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,63%	5,15%	108,95%	71,97%	135,15%	110,54%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Funprevi	0,57%	4,95%	99,95%	69,15%	123,99%	106,22%
Meta Rentabilidade	0,58%	7,16%				
Selic	0,46%	4,66%				

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

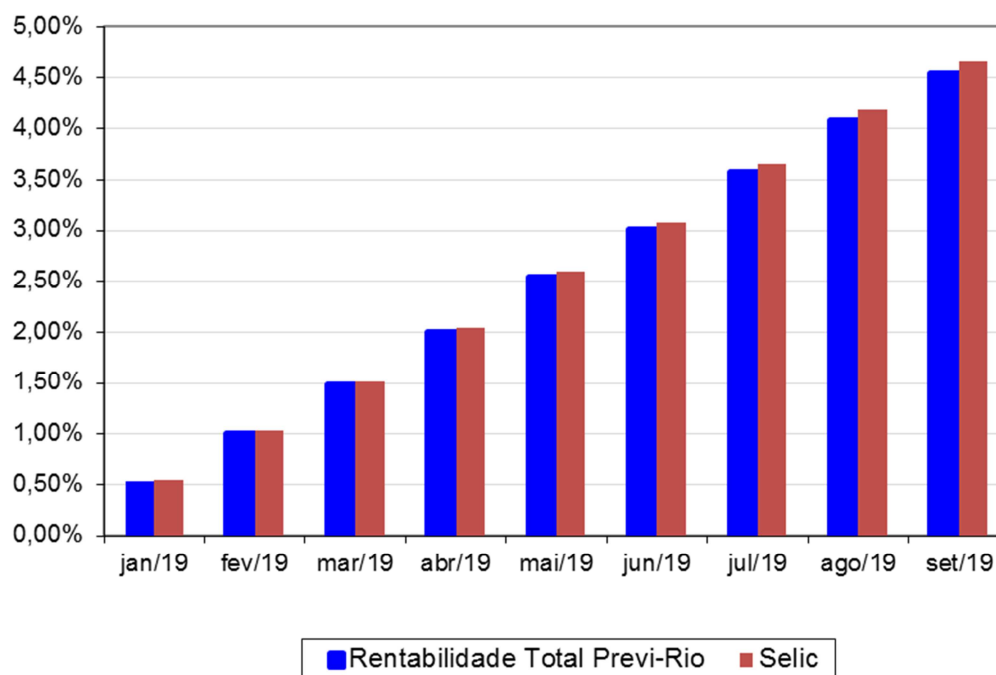
PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	set/19	Acum. Ano	set/19	Acum. 2019
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,45%	4,55%	96,19%	97,60%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,39%	4,01%	85,12%	85,92%
Rentabilidade Total Previ-Rio	0,45%	4,55%	96,17%	97,59%
Selic	0,46%	4,66%		

OBSERVAÇÕES:

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

Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

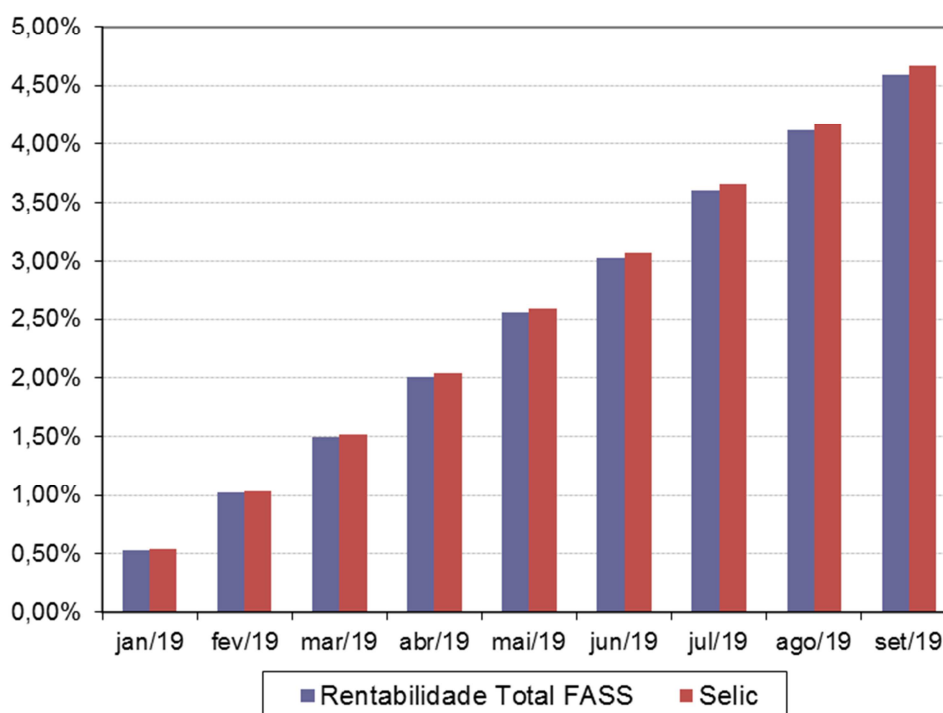
FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	set/19	Acum. Ano	set/19	Acum. 2019
FI CAIXA PCRJ RF	0,46%	4,59%	98,71%	98,51%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,39%	4,01%	85,12%	85,92%
Rentabilidade Total FASS	0,46%	4,59%	98,70%	98,51%
Selic	0,46%	4,66%		

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 de rentabilidade ⁽¹⁾ de 68,62% (Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa), 77,55% (Caixa Brasil Referenciado DI LP) e 108,95% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal; e 75,14% 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 99,95% em relação à meta e de 123,99% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 69,15% e de 106,22% em relação à meta e à taxa Selic, respectivamente.

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