

Relatório Mensal

2018

Dezembro

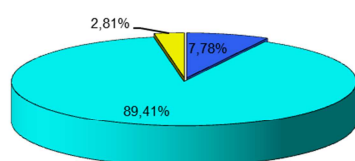
Instituto de Previdência e Assistência do Município do Rio de
Janeiro - PREVI-RIO

DIRETORIA DE
INVESTIMENTOS

Composição da Carteira

Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

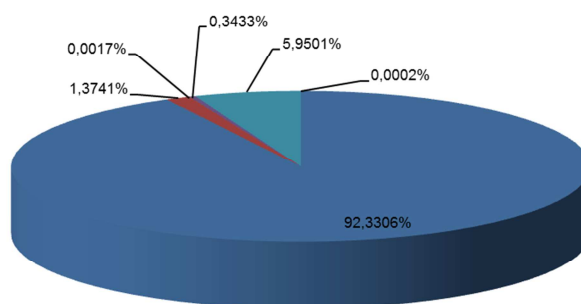
TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)



Valor da Carteira pelo Mercado		
PREVI-RIO	R\$	53.166.832,60
FUNPREVI	R\$	611.145.289,36
FASS	R\$	19.202.307,15

■ PREVI-RIO ■ FUNPREVI ■ FASS

FUNPREVI



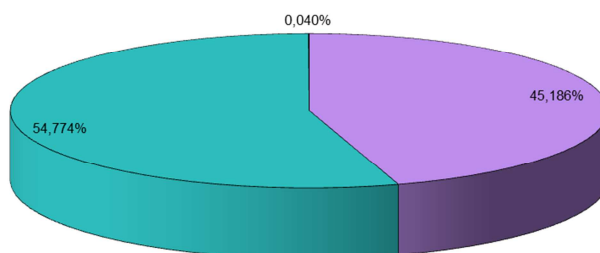
■ Imóveis ■ FI Caixa Brasil Referenciado DI LP
■ FI Caixa Brasil Disponibilidades RF ■ Cash Blue FI RF Referenciado DI
■ FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF ■ Ações

Valor por Tipo de Ativo pelo Mercado	
Imóveis	R\$ 564.274.000,00
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	R\$ 8.397.714,06
FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 10.356,06
Cash Blue FI RF Referenciado DI	R\$ 2.098.193,61
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 36.363.609,63
Ações	R\$ 1.416,00
Estoque de Royalties de Petróleo (a vencer)	
Valor Presente	R\$ 4.682.986.127,79
Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos	
Saldo (dezembro 2018)	R\$ 418.709.933,35
Valor de Aluguel Mensal dos Imóveis	
Dezembro 2018	R\$ 3.736.515,15

Composição da Carteira

Ativos Mobiliários e Imobiliários

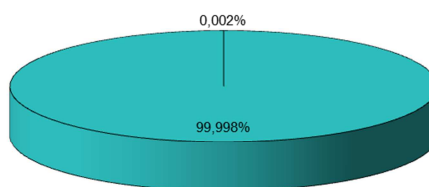
PREVI-RIO



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

Valor da Carteira		
Imóveis	R\$	24.023.991,97
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R\$	29.121.684,40
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	R\$	21.156,23

FASS



FI CAIXA PCRJ RF FI Caixa Brasil Disponibilidades RF

Valor da Carteira		
FI CAIXA PCRJ RF	R\$	19.201.908,21
FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$	398,94

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

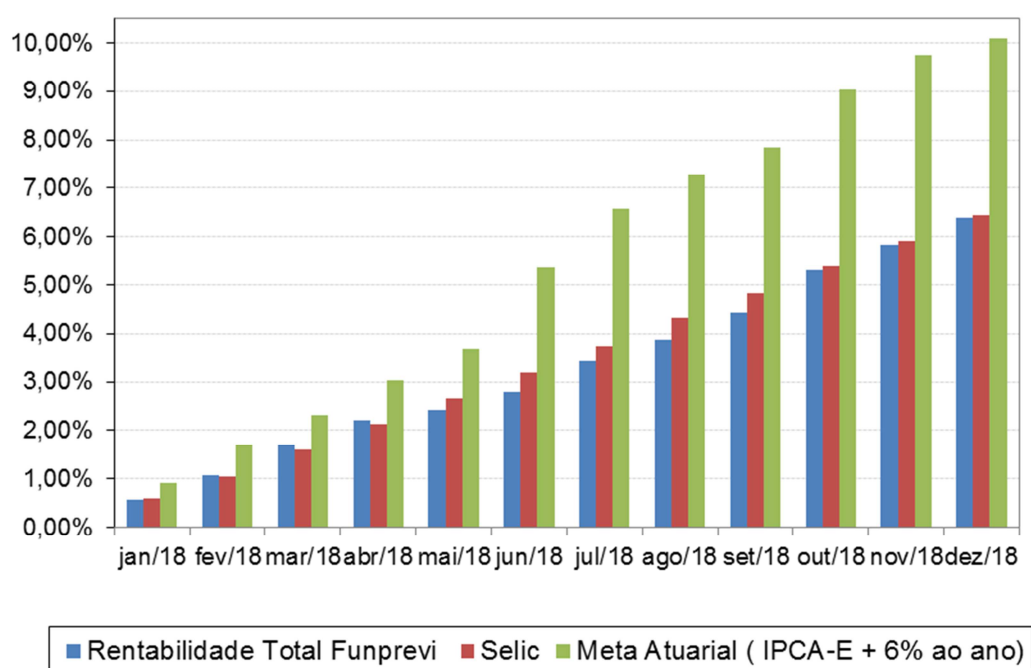
FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	dez/18	Acum. Ano	dez/18	Acum. 2018	dez/18	Acum. 2018
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,48%	6,23%	156,93%	61,74%	97,45%	96,89%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,43%	5,55%	139,23%	54,96%	86,46%	86,25%
Santander Cash Blue RF Referenciado DI FI	0,46%	5,98%	150,42%	59,22%	93,41%	92,94%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,54%	6,81%	176,95%	67,43%	109,89%	105,82%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Funprevi	0,52%	6,38%	169,70%	63,23%	105,38%	99,24%
Meta Atuarial	0,31%	10,09%				
Selic	0,49%	6,43%				

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

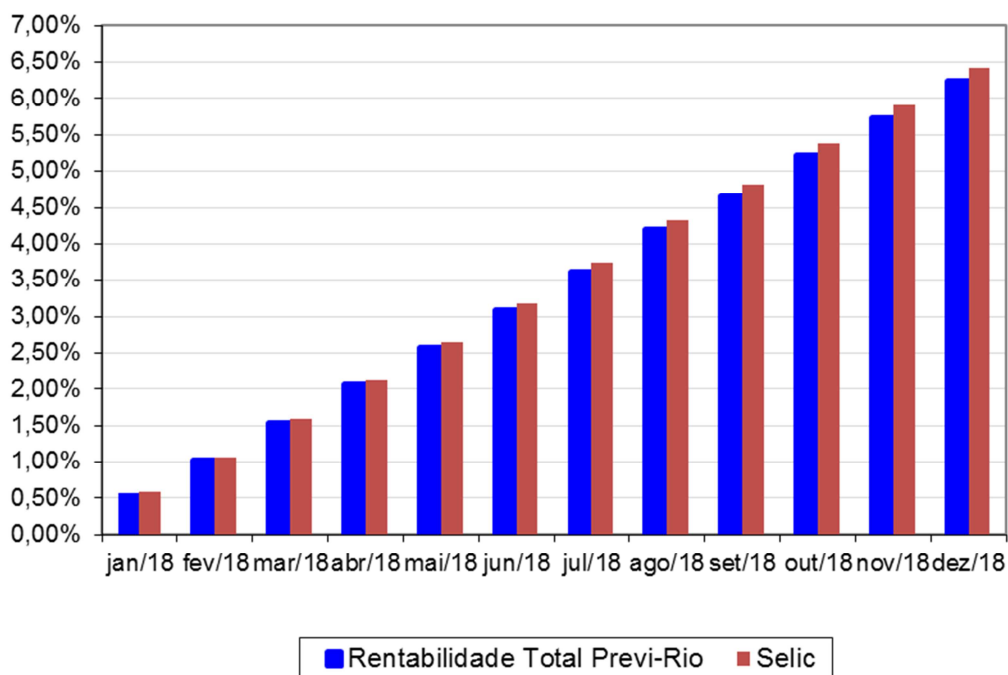
PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	dez/18	Acum. Ano	dez/18	Acum. 2018
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,48%	6,23%	97,45%	96,89%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,43%	5,55%	86,46%	86,25%
Rentabilidade Total Previ-Rio	0,48%	6,24%	97,44%	97,07%
Selic	0,49%	6,43%		

OBSERVAÇÕES:

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

Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

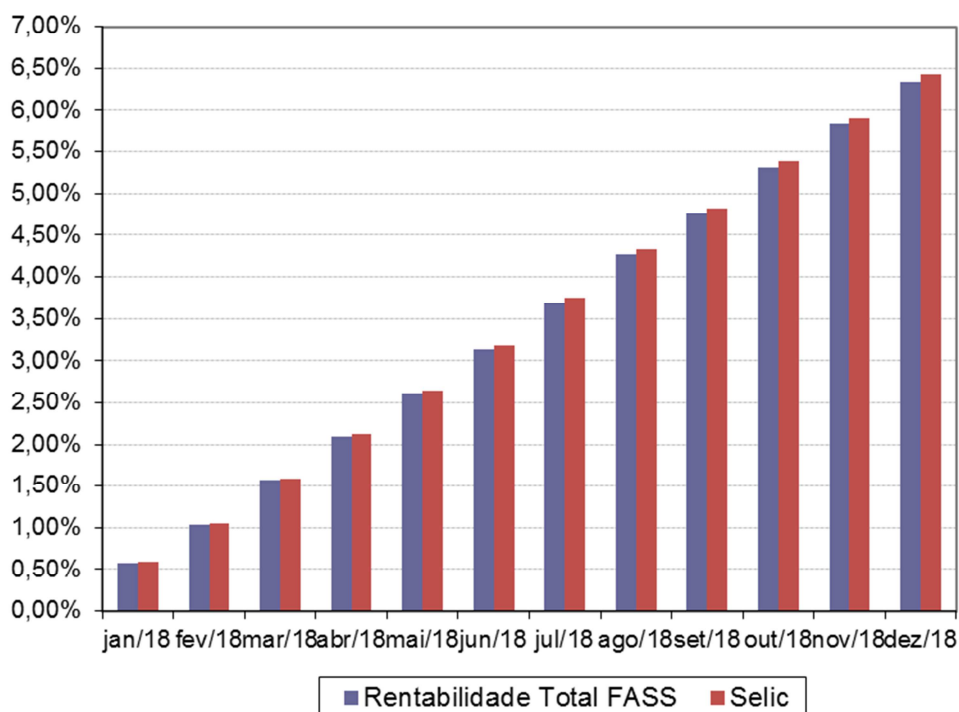
FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	dez/18	Acum. Ano	dez/18	Acum. 2018
FI CAIXA PCRJ RF	0,49%	6,34%	98,34%	98,58%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,43%	5,55%	86,46%	86,25%
Rentabilidade Total FASS	0,49%	6,34%	98,34%	98,58%
Selic	0,49%	6,43%		

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 dezembro, rentabilidades em relação à meta atuarial ⁽¹⁾ de 139,23% (Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa), 156,93% (Caixa Brasil Referenciado DI LP) e 176,95% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal; e 150,42% 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 de 169,70% no mês em relação à meta e 105,38% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 63,23% e 99,24% em relação à meta e à taxa Selic, respectivamente.

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