

Relatório Mensal

2018

Novembro

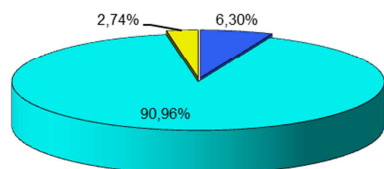
Instituto de Previdência e Assistência do Município do Rio de
Janeiro - PREVI-RIO

DIRETORIA DE
INVESTIMENTOS

Composição da Carteira

Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

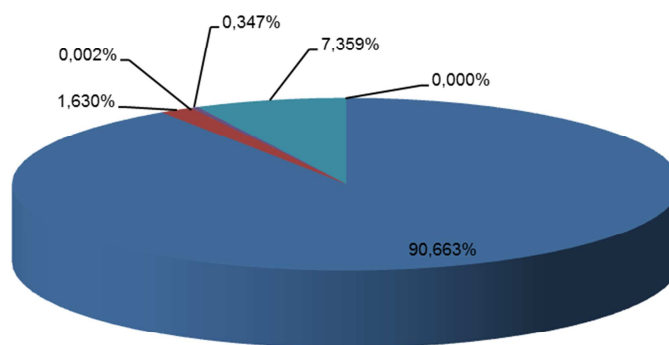
TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)



Valor da Carteira pelo Mercado	
PREVI-RIO	R\$ 41.742.653,69
FUNPREVI	R\$ 602.507.291,73
FASS	R\$ 18.170.771,59



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\$ 9.819.869,98
FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 10.866,69
Cash Blue FI RF Referenciado DI	R\$ 2.088.564,54
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 44.337.574,52
Ações	R\$ 1.416,00

Estoque de Royalties de Petróleo (a vencer)	
Valor Presente	R\$ 4.797.669.762,33

Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos	
Saldo (novembro 2018)	R\$ 425.446.711,63

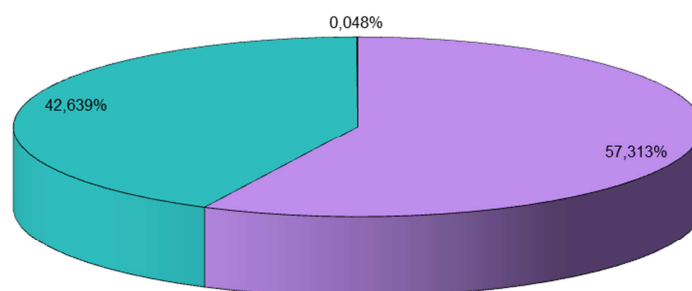
Valor de Aluguel Mensal dos Imóveis	
Novembro 2018	R\$ 3.736.515,15

Obs: Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos é composto por saldos devedores por empreendimento (R\$ 425.334.346,97) e outros empréstimos concedidos a funcionários (R\$ 112.364,66).

Composição da Carteira

Ativos Mobiliários e Imobiliários

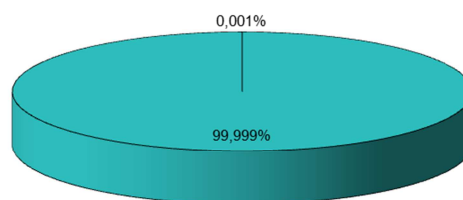
PREVI-RIO



■ 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\$	17.798.772,10
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	R\$	19.889,62

FASS



■ FI CAIXA PCRJ RF ■ FI Caixa Brasil Disponibilidades RF

Valor da Carteira		
FI CAIXA PCRJ RF	R\$	18.170.643,77
FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$	127,82

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

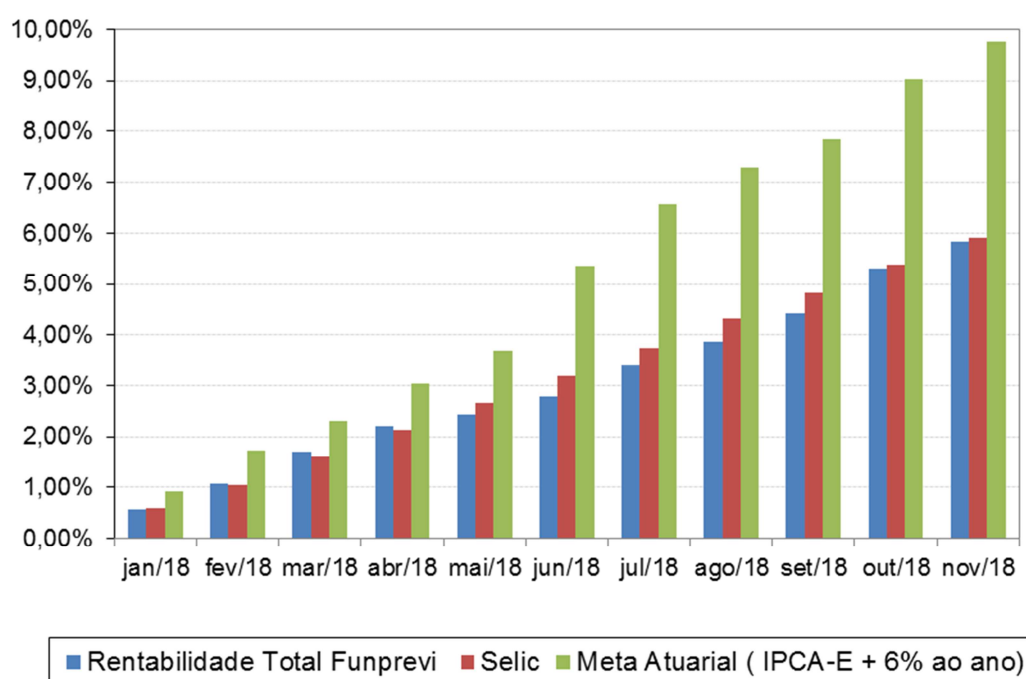
FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	nov/18	Acum. Ano	nov/18	Acum. 2018	nov/18	Acum. 2018
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,49%	5,72%	73,76%	58,65%	98,36%	96,85%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,43%	5,10%	64,83%	52,26%	86,44%	86,29%
Santander Cash Blue RF Referenciado DI FI	0,46%	5,49%	70,04%	56,28%	93,40%	92,93%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,53%	6,23%	80,28%	63,85%	107,05%	105,43%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Funprevi	0,51%	5,83%	77,46%	59,77%	103,28%	98,70%
Meta Atuarial	0,66%	9,76%				
Selic	0,49%	5,91%				

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

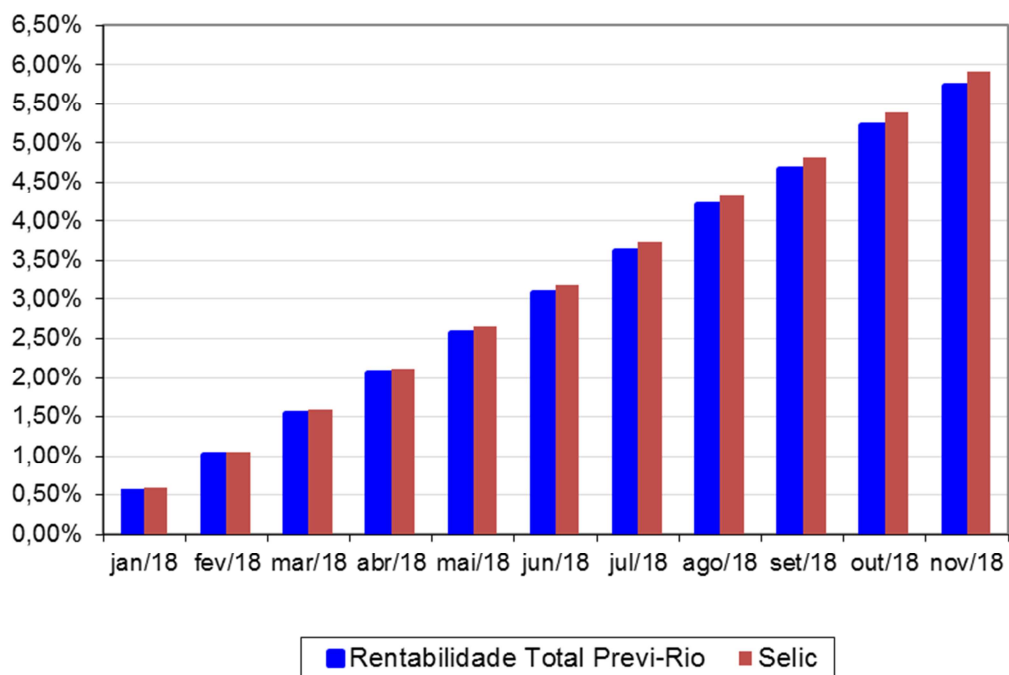
PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	nov/18	Acum. Ano	nov/18	Acum. 2018
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,49%	5,72%	98,36%	96,85%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,43%	5,10%	86,44%	86,29%
Rentabilidade Total Previ-Rio	0,49%	5,73%	98,34%	97,05%
Selic	0,49%	5,91%		

OBSERVAÇÕES:

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

Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

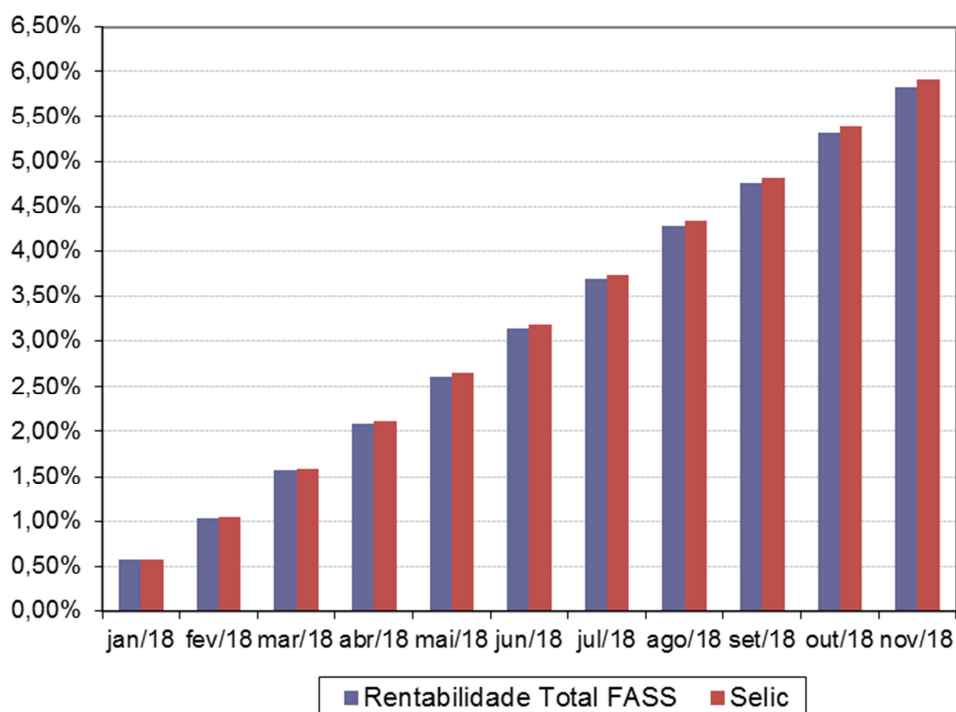
FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	nov/18	Acum. Ano	nov/18	Acum. 2018
FI CAIXA PCRJ RF	0,49%	5,83%	98,33%	98,61%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,43%	5,10%	86,44%	86,29%
Rentabilidade Total FASS	0,49%	5,83%	98,30%	98,61%
Selic	0,49%	5,91%		

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 novembro, rentabilidades em relação à meta atuarial ⁽¹⁾ de 64,83% (Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa), 73,76% (Caixa Brasil Referenciado DI LP) e 80,28% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal; e 70,04% 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 77,46% no mês em relação à meta e 103,28% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 59,77% e 98,70% em relação à meta e à taxa Selic, respectivamente.

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