

Relatório Mensal

2018

Março

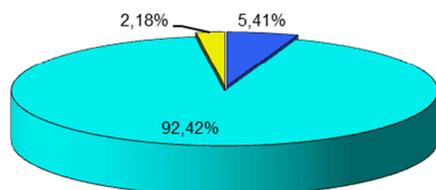
Instituto de Previdência e Assistência do Município do Rio de Janeiro - PREVI-RIO

DIRETORIA DE
INVESTIMENTOS

Composição da Carteira

Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

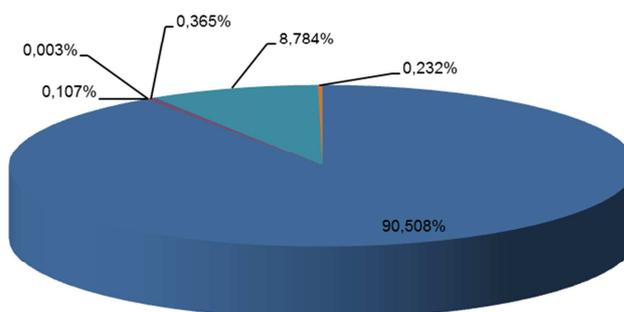
TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)



Valor da Carteira pelo Mercado	
PREVI-RIO	R\$ 32.172.530,03
FUNPREVI	R\$ 550.056.040,31
FASS	R\$ 12.956.616,54



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\$ 497.846.000,00
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	R\$ 587.966,30
FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 16.964,02
Cash Blue FI RF Referenciado DI	R\$ 2.009.208,86
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 48.318.346,94
Ações	R\$ 1.277.554,19

Estoque de Royalties de Petróleo (a vencer)	
Valor Presente (abr/2018 a dez/2059)	R\$ 4.683.018.767,27

Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos	
Saldo (março 2018)	R\$ 459.503.980,08

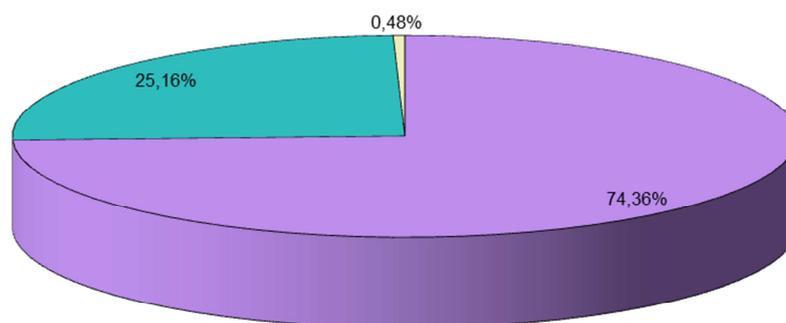
Valor de Aluguel Mensal dos Imóveis	
Março 2018	R\$ 3.736.515,15

Obs: Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos é composto por saldos devedores por empreendimento (R\$ 459.391.615,42) e outros empréstimos concedidos a funcionários (R\$ 112.364,66).

Composição da Carteira

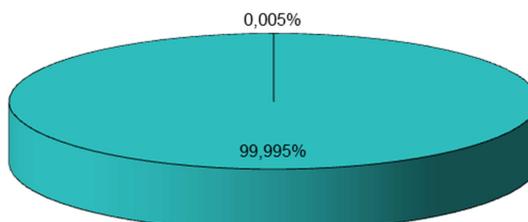
Ativos Mobiliários e Imobiliários

PREVI-RIO



Valor da Carteira	
Imóveis	R\$ 23.923.991,97
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R\$ 8.094.902,00
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	R\$ 153.636,06

FASS



Valor da Carteira	
FI CAIXA PCRJ RF	R\$ 12.956.007,38
FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 609,16

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

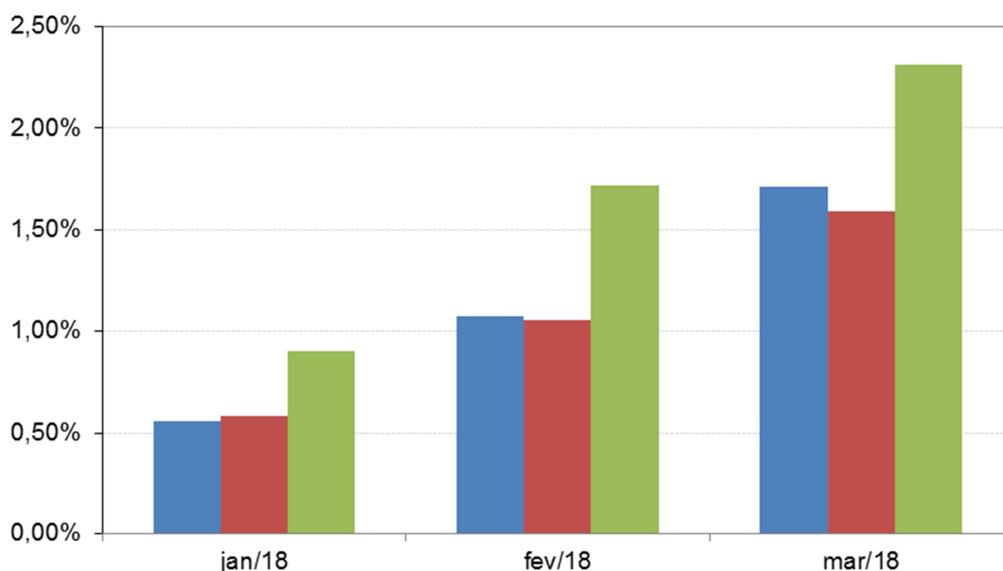
FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	mar/18	Acum. Ano	mar/18	Acum. 2018	mar/18	Acum. 2018
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,51%	1,53%	87,12%	66,12%	96,57%	96,19%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,46%	1,38%	78,35%	59,78%	86,85%	86,97%
Cash Blue Fundo de Investimento RF Referenciado DI	0,50%	1,48%	84,14%	63,99%	93,27%	93,10%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,64%	1,75%	108,12%	75,67%	119,85%	110,08%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Funprevi	0,63%	1,71%	106,22%	73,84%	117,75%	107,42%
Meta Atuarial	0,59%	2,32%				
Selic	0,53%	1,59%				

OBSERVAÇÕES::

- 1) Aplicações informadas com posição de fechamento do último dia útil.
- 2) Os recursos aplicados no Fundo Cash Blue FI RF Referenciado DI estão bloqueados em uma conta controlada no Banco Citibank em 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

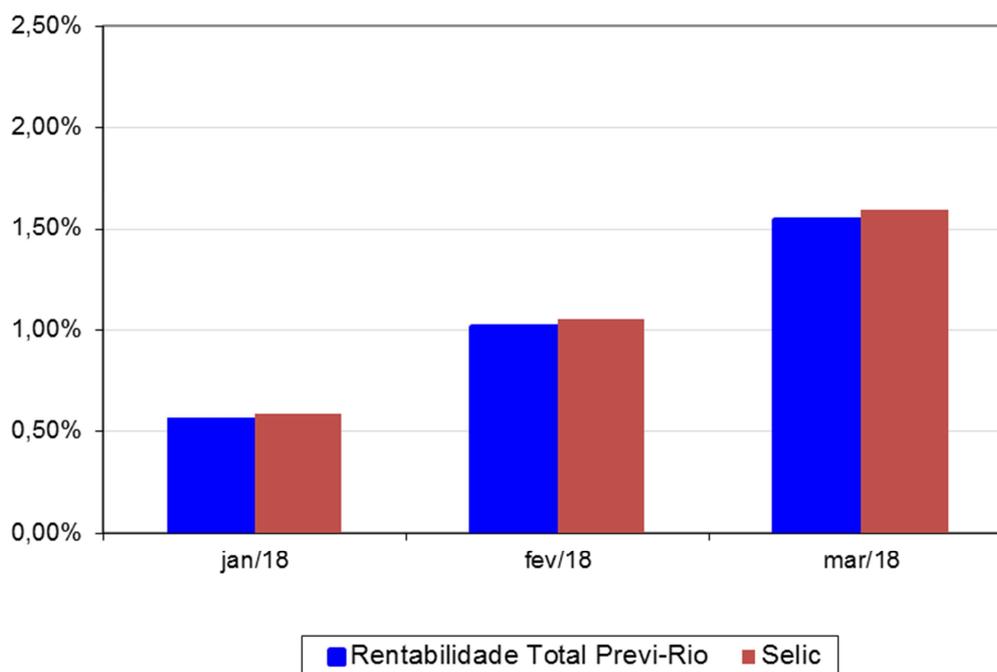
PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	mar/18	Acum. Ano	mar/18	Acum. 2018
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,51%	1,53%	96,57%	96,19%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,46%	1,38%	86,85%	86,97%
BB Previdenciário Renda Fixa Perfil	0,47%	1,51%	101,40%	99,63%
Rentabilidade Total Previ-Rio	0,52%	1,54%	97,75%	96,99%
Selic	0,53%	1,59%		

OBSERVAÇÕES:

- 1) Aplicações informadas com posição de fechamento do último dia útil.
- 2) Os recursos aplicados no Fundo BB Previdenciário RF Perfil foram resgatados em 26/03/2018.

Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

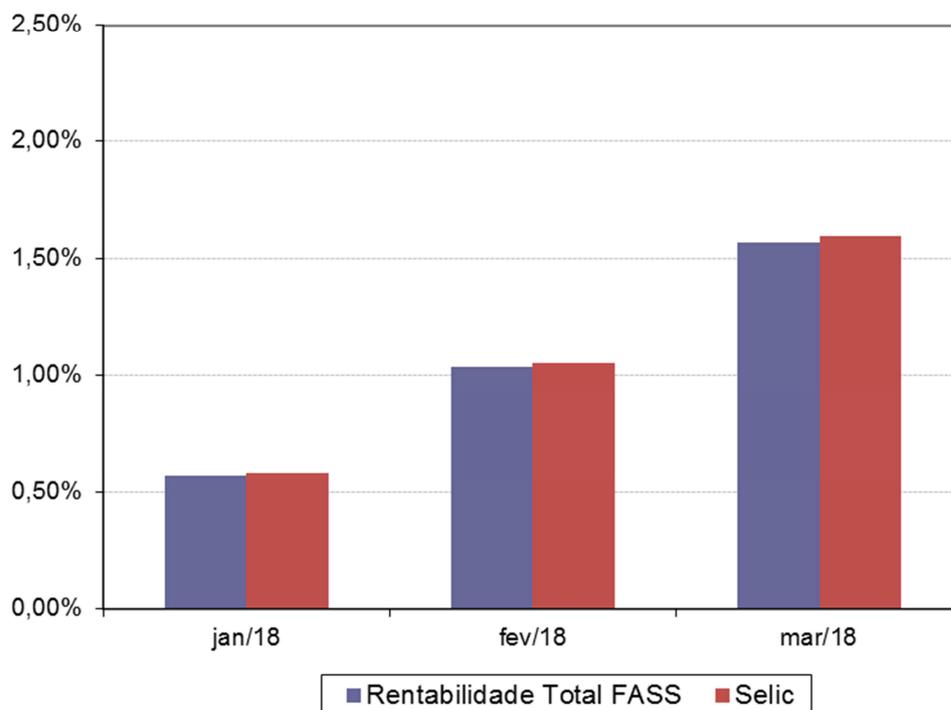
FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	mar/18	Acum. Ano	mar/18	Acum. 2018
FI CAIXA PCRJ RF	0,53%	1,57%	98,86%	98,42%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,46%	1,38%	86,85%	86,97%
Rentabilidade Total FASS	0,53%	1,57%	98,86%	98,42%
Selic	0,53%	1,59%		

OBSERVAÇÕES:

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

Rentabilidade Acumulada - FASS x Selic



CENÁRIO EXTERNO

Nos EUA, a política protecionista do presidente Trump com imposição de tarifas para importação de aço e alumínio trouxe incertezas para economias de países emergentes. Tais medidas trazem risco para o comércio global que poderá sofrer retração pelo desencadeamento de aumento de tarifas nas transações comerciais com os EUA, podendo causar impacto na aceleração da inflação americana, o que exercerá pressão para mais ajustes nos juros norte-americanos.

Na China, foi divulgada previsão para 2018 de 6,5% de crescimento do PIB, projeção inferior ao crescimento de 2017, indicando desaquecimento econômico em relação ao crescimento de 6,9% em 2017.

Na zona do euro, o crescimento permanece estável, seguindo a expansão econômica registrada na última década.

CENÁRIO INTERNO

O cenário econômico permanece positivo, a atividade industrial e o setor de serviços registraram crescimento em fevereiro. A inflação controlada, as contas externas favoráveis e a retomada, ainda que gradual, da atividade econômica favorecem a manutenção do ciclo de redução na taxa básica de juros.

A manutenção da política monetária expansionista ao longo do ano, que constitui um dos principais impulsionadores da recuperação econômica, dependerá da evolução da atividade econômica, da avaliação do nível de risco e das projeções e expectativas de inflação.

Por outro lado, as eleições e a dificuldade do atual governo em avançar com as reformas para equilíbrio fiscal seguem como os principais fatores de risco para a sustentabilidade desse cenário econômico favorável.

CARTEIRA FUNPREVI

Os fundos de investimentos que compõem a carteira do FUNPREVI apresentaram, em março, rentabilidades em relação à meta atuarial de 78,35% (Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa), 87,12% (Caixa Brasil Referenciado DI LP) e 108,12% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal e 84,14% o fundo onde está aplicado o recurso bloqueado em conta controlada (CASH BLUE FI RF Referenciado DI), relacionado à garantia de liberação total do terreno vendido ao Consulado dos EUA. Desta forma, a carteira registrou um desempenho de 106,22% no mês em relação à meta e 117,75% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 73,84% e 107,42% em relação à meta e à taxa Selic, respectivamente.