Relatório Mensal

2017

Outubro

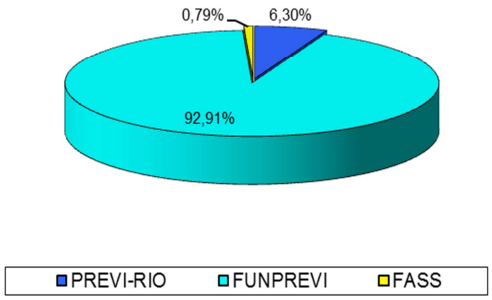
Instituto de Previdência e Assistência do Município do Rio de Janeiro - PREVI-RIO

DIRETORIA DE INVESTIMENTOS

Composição da Carteira

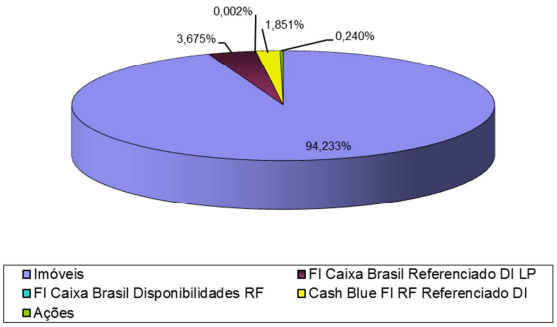
Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)



Valor da Carteira pelo Mercado		
PREVI-RIO	R$	35.839.815,67
FUNPREVI	R$	528.314.534,96
FASS	R$	4.468.620,63

FUNPREVI



Valor por Tipo de Ativo pelo Mercado		
Imóveis	R$	497.846.000,00
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	R$	19.413.292,09
FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R$	10.487,99
Cash Blue FI RF Referenciado DI	R$	9.777.383,38
Ações	R$	1.267.371,50

Estoque de Royalties de Petróleo (a vencer)	
Valor Presente (nov/2017 a dez/2059)	R$ 4.714.532.009,71

Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos		
Saldo Contábil (outubro 2017)	R$	482.829.540,29

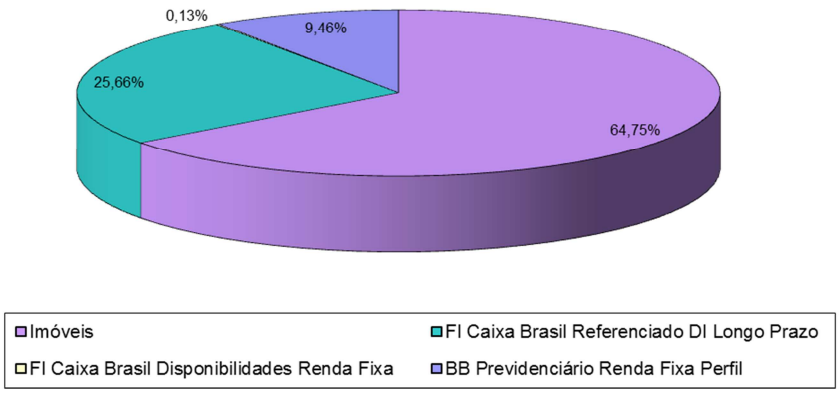
Valor de Aluguel Mensal dos Imóveis		
Outubro 2017	R$	3.629.901,55

Obs: Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos é composto saldos devedores por empreendimento (R$ 482.717.175,63) e outros empréstimos concedidos a funcionários (R$ 112.364,66).

Composição da Carteira

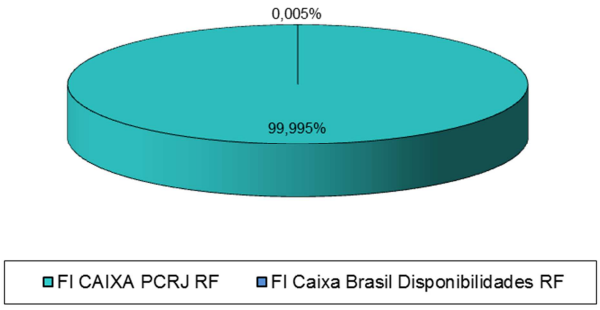
Ativos Mobiliários e Imobiliários

PREVI-RIO



Valor da Carteira		
Imóveis	R$	23.204.887,97
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R$	9.196.395,11
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	R$	46.704,45
BB Previdenciário Renda Fixa Perfil	R$	3.391.828,14

FASS



Valor da Carteira		
FI CAIXA PCRJ RF	R$	4.468.411,42
FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R$	209,21

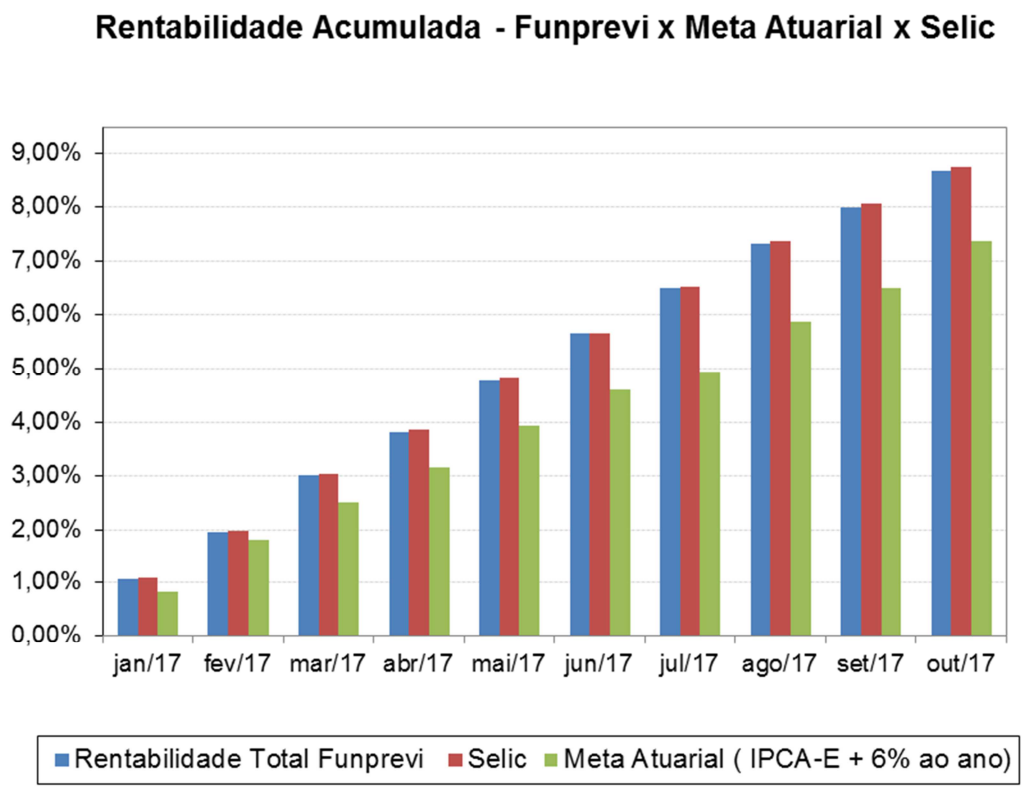
Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	out/17	Acum. Ano	out/17	Acum. 2017	out/17	Acum. 2017
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,65%	8,76%	78,40%	118,82%	101,15%	100,08%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,58%	7,99%	69,13%	108,38%	89,19%	91,29%
Cash Blue Fundo de Investimento RF Referenciado DI	0,62%	8,53%	74,72%	115,65%	96,40%	97,41%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Funprevi	0,65%	8,69%	77,71%	117,88%	100,25%	99,29%
Meta Atuarial	0,83%	7,38%				
Selic	0,65%	8,76%				

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.



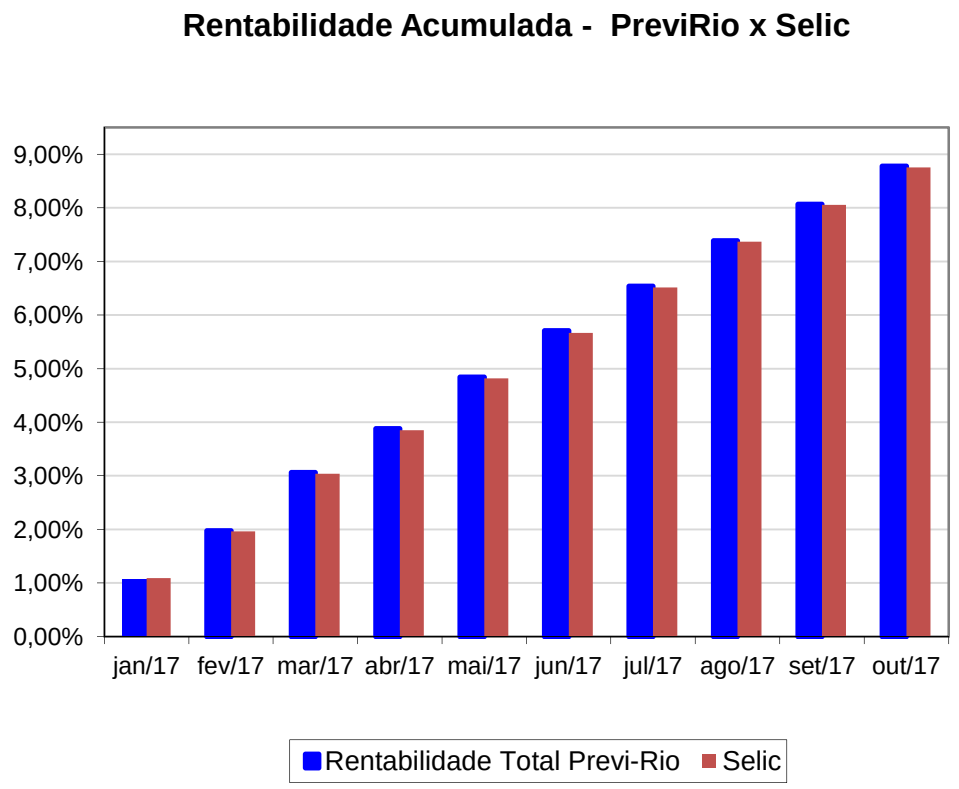
Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	out/17	Acum. Ano	out/17	Acum. 2017
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,65%	8,76%	101,15%	100,08%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,58%	7,99%	89,19%	91,29%
BB Previdenciário Renda Fixa Perfil	0,68%	8,83%	104,59%	100,84%
Rentabilidade Total Previ-Rio	0,66%	8,78%	101,85%	100,27%
Selic	0,65%	8,76%		

OBSERVAÇÕES:

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



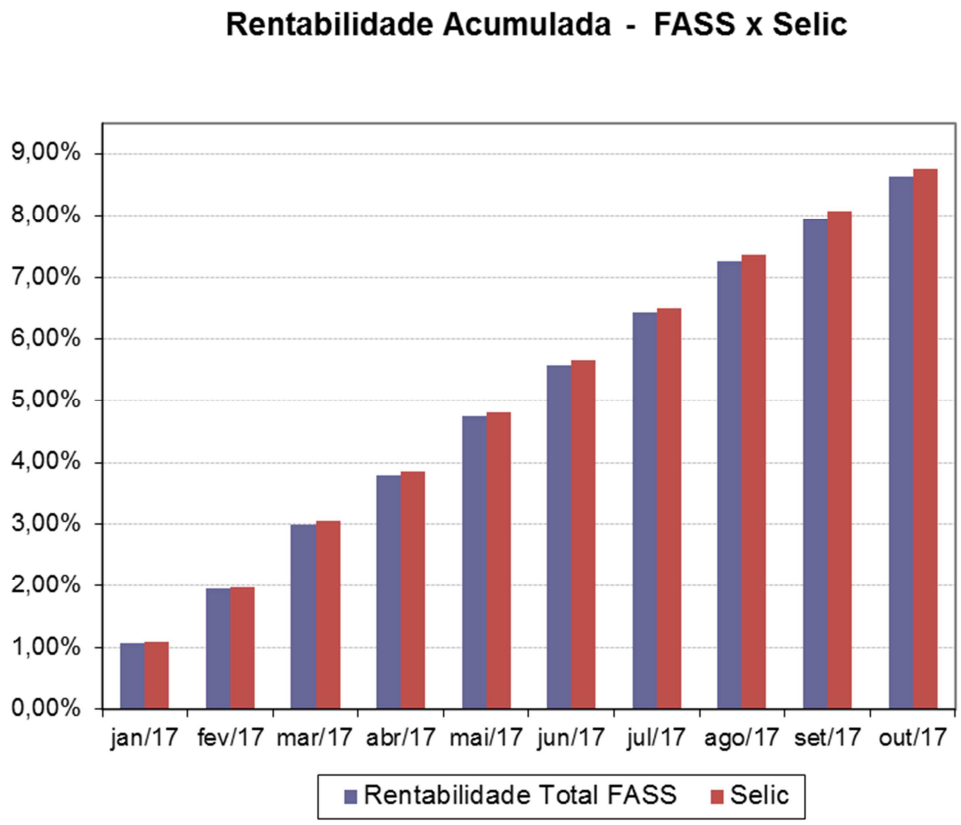
Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	out/17	Acum. Ano	out/17	Acum. 2017
FI CAIXA PCRJ RF	0,64%	8,67%	98,79%	99,00%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,58%	7,99%	89,19%	91,29%
Rentabilidade Total FASS	0,64%	8,63%	98,78%	98,60%
Selic	0,65%	8,76%		

OBSERVAÇÕES:

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



CENÁRIO EXTERNO

O cenário externo permanece favorável como nos últimos meses. O cenário global segue positivo para economias emergentes. O crescimento econômico com controle inflacionário gera condição para que a liquidez internacional ainda se mantenha elevada.

Após alguns meses em movimentos laterais, o dólar registrou sequência de valorização durante o mês de outubro, passando de R$ 3,09 no início de setembro para o patamar de R$ 3,28. Neste sentido, são fortes as evidências de que a alta da moeda americana contra diversas outras moedas está relacionada com especulações sobre os juros americanos e pelo anúncio do projeto de corte de impostos. Contudo, as incertezas sobre a aprovação do pacote de redução de impostos ainda são grandes, o que pode desacelerar o fortalecimento da moeda americana.

Na zona do Euro a economia permanece com vigor, registrando crescimento e inflação controlada entre os principais países do bloco.

CENÁRIO INTERNO

Os dados das últimas semanas reforçam as perspectivas positivas; a redução do risco Brasil com a trajetória de queda das taxas de juros amplia a perspectiva de estabilidade na taxa de câmbio. O superávit comercial atingiu US$ 58,5 bilhões até outubro/2017, que representa acréscimo de aproximadamente 52% em relação ao mesmo período do ano passado.

Os resultados recentes do mercado de trabalho brasileiro divulgados pela Pesquisa Nacional por Amostra de Domicílios Contínua (PNADC) revelam manutenção na trajetória de queda do desemprego que registrou para 12,6% para agosto/17 contra 12,8% em julho/17. Entretanto, uma das principais perspectivas de recuperação

gradual da economia para o próximo ano está na capacidade de o comércio varejista e, em especial, o consumo das famílias continuar em crescimento.
Por outro lado, a maior incerteza continua sendo a fragilidade das contas públicas e as constantes turbulências no campo político.

CARTEIRA FUNPREVI

Os fundos de investimentos que compõem a carteira do FUNPREVI apresentaram, em outubro, rentabilidades em relação à meta atuarial de 69,13% (Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa) e 78,40% (Caixa Brasil Referenciado DI LP), ambos da Caixa Econômica Federal e 74,72% 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 77,71% no mês em relação à meta e 100,25% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 117,88% e 99,29% em relação à meta e à taxa Selic, respectivamente.