

Relatório Mensal

2017

Novembro

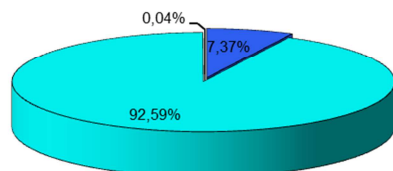
Instituto de Previdência e Assistência do Município do Rio de Janeiro - PREVI-RIO

DIRETORIA DE
INVESTIMENTOS

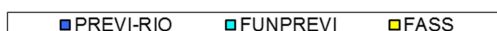
Composição da Carteira

Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

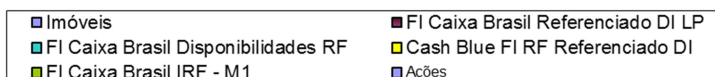
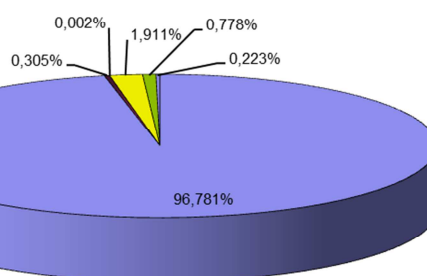
TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)



Valor da Carteira pelo Mercado	
PREVI-RIO	R\$ 40.945.901,33
FUNPREVI	R\$ 514.402.219,60
FASS	R\$ 196.575,46



FUNPREVI



Valor por Tipo de Ativo pelo Mercado	
Imóveis	R\$ 497.846.000,00
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	R\$ 1.567.565,67
FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 10.441,69
Cash Blue FI RF Referenciado DI	R\$ 9.829.825,72
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 4.000.000,00
Ações	R\$ 1.148.386,52

Estoque de Royalties de Petróleo (a vencer)	
Valor Presente (dez/2017 a dez/2059)	R\$ 4.712.381.248,70

Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos	
Saldo Contábil (novembro 2017)	R\$ 478.533.775,76

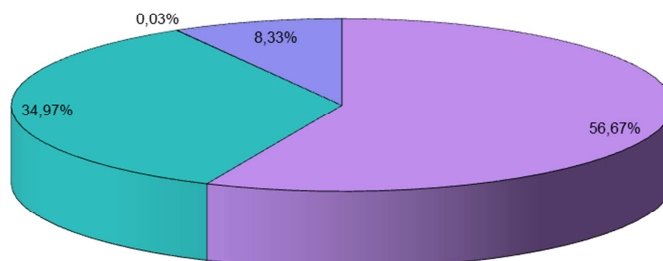
Valor de Aluguel Mensal dos Imóveis	
Novembro 2017	R\$ 3.629.901,55

Obs: Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos é composto por saldos devedores por empreendimento (R\$ 478.421.411,10) e outros empréstimos concedidos a funcionários (R\$ 112.364,66).

Composição da Carteira

Ativos Mobiliários e Imobiliários

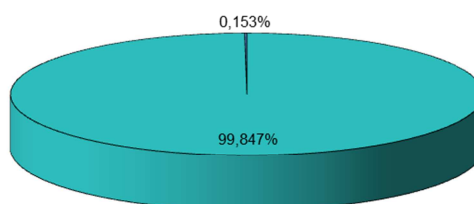
PREVI-RIO



Imóveis	FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	BB Previdenciário Renda Fixa Perfil

Valor da Carteira	
Imóveis	R\$ 23.204.887,97
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R\$ 14.317.902,55
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	R\$ 12.230,61
BB Previdenciário Renda Fixa Perfil	R\$ 3.410.880,20

FASS



FI CAIXA PCRJ RF	FI Caixa Brasil Disponibilidades RF
------------------	-------------------------------------

Valor da Carteira	
FI CAIXA PCRJ RF	R\$ 196.274,91
FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 300,55

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

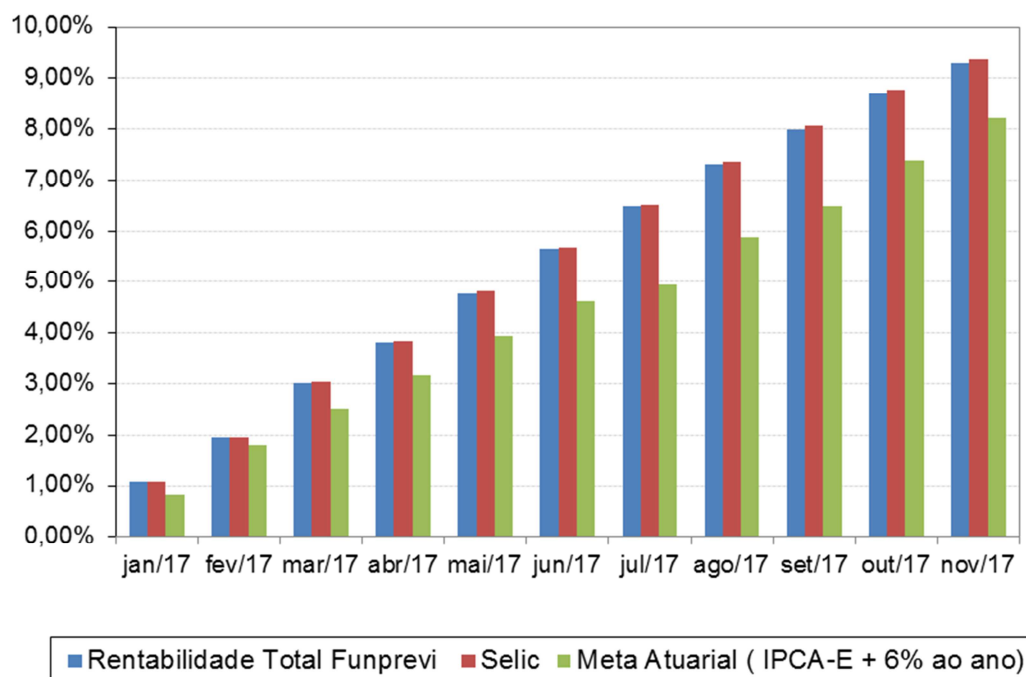
FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	nov/17	Acum. Ano	nov/17	Acum. 2017	nov/17	Acum. 2017
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,55%	9,37%	70,13%	113,89%	97,58%	99,92%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,50%	8,54%	63,34%	103,77%	88,13%	91,04%
Cash Blue Fundo de Investimento RF Referenciado DI	0,54%	9,11%	67,84%	110,79%	94,40%	97,20%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	-	-	-	-	-	-
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Funprevi	0,55%	9,29%	69,29%	112,95%	96,41%	99,10%
Meta Atuarial	0,79%	8,23%				
Selic	0,57%	9,38%				

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.
- 3) As aplicações no Fundo de Investimento Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa iniciaram em 30/11/2017, não gerando, portanto, rendimentos no presente mês.

Rentabilidade Acumulada - Funprevi x Meta Atuarial x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

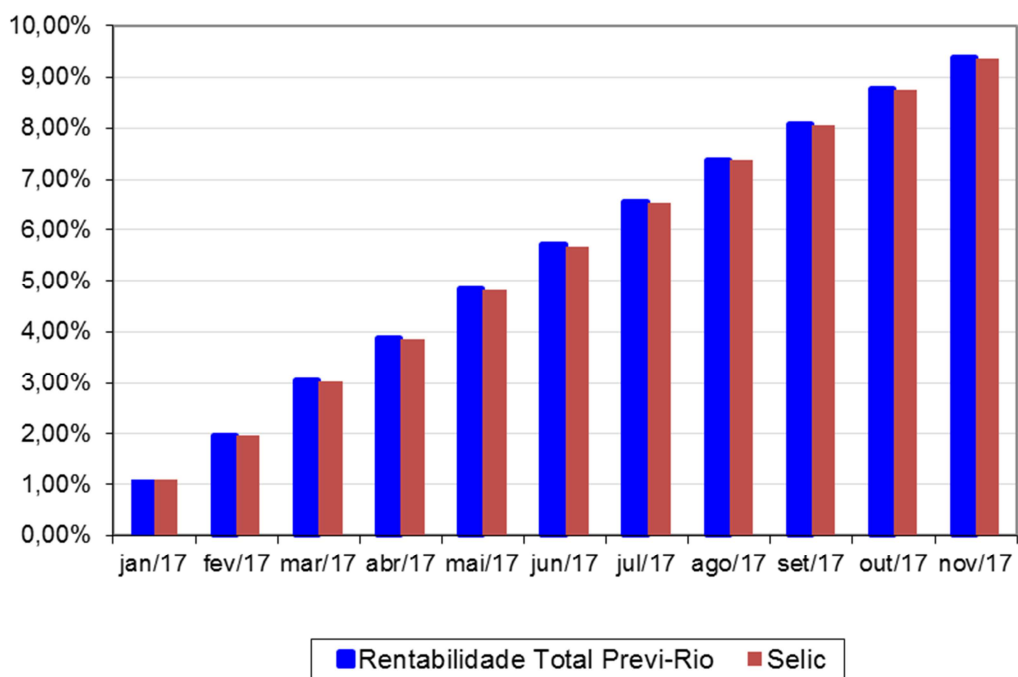
PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	nov/17	Acum. Ano	nov/17	Acum. 2017
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,55%	9,37%	97,58%	99,92%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,50%	8,54%	88,13%	91,04%
BB Previdenciário Renda Fixa Perfil	0,56%	9,44%	98,86%	100,72%
Rentabilidade Total Previ-Rio	0,55%	9,38%	97,61%	100,09%
Selic	0,57%	9,38%		

OBSERVAÇÕES:

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

Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

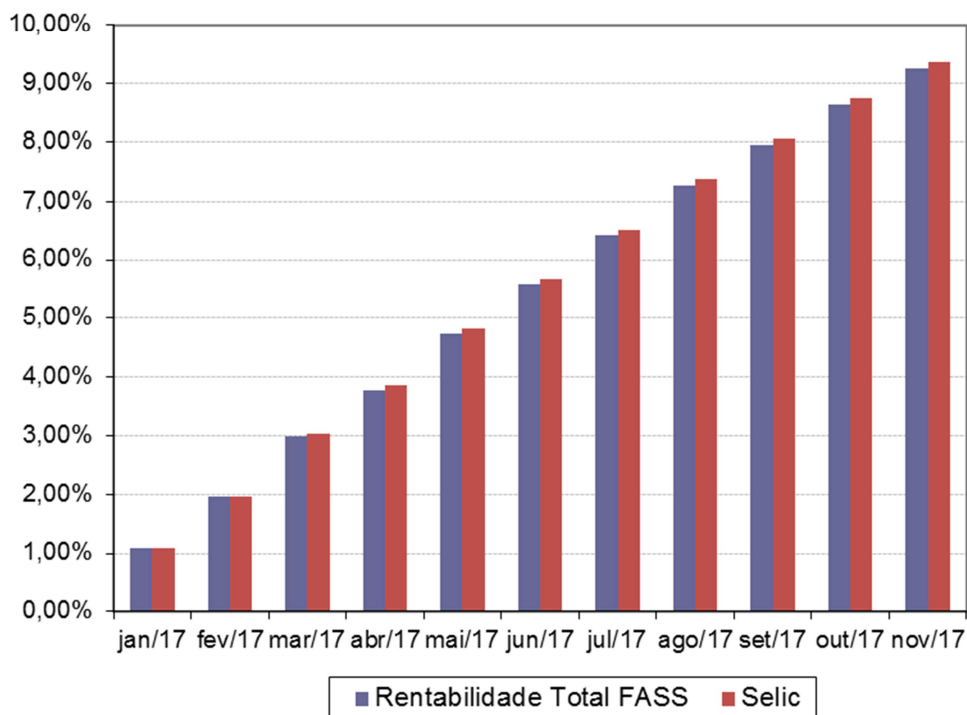
FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	nov/17	Acum. Ano	nov/17	Acum. 2017
FI CAIXA PCRJ RF	0,56%	9,28%	99,03%	98,99%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,50%	8,54%	88,13%	91,04%
Rentabilidade Total FASS	0,56%	9,25%	99,01%	98,62%
Selic	0,57%	9,38%		

OBSERVAÇÕES:

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

Rentabilidade Acumulada - FASS x Selic



CENÁRIO EXTERNO

Os dados da economia americana divulgados em outubro reforçam o cenário de crescimento forte nos Estados Unidos, o crescimento no 3º trimestre aponta para um PIB de 3,0% em 2017.

Na Zona do Euro, os indicadores das principais economias permanecem positivos, desempenho sustentado em grande parte pelos resultados de desempenho da produção industrial.

Na China, embora os últimos dados divulgados sobre o desempenho da economia tenham sido abaixo do esperado, o resultado da atividade econômica para setembro surpreendeu positivamente, oscilação que reforça o cenário de lenta e gradual desaceleração do crescimento observado nos últimos anos.

O ciclo de desempenho positivo das principais economias no mundo não tem causado pressões inflacionárias indesejadas, fato que deve contribuir para permanência do cenário de liquidez global. Além disso, a redução do risco país e a queda das taxas de juros continuam permitindo estabilidade na taxa de câmbio.

CENÁRIO INTERNO

A divulgação de dados recentes indica que a recuperação da economia brasileira segue em recuperação gradual, principalmente na evolução favorável no consumo das famílias.

Os juros médios anuais dos certificados de depósito interbancário (CDI) foram elevados. Para 2018, o juro médio projetado se manteve estável, em torno de 7,0%, entretanto a taxa média anual para 2019 atingiu 9,8%, ou seja, o mercado já projeta ajuste na política monetária.

O resultado da balança comercial permanece favorável. O superávit comercial de outubro registrou US\$ 5,2 bilhões. As exportações cresceram 38% na comparação com outubro de 2016 e aproximadamente 20% acumulado em relação ao ano

anterior. Por outro lado, as importações também aumentaram, atingindo crescimento de 9% acumulado no ano em relação a 2016.

Os índices de confiança de consumidores e empresas avançaram em outubro, permanecendo a tendência de alta observada no início do ano. Por outro lado, permanecem riscos importantes no ambiente político.

CARTEIRA FUNPREVI

Os fundos de investimentos que compõem a carteira do FUNPREVI apresentaram, em novembro, rentabilidades em relação à meta atuarial de 63,34% (Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa) e 70,13% (Caixa Brasil Referenciado DI LP), ambos da Caixa Econômica Federal e 67,84% 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 69,29% no mês em relação à meta e 96,41% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 112,95% e 99,10% em relação à meta e à taxa Selic, respectivamente.