

Relatório Mensal

2017

Dezembro

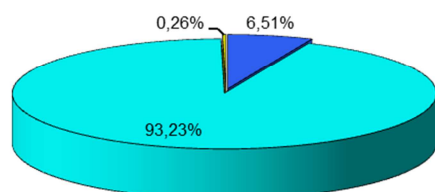
Instituto de Previdência e Assistência do Município do Rio de
Janeiro - PREVI-RIO

DIRETORIA DE
INVESTIMENTOS

Composição da Carteira

Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

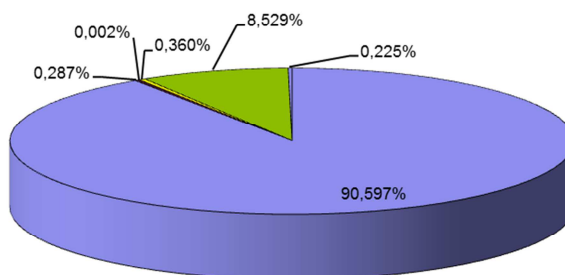
TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)



Valor da Carteira pelo Mercado	
PREVI-RIO	R\$ 38.385.781,39
FUNPREVI	R\$ 549.517.789,31
FASS	R\$ 1.517.477,74

■ 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

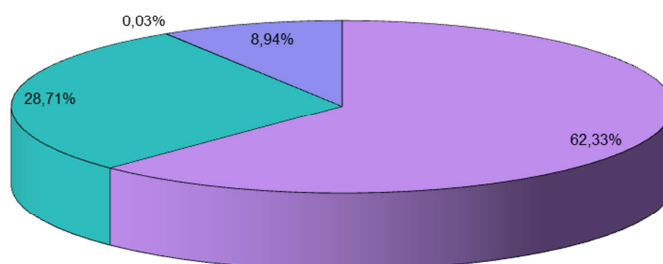
Valor por Tipo de Ativo pelo Mercado	
Imóveis	R\$ 497.846.000,00
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	R\$ 1.575.773,49
FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 10.711,31
Cash Blue FI RF Referenciado DI	R\$ 1.979.858,88
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 46.870.358,28
Ações	R\$ 1.235.087,35
Estoque de Royalties de Petróleo (a vencer)	
Valor Presente (jan/2018 a dez/2059)	R\$ 4.848.579.151,72
Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos	
Saldo (dezembro 2017)	R\$ 473.099.127,64
Valor de Aluguel Mensal dos Imóveis	
Dezembro 2017	R\$ 3.629.901,55

Obs: Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos é composto por saldos devedores por empreendimento (R\$ 472.986.762,98) e outros empréstimos concedidos a funcionários (R\$ 112.364,66).

Composição da Carteira

Ativos Mobiliários e Imobiliários

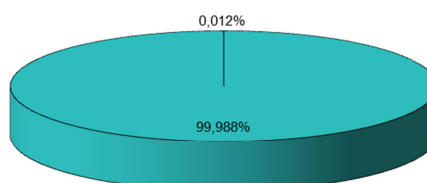
PREVI-RIO



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

Valor da Carteira		
Imóveis	R\$	23.923.991,97
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R\$	11.018.911,24
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	R\$	12.115,98
BB Previdenciário Renda Fixa Perfil	R\$	3.430.762,20

FASS



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

Valor da Carteira		
FI CAIXA PCRJ RF	R\$	1.517.296,49
FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$	181,25

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

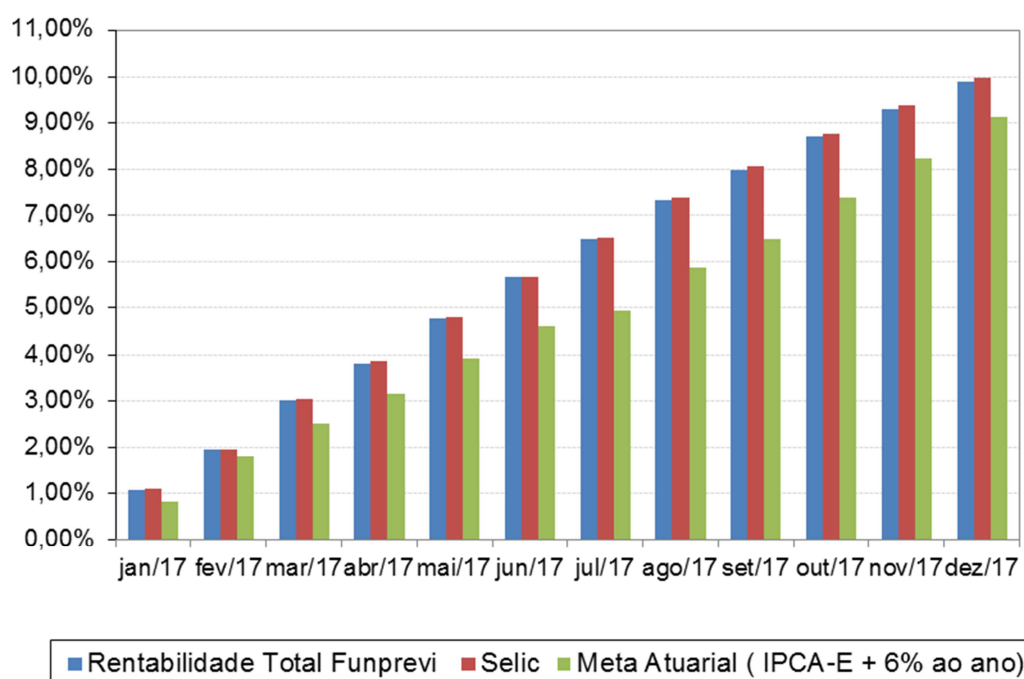
FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	dez/17	Acum. Ano	dez/17	Acum. 2017	dez/17	Acum. 2017
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,52%	9,94%	63,79%	109,07%	96,92%	99,74%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,47%	9,05%	57,64%	99,29%	87,57%	90,79%
Cash Blue Fundo de Investimento RF Referenciado DI	0,51%	9,67%	61,80%	106,07%	93,89%	96,99%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,57%	0,57%	69,18%	69,18%	105,10%	105,10%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Funprevi	0,54%	9,88%	66,22%	108,46%	100,60%	99,18%
Meta Atuarial	0,82%	9,11%				
Selic	0,54%	9,97%				

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.

Rentabilidade Acumulada - Funprevi x Meta Atuarial x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

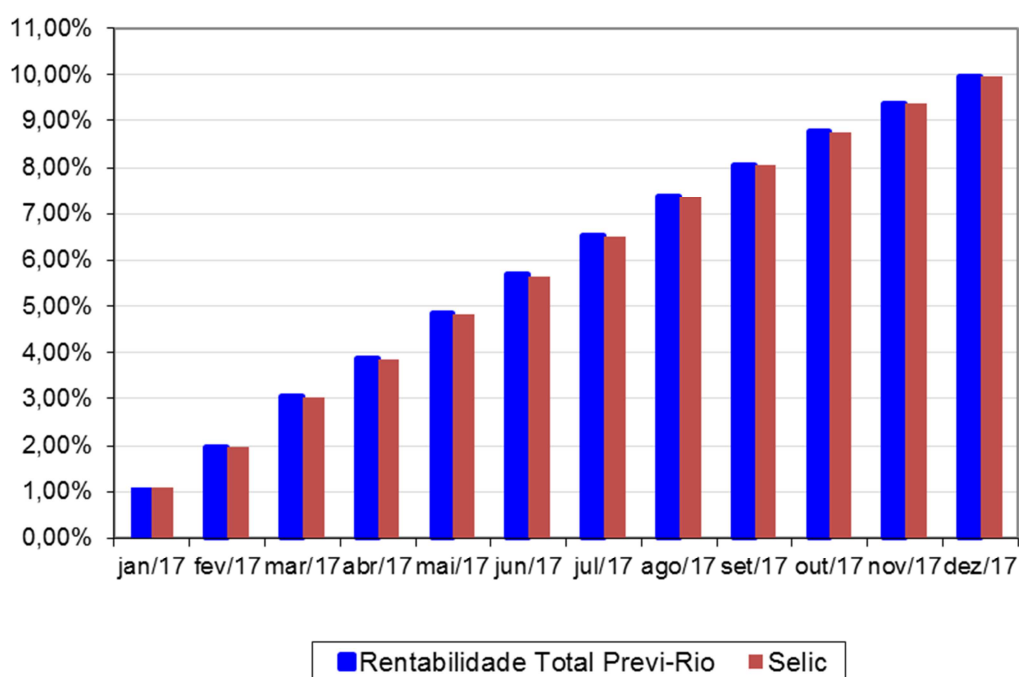
PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	dez/17	Acum. Ano	dez/17	Acum. 2017
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,52%	9,94%	96,92%	99,74%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,47%	9,05%	87,57%	90,79%
BB Previdenciário Renda Fixa Perfil	0,58%	10,08%	107,89%	101,15%
Rentabilidade Total Previ-Rio	0,53%	9,97%	98,53%	100,00%
Selic	0,54%	9,97%		

OBSERVAÇÕES:

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

Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

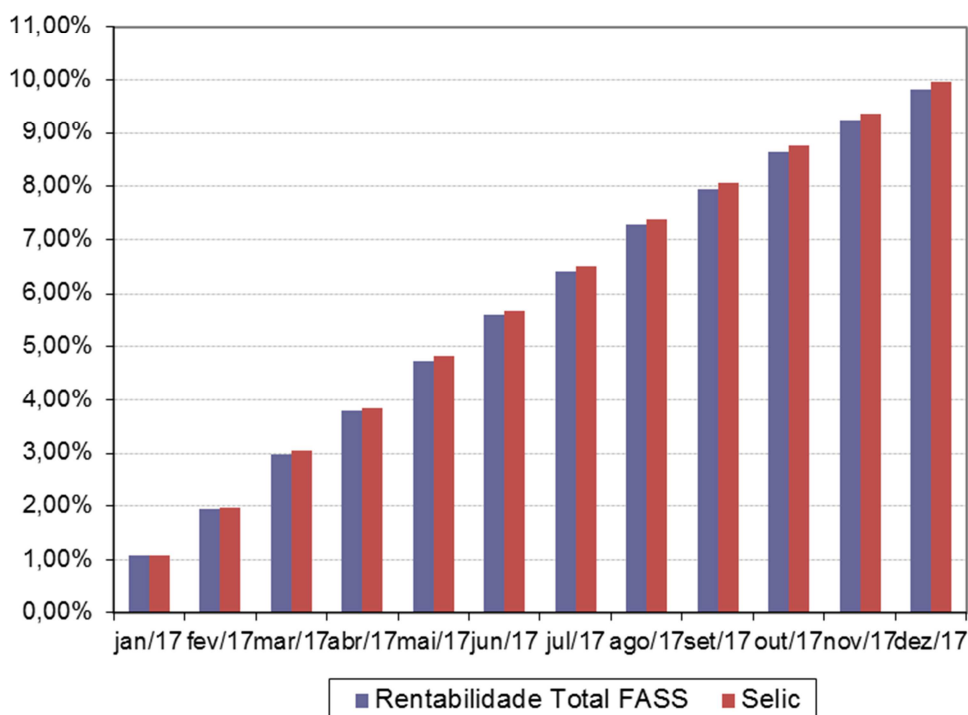
FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	dez/17	Acum. Ano	dez/17	Acum. 2017
FI CAIXA PCRJ RF	0,53%	9,86%	98,47%	98,96%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,47%	9,05%	87,57%	90,79%
Rentabilidade Total FASS	0,53%	9,83%	98,47%	98,60%
Selic	0,54%	9,97%		

OBSERVAÇÕES:

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

Rentabilidade Acumulada - FASS x Selic



CENÁRIO EXTERNO

Segundo os dados divulgados nas últimas semanas, o desempenho econômico global permanece em forte crescimento entre as principais economias.

Nos EUA, o bom desempenho do consumo doméstico impulsiona a atividade econômica. A tramitação no Congresso da reforma fiscal poderá disponibilizar cerca de aproximadamente US\$1,5 trilhão de dólares na economia pela redução de impostos incidentes sobre o consumo e para as empresas.

Na zona do euro, a economia permanece registrando crescimento entre os principais países. A recente divulgação de dados em relação à confiança de consumidores sinaliza que o bom desempenho deverá permanecer para os próximos trimestres.

Dessa forma, permanece o cenário de forte liquidez global, estimulando exposição ao risco e aumentando a procura por ativos de economias emergentes.

CENÁRIO INTERNO

A economia brasileira permanece com evidências de recuperação. Os resultados da economia nos dois primeiros trimestres do ano foram ajustados para cima, indicando que o PIB de 2017 poderá superar as expectativas de mercado que apontam para projeção de 1%.

O consumo das famílias permanece em expansão, indicando que os bons resultados recentes do consumo não estão somente ligados aos estímulos pontuais, mas se fundamentam na melhora do crédito e do mercado de trabalho.

Os resultados fiscais também registraram expansão. Pelo terceiro mês consecutivo a arrecadação tributária cresceu em termos reais.

A sustentabilidade da retomada do crescimento, a que tudo indica, seguirá por meio do consumo das famílias ao longo dos próximos trimestres. Para 2018, o

mercado projeta crescimento do PIB de 3,3%, embora ainda permaneçam riscos importantes no ambiente político.

CARTEIRA FUNPREVI

Os fundos de investimentos que compõem a carteira do FUNPREVI apresentaram, em dezembro, rentabilidades em relação à meta atuarial de 57,64% (Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa), 63,79% (Caixa Brasil Referenciado DI LP) e 69,18% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal e 61,80% 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 66,22% no mês em relação à meta e 100,60% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 108,46% e 99,18% em relação à meta e à taxa Selic, respectivamente.