

Relatório Mensal

2018

Janeiro

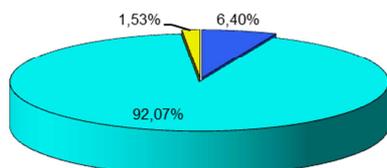
Instituto de Previdência e Assistência do Município do Rio de Janeiro - PREVI-RIO

DIRETORIA DE INVESTIMENTOS

Composição da Carteira

Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

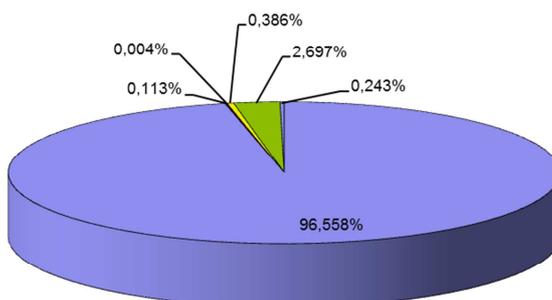
TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)



Valor da Carteira pelo Mercado		
PREVI-RIO	R\$	35.843.451,29
FUNPREVI	R\$	515.592.605,14
FASS	R\$	8.589.905,10

■ 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\$ 582.385,79
FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 19.731,75
Cash Blue FI RF Referenciado DI	R\$ 1.990.688,62
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 13.903.032,32
Ações	R\$ 1.250.766,66

Estoque de Royalties de Petróleo (a vencer)	
Valor Presente (fev/2018 a dez/2059)	R\$ 4.823.054.704,30

Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos	
Saldo (janeiro 2018)	R\$ 468.501.829,02

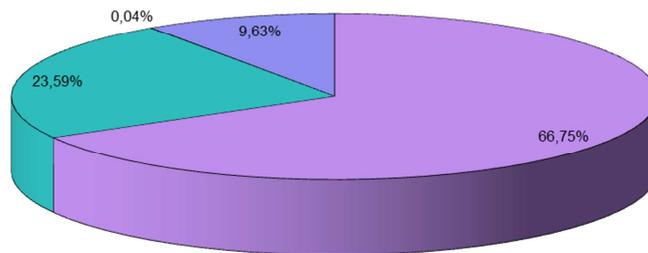
Valor de Aluguel Mensal dos Imóveis	
Janeiro 2018	R\$ 3.736.515,15

Obs: Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos é composto por saldos devedores por empreendimento (R\$ 468.389.464,36) e outros empréstimos concedidos a funcionários (R\$ 112.364,66).

Composição da Carteira

Ativos Mobiliários e Imobiliários

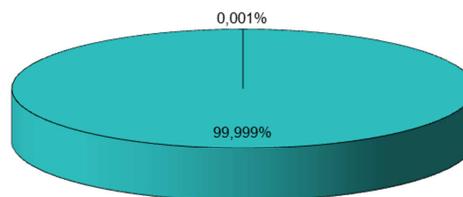
PREVI-RIO



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\$ 8.454.899,55
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	R\$ 14.206,38
BB Previdenciário Renda Fixa Perfil	R\$ 3.450.353,38

FASS



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

Valor da Carteira	
FI CAIXA PCRJ RF	R\$ 8.589.800,94
FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 104,16

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

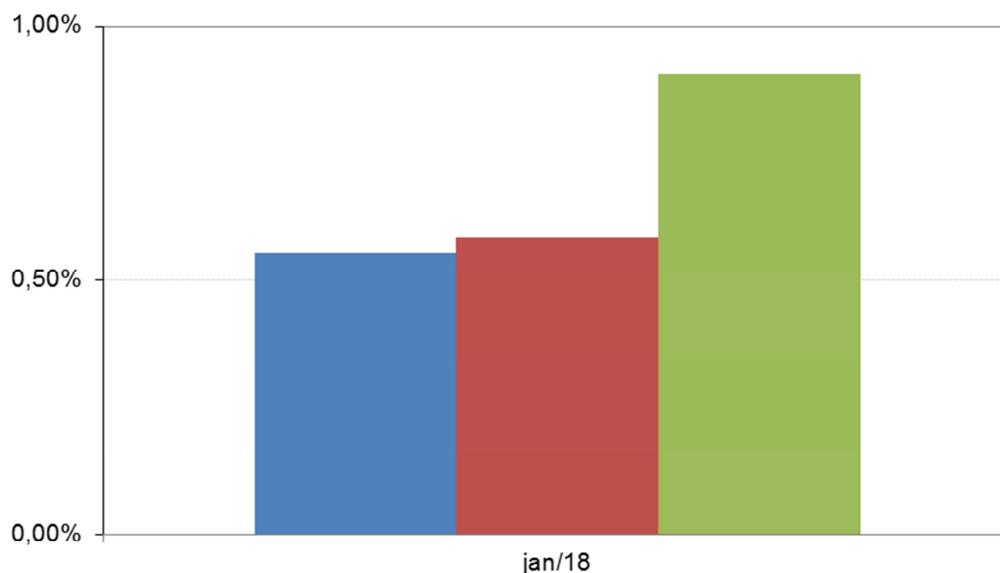
FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	jan/18	Acum. Ano	jan/18	Acum. 2018	jan/18	Acum. 2018
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,57%	0,57%	62,69%	62,69%	97,24%	97,24%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,51%	0,51%	56,28%	56,28%	87,29%	87,29%
Cash Blue Fundo de Investimento RF Referenciado DI	0,55%	0,55%	60,37%	60,37%	93,63%	93,63%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,57%	0,57%	62,89%	62,89%	97,54%	97,54%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Funprevi	0,56%	0,56%	61,38%	61,38%	95,21%	95,21%
Meta Atuarial	0,91%	0,91%				
Selic	0,58%	0,58%				

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

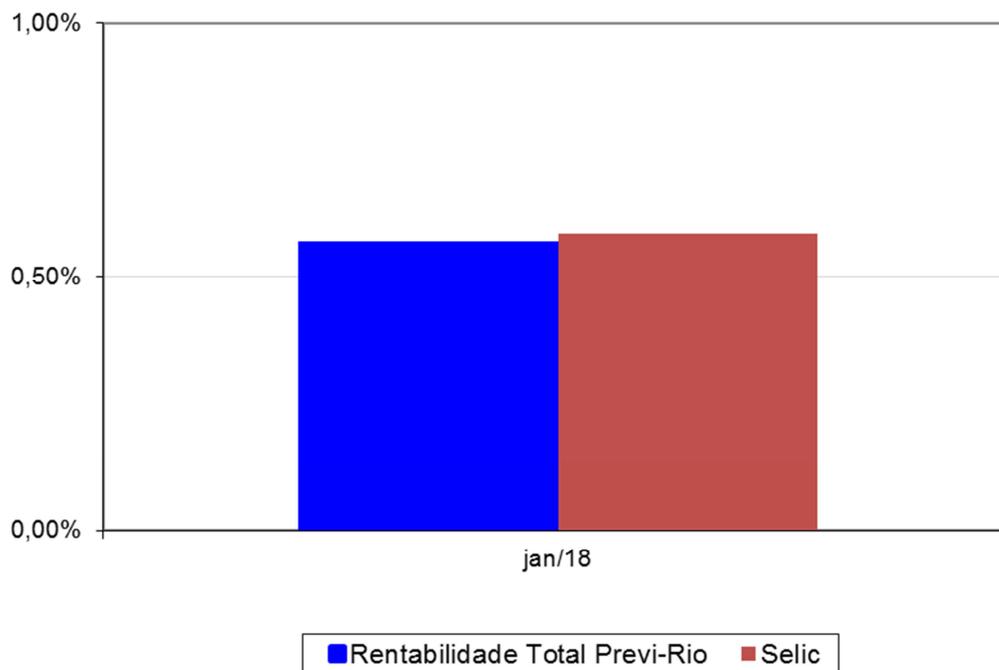
PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	jan/18	Acum. Ano	jan/18	Acum. 2018
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,57%	0,57%	97,24%	97,24%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,51%	0,51%	87,29%	87,29%
BB Previdenciário Renda Fixa Perfil	0,57%	0,57%	97,75%	97,75%
Rentabilidade Total Previ-Rio	0,57%	0,57%	97,24%	97,24%
Selic	0,58%	0,58%		

OBSERVAÇÕES:

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

Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

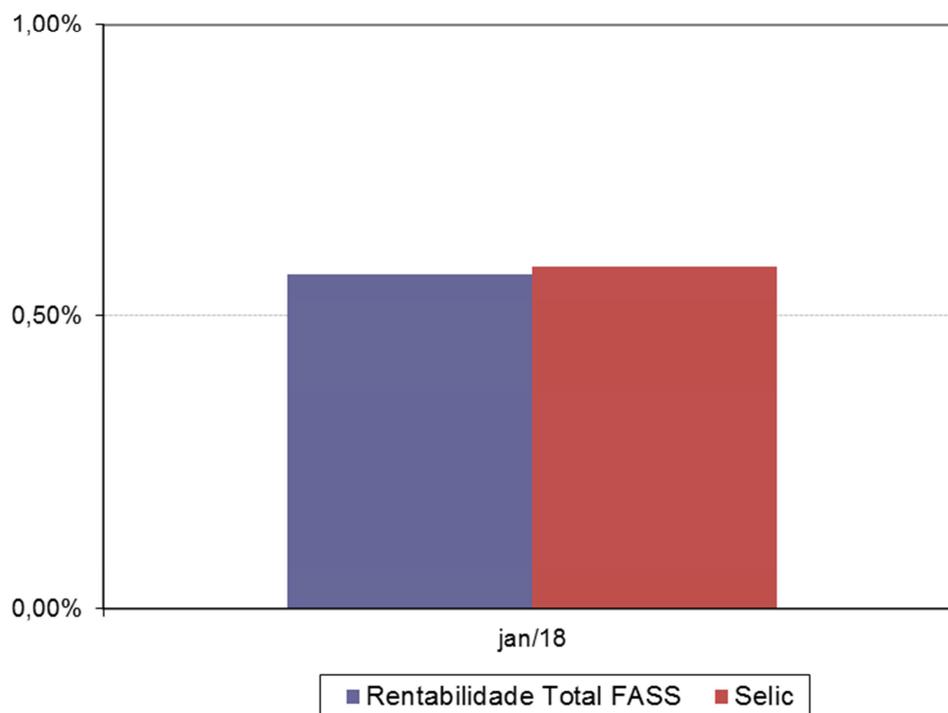
FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	jan/18	Acum. Ano	jan/18	Acum. 2018
FI CAIXA PCRJ RF	0,57%	0,57%	98,05%	98,05%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,51%	0,51%	87,29%	87,29%
Rentabilidade Total FASS	0,57%	0,57%	98,05%	98,05%
Selic	0,58%	0,58%		

OBSERVAÇÕES:

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

Rentabilidade Acumulada - FASS x Selic



CENÁRIO EXTERNO

O cenário externo extremamente favorável e a calma dos últimos meses foram recentemente abalados pelo aumento da volatilidade nos mercados internacionais, causada pela elevação do rendimento dos títulos americanos de longo prazo, e que redefinirá o cenário global de liquidez e taxa de juros. Em outras palavras, a intensificação da economia americana, a implementação da reforma tributária nos Estados Unidos, e o avanço na agenda de desregulamentação do setor financeiro internacional poderá elevar a inflação e, portanto, ajustar as taxas de juros internacionais para patamares mais altos, movimento que poderá reverter a trajetória de queda na taxa básica de juros (Selic) e impactar negativamente no fluxo de capitais, uma vez que, apenas enquanto a inflação global estiver baixa, permanecerá alta a disponibilidade de dinheiro no mercado financeiro internacional.

CENÁRIO INTERNO

No cenário interno, indicadores divulgados referentes ao mês de dezembro/17 reforçaram o cenário de recuperação econômica, que se traduzirá em indicadores melhores. As estatísticas de mercado de trabalho e de produção industrial superaram as previsões, a taxa de desemprego que estava estabilizada em 12,4% recuou para 12,3%, a produção industrial avançou 2,8% na comparação com novembro na série sazonal, 0,5% maior do que a previsão.

No setor público, o déficit fiscal foi de R\$ 124 bilhões, resultado que ficou abaixo da meta de R\$ 159 bilhões. Entretanto, cumprimento da meta fiscal para 2018 de R\$ 159 bilhões de déficit sinaliza ser mais difícil, pois apesar da aceleração do crescimento econômico, permanecem as dificuldades para aprovar e implementar as reformas fiscais que foram propostas em 2017, inalterando a trajetória ascendente da dívida pública.

CARTEIRA FUNPREVI

Os fundos de investimentos que compõem a carteira do FUNPREVI apresentaram, em janeiro, rentabilidades em relação à meta atuarial de 56,28% (Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa), 62,69% (Caixa Brasil Referenciado DI LP) e 62,89% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal e 60,37% 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 61,38% no mês em relação à meta e 95,21% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 61,38% e 95,21% em relação à meta e à taxa Selic, respectivamente.