

Relatório Mensal

2018

Abril

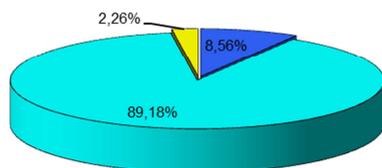
Instituto de Previdência e Assistência do Município do Rio de Janeiro - PREVI-RIO

DIRETORIA DE
INVESTIMENTOS

Composição da Carteira

Ativos Mobiliários, Imobiliários e Recebíveis de Royalties

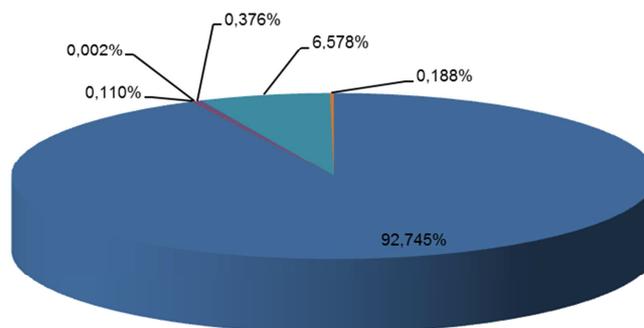
TOTAL GERAL (FUNPREVI, PREVI-RIO, FASS)



Valor da Carteira pelo Mercado	
PREVI-RIO	R\$ 51.521.263,89
FUNPREVI	R\$ 536.789.286,83
FASS	R\$ 13.577.968,44



FUNPREVI



Valor por Tipo de Ativo pelo Mercado	
Imóveis	R\$ 497.846.000,00
FI Caixa Brasil Referenciado DI LP	R\$ 590.965,39
FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$ 13.195,16
Cash Blue FI RF Referenciado DI	R\$ 2.018.869,47
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP RF	R\$ 35.310.267,06
Ações	R\$ 1.009.989,75

Estoque de Royalties de Petróleo (a vencer)	
Valor Presente (mai/2018 a dez/2059)	R\$ 4.637.336.343,27

Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos	
Saldo (abril 2018)	R\$ 455.345.860,33

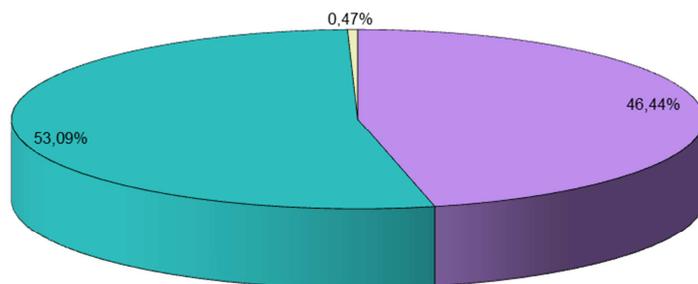
Valor de Aluguel Mensal dos Imóveis	
Abril 2018	R\$ 3.736.515,15

Obs: Recebíveis de Empréstimos e Financiamentos é composto por saldos devedores por empreendimento (R\$ 455.233.495,67) e outros empréstimos concedidos a funcionários (R\$ 112.364,66).

Composição da Carteira

Ativos Mobiliários e Imobiliários

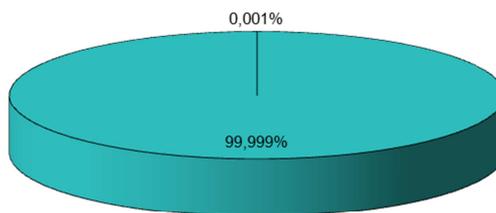
PREVI-RIO



Imóveis	FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	

Valor da Carteira		
Imóveis	R\$	23.923.991,97
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R\$	27.354.608,81
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	R\$	242.663,11

FASS



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

Valor da Carteira		
FI CAIXA PCRJ RF	R\$	13.577.825,32
FI Caixa Brasil Disponibilidades RF	R\$	143,12

Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

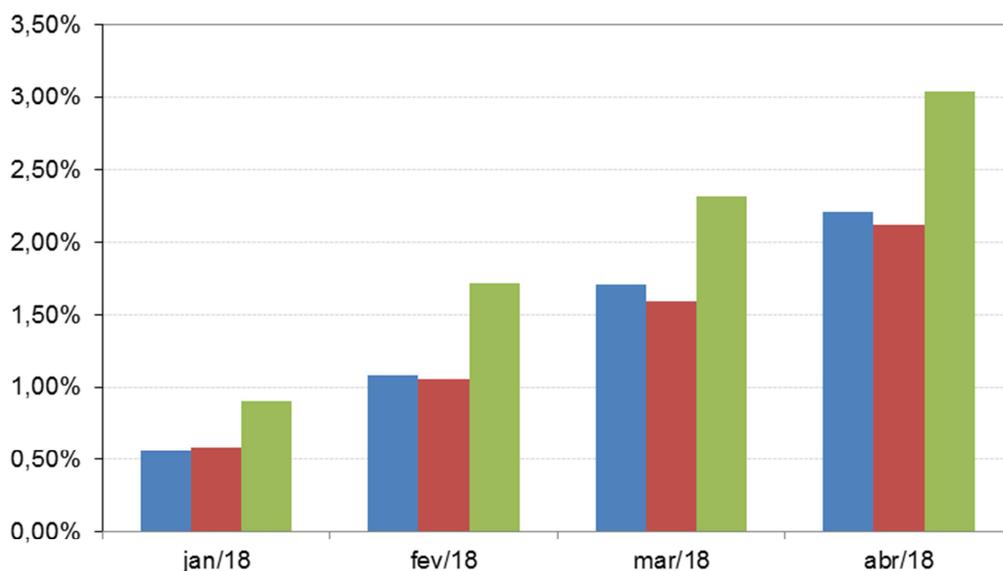
FUNPREVI

ATIVOS FINANCEIROS - FUNPREVI	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Meta		Rentabilidade em relação à Selic	
	abr/18	Acum. Ano	abr/18	Acum. 2018	abr/18	Acum. 2018
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,51%	2,05%	72,69%	67,54%	98,41%	96,73%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,45%	1,84%	63,86%	60,60%	86,45%	86,79%
Cash Blue Fundo de Investimento RF Referenciado DI	0,48%	1,97%	68,52%	64,93%	92,77%	92,99%
FI Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa	0,49%	2,25%	69,53%	74,12%	94,14%	106,16%
Ações	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável	Não aplicável
Rentabilidade Total Funprevi	0,49%	2,21%	69,56%	72,73%	94,18%	104,16%
Meta Atuarial	0,70%	3,03%				
Selic	0,52%	2,12%				

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

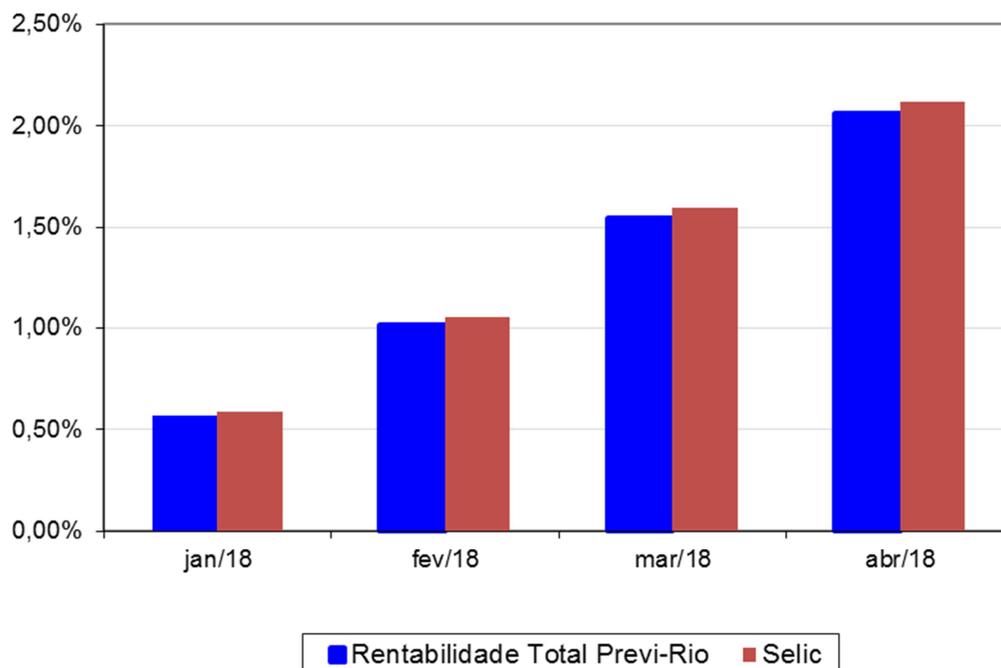
PREVI-RIO

ATIVOS FINANCEIROS - PREVI-RIO	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	abr/18	Acum. Ano	abr/18	Acum. 2018
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	0,51%	2,05%	98,41%	96,73%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,45%	1,84%	86,45%	86,79%
Rentabilidade Total Previ-Rio	0,51%	2,06%	98,38%	97,33%
Selic	0,52%	2,12%		

OBSERVAÇÕES:

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

Rentabilidade Acumulada - PreviRio x Selic



Rentabilidade da Carteira de Ativos Mobiliários

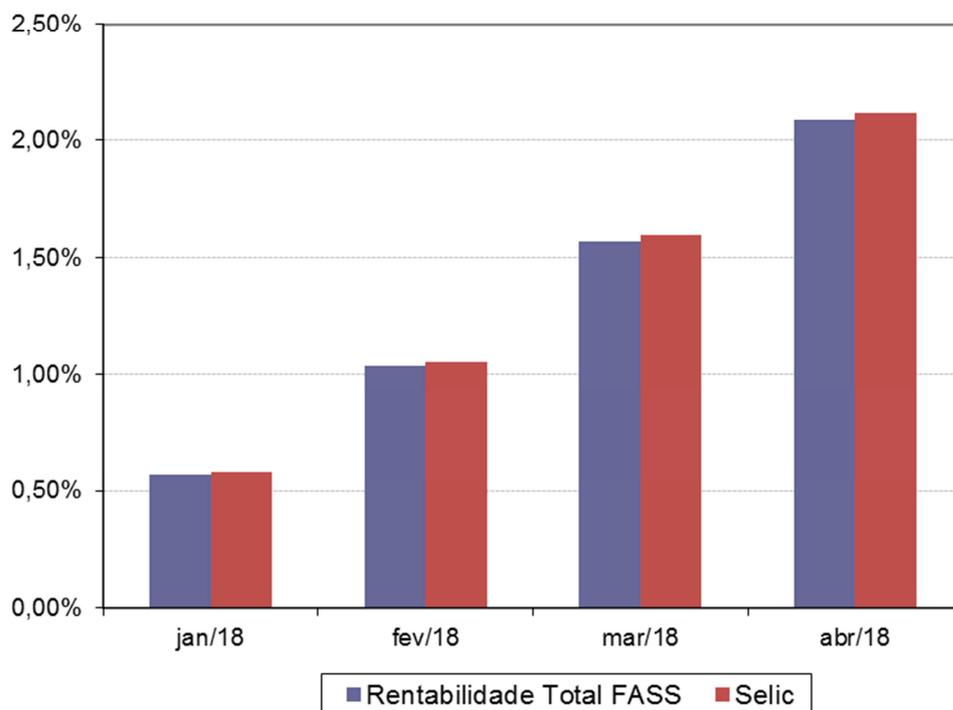
FASS

ATIVOS FINANCEIROS - FASS	Rentabilidade Nominal		Rentabilidade em relação à Selic	
	abr/18	Acum. Ano	abr/18	Acum. 2018
FI CAIXA PCRJ RF	0,51%	2,09%	98,88%	98,53%
FI Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa	0,45%	1,84%	86,45%	86,79%
Rentabilidade Total FASS	0,51%	2,09%	98,88%	98,53%
Selic	0,52%	2,12%		

OBSERVAÇÕES:

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

Rentabilidade Acumulada - FASS x Selic



CENÁRIO EXTERNO

A economia global se manteve favorável ao longo dos últimos trimestres. O cenário de crescimento econômico sem pressão inflacionária permitiu que as políticas de juros nos principais mercados se mantivessem em patamares mais baixos, o que contribuiu para manutenção da liquidez global, beneficiando mercados emergentes. A manutenção do cenário internacional positivo para os próximos trimestres, com crescimento global forte e difundido e redução da volatilidade, dependerá do grau de intensidade da elevação nas taxas de juros das principais economias e da diminuição da tensão em relação às recentes disputas comerciais iniciadas pelo governo de Donald Trump.

CENÁRIO INTERNO

Dados do mercado de trabalho mostram que a recuperação ainda está bastante lenta, a taxa de desemprego permanece estável em 12,4% em março, não confirmando as expectativas de recuo em relação a fevereiro.

Entretanto, o cenário econômico brasileiro permanece positivo com balanço de pagamentos com superávit em transações correntes de US\$ 798 milhões em março e inflação em níveis abaixo da meta, cenário que favorece a permanência da taxa básica no patamar atual pelos próximos meses. Por outro lado, a elevação da incerteza quanto ao quadro eleitoral poderá reduzir ainda mais o ritmo da retomada do crescimento em 2018.

No curto prazo, a situação fiscal sinaliza mais favoravelmente em da razão recuperação da atividade econômica, que permanece com impacto positivo nas receitas do governo. Contudo, o déficit público para o próximo ano permanece como principal desafio para estabilização do crescimento da dívida pública, que dependerá da aprovação da reforma da previdência.

CARTEIRA FUNPREVI

Os fundos de investimentos que compõem a carteira do FUNPREVI apresentaram, em abril, rentabilidades em relação à meta atuarial de 63,86% (Caixa Brasil Disponibilidades Renda Fixa), 72,69% (Caixa Brasil Referenciado DI LP) e 69,53% (Caixa Brasil IRFM-1 TP Renda Fixa), todos da Caixa Econômica Federal e 68,52% 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 69,56% no mês em relação à meta e 94,18% em relação à taxa Selic. No ano, o desempenho acumulado da carteira foi de 72,73% e 104,16% em relação à meta e à taxa Selic, respectivamente.