

# FUNDO DE PREVIDENCIA SOCIAL DO MUNICIPIO DE CORONEL JOAO PESSOA

## Relatório de Investimentos CORONEL PREV

Dezembro / 2017

Relatório mensal da carteira de ativos contemplando as rentabilidades auferidas pelo CORONEL PREV, mediante aplicações nos bancos e instituições financeiras autorizadas na legislação vigente e na política de investimentos do RPPS.



## Sumário

|                                                            |    |
|------------------------------------------------------------|----|
| 1. CENÁRIO ECONÔMICO .....                                 | 2  |
| 1.1 Destaques do mês .....                                 | 2  |
| 1.2 Cenário Brasileiro .....                               | 2  |
| 1.3 Cenário Internacional .....                            | 2  |
| 1.4 Bolsa .....                                            | 3  |
| 1.5 Projeções .....                                        | 3  |
| 1.6 Indicadores Financeiros .....                          | 4  |
| 2. ANÁLISE DA CARTEIRA .....                               | 5  |
| 2.1 Composição da Carteira .....                           | 5  |
| 2.2 Investimentos por Segmento .....                       | 5  |
| 2.3 Investimentos por Instituição .....                    | 5  |
| 2.4 Carteira x Meta Atuarial .....                         | 6  |
| 2.5 Evolução do Patrimônio .....                           | 6  |
| 2.6 Análise Comparativa de Fundos .....                    | 6  |
| 3. ENQUADRAMENTO .....                                     | 8  |
| 3.1 Enquadramento na Resolução Atual .....                 | 8  |
| 3.2 Enquadramento na Política de Investimentos Atual ..... | 8  |
| 4. RANKINGS .....                                          | 10 |
| Renda Fixa .....                                           | 10 |
| Art. 7º I, "b" .....                                       | 10 |
| Art. 7º III .....                                          | 10 |
| Art. 7º IV .....                                           | 11 |
| Art. 7º VI .....                                           | 11 |
| Art. 7º VII, "a" .....                                     | 12 |
| Art. 7º VII, "b" .....                                     | 12 |
| Renda Variável .....                                       | 13 |
| Art. 8º I .....                                            | 13 |
| Art. 8º II .....                                           | 13 |
| Art. 8º III .....                                          | 13 |
| Art. 8º IV .....                                           | 14 |
| Art. 8º V .....                                            | 14 |
| Art. 8º VI .....                                           | 15 |
| 5. CONSIDERAÇÕES FINAIS .....                              | 16 |
| Confirmação de Recebimento de Relatório .....              | 17 |

## 1. CENÁRIO ECONÔMICO

### 1.1 Destaques do mês

#### IPCA sobe 0,44% em dezembro e fecha 2017 em 2,95%

O Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo - IPCA de dezembro foi de 0,44%, ficando 0,16 ponto percentual acima do resultado de novembro (0,28%). Essa foi a maior variação mensal de 2017. Em 2016, o IPCA do mês atingiu 0,30%. Assim, o IPCA acumulado em 2017 foi 2,95% e ficou 3,34 p.p. abaixo dos 6,29% registrados em 2016. Esse acumulado foi o menor desde 1998 (1,65%).

#### INPC sobe 0,26% em dezembro e fecha 2017 em 2,07%

O Índice Nacional de Preços ao Consumidor - INPC apresentou variação de 0,26% em dezembro e ficou 0,08 p.p. acima da taxa de novembro (0,18%). Com este resultado, o acumulado em 2017 foi para 2,07%, bem menor do que os 6,58% registrados em 2016 e a menor taxa acumulada no ano desde a implantação do Plano Real. Em dezembro de 2016, o INPC registrou 0,14%.

### 1.2 Cenário Brasileiro

#### Fim da recessão e queda de juros e da inflação assinalam economia em 2017

Em um ano marcado pelo fim da recessão, a economia brasileira ainda registrou reflexos da crise, com sucessivos cortes de gastos, interrupção de serviços públicos por falta de recursos, aumento de tributos e situação crítica nas contas públicas de alguns estados. Com o início da retomada a partir do segundo semestre, a inflação e a taxa básica de juros registraram quedas sucessivas, e a criação de emprego chegou a registrar sete altas consecutivas.

### 1.3 Cenário Internacional

#### Venezuelana PDVSA faz acordo com a russa Rosneft, auxiliando economia da Venezuela.

No sábado passado, dia 16 de dezembro, a empresa estatal venezuelana Petroleos de Venezuela S.A. (PDVSA) assinou um acordo com a corporação semiestatal russa, a petrolífera Rosneft, para que esta atue em dois campos de gás, o de Patao e Mejillones, podendo usar a produção também para exportação, na forma de gás natural liquefeito. Segundo foi divulgado, a validade será por 30 anos e as reservas são calculadas em 180 bilhões de metros cúbicos (bmc), com uma possível produção anual de 6,5 bmc.

## FMI alerta para instabilidade financeira na China

No dia 6 de dezembro de 2017, o Comitê Executivo do Fundo Monetário Internacional (FMI) publicou comunicado oficial alertando para o risco de crescente instabilidade no sistema financeiro chinês. De acordo com a publicação “a crescente complexidade do sistema financeiro da China semeou riscos para a estabilidade financeira do país”. Nesse sentido, o FMI recomenda que as autoridades chinesas “priorizem claramente a estabilidade financeira ao invés dos objetivos de desenvolvimento”.

### 1.4 Bolsa

## Bovespa sobe no último pregão do ano e acumula alta de 26,8% em 2017

O Índice Bovespa terminou o mês e o ano com 76.402 pontos, apenas 0,76% abaixo do recorde nominal registrado em 13 de outubro, quando chegou aos 76.989 pontos. No mês, o Ibovespa apresentou alta de +6,16%, o que levou a um acumulado de 26,86% no ano e de 75,02% em 24 meses.

O IBOVESPA fechou o último pregão do ano com ganho de 0,43%, a 76.402 pontos, perto da máxima histórica registrada em outubro.

No ano, o índice acumulou alta de 26,8% em 2017.

### 1.5 Projeções

## Mercado financeiro aumenta previsão de crescimento do PIB em 2018, divulga BC.

Analistas do mercado financeiro aumentaram para 2,70% a previsão de crescimento da economia em 2018. A nova previsão está no relatório Focus.

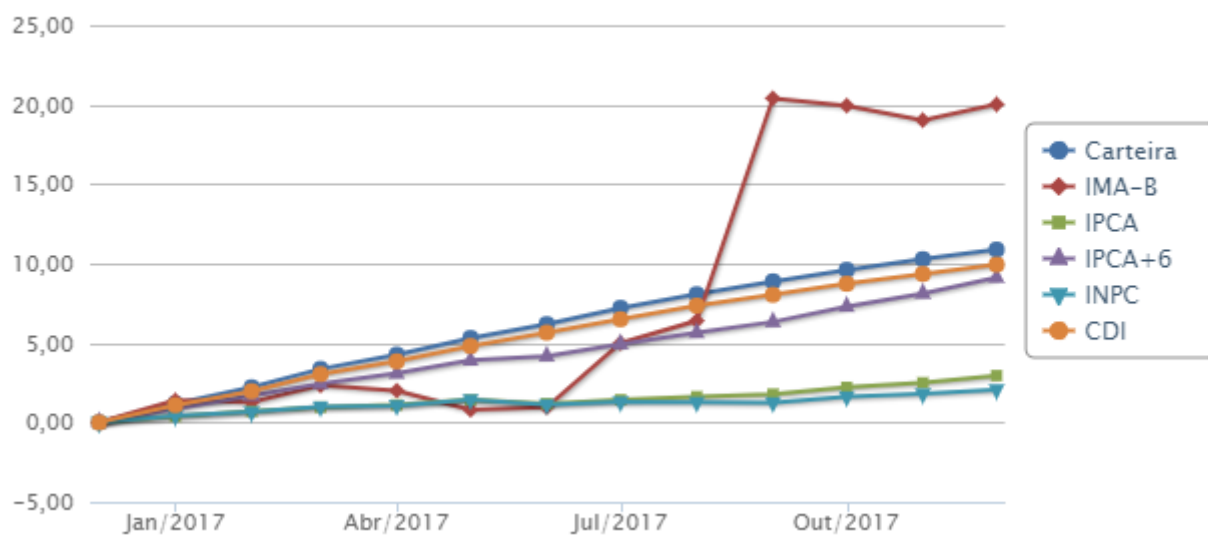
No último relatório, a previsão dos economistas ouvidos pelo Banco Central era um crescimento de 2,69% para o PIB deste ano. Para 2019, a previsão de crescimento do PIB ficou estável em 2,8%.

Já a previsão de inflação de 2018 e 2019 ficaram estáveis em 3,95% e em 4,25%, respectivamente, mantendo o índice dentro da meta fixada pelo governo. Em 2017, a inflação ficou em 2,95%, abaixo do piso da meta, o que obrigou o presidente do Banco Central a escrever uma carta pública ao ministro da Fazenda explicando as razões para a variação fora da previsão.

## Juros

O mercado estima que, no fim de 2018, a taxa básica de juros do Brasil, a Selic, esteja em 6,75%. Atualmente a Selic está em 7%. A previsão é a mesma do último relatório. Já para 2019, o mercado reduziu a previsão da Selic de 8,13% para 8%.

## 1.6 Indicadores Financeiros



## 2. ANÁLISE DA CARTEIRA

### 2.1 Composição da Carteira

| Fundo de Investimento                                            | Saldo em 30/11/2017 | Saldo em 29/12/2017 | Rentabilidade |
|------------------------------------------------------------------|---------------------|---------------------|---------------|
| CAIXA FI BRASIL DI LONGO PRAZO                                   | R\$84.752,00        | R\$55.138,00        | 0,52%         |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTA | R\$110.221,00       | R\$84.808,00        | 0,45%         |
| CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF                                    | R\$178.088,00       | R\$145.762,00       | 0,57%         |
| BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS FIC        | R\$283.768,00       | R\$241.051,00       | 0,56%         |
|                                                                  | R\$656.829,00       | R\$526.759,00       |               |

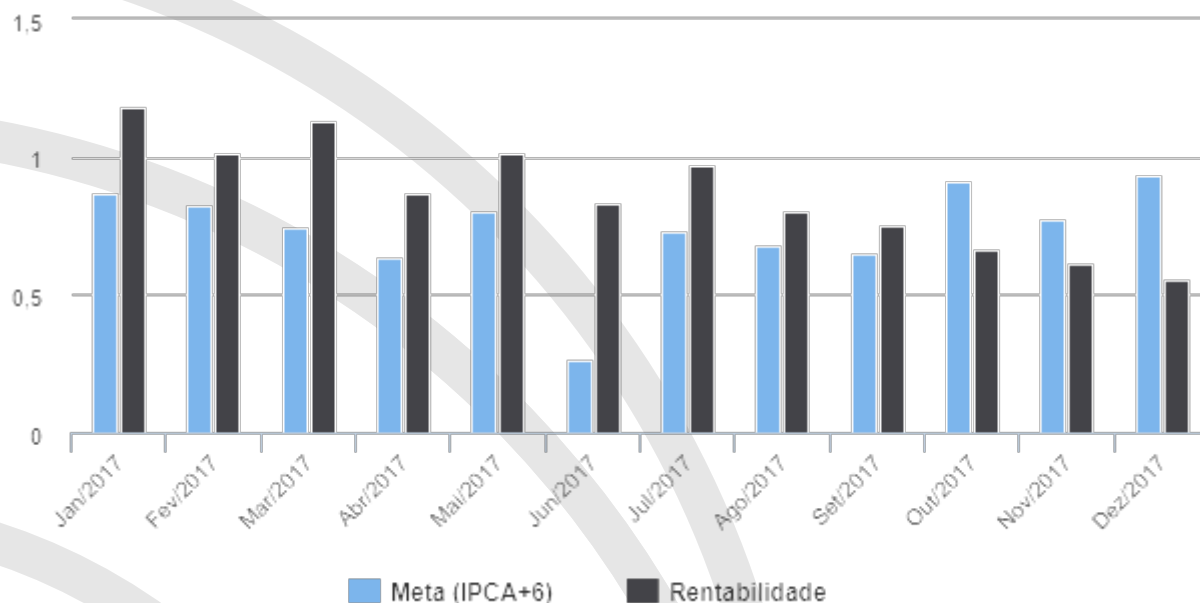
### 2.2 Investimentos por Segmento

| Segmento                | Saldo em 30/11/2017 | Saldo em 29/12/2017 | Rentabilidade |
|-------------------------|---------------------|---------------------|---------------|
| Renda Fixa              | R\$572.075,78       | R\$471.620,69       | 0,55%         |
| Renda Fixa Referenciado | R\$84.751,80        | R\$55.137,82        | 0,52%         |
|                         | R\$656.827,58       | R\$526.758,51       |               |

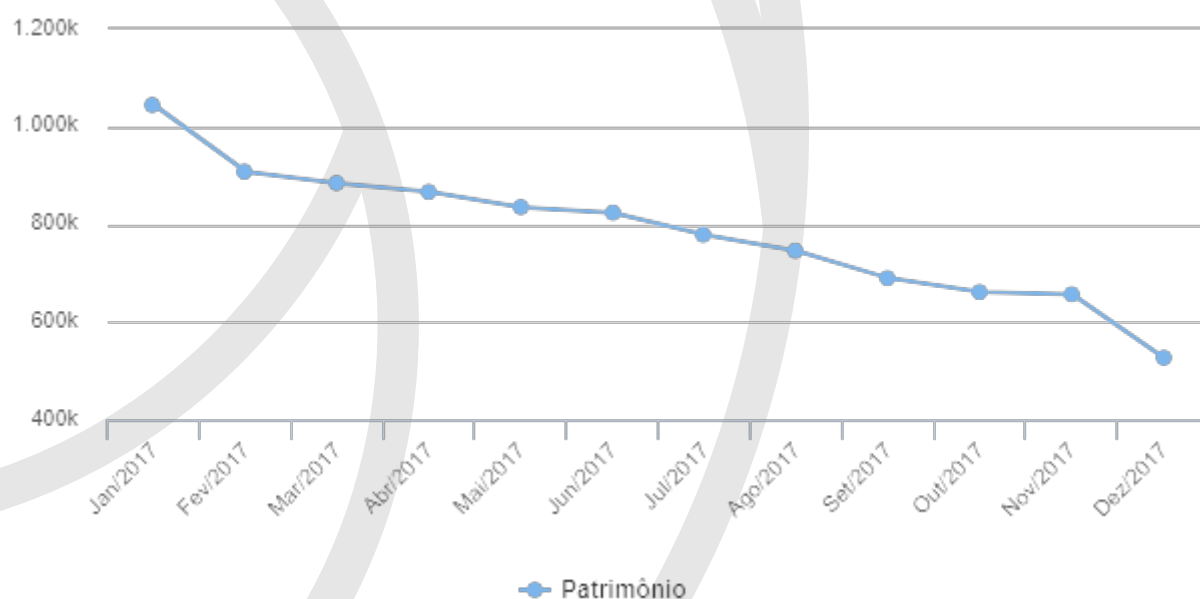
### 2.3 Investimentos por Instituição

| Instituição Financeira  | Saldo em 30/11/2017 | Saldo em 29/12/2017 | Rentabilidade |
|-------------------------|---------------------|---------------------|---------------|
| Banco do Brasil S.A.    | R\$393.988,25       | R\$325.859,00       | 0,54%         |
| Caixa Econômica Federal | R\$262.839,34       | R\$200.899,51       | 0,58%         |
|                         | R\$656.827,58       | R\$526.758,51       |               |

## 2.4 Carteira x Meta Atuarial



## 2.5 Evolução do Patrimônio



## 2.6 Análise Comparativa de Fundos

| Fundo de Investimento                                            | Mês   | Ano    | 6 meses | 12 meses | PL Médio 12 meses    | Início     | Tx Adm | Tx Perf | Aplic Mín   |
|------------------------------------------------------------------|-------|--------|---------|----------|----------------------|------------|--------|---------|-------------|
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTA | 0,45% | 8,87%  | 3,55%   | 8,92%    | R\$1.328.779.358,47  | 28/04/2011 | 1,00%  | 0,00%   | R\$1.000,00 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC        | 0,56% | 10,86% | 4,55%   | 10,91%   | R\$10.416.649.393,93 | 08/12/2009 | 0,10%  | 0,00%   | R\$1,00     |
| CAIXA FI BRASIL DI LONGO PRAZO                                   | 0,52% | 9,94%  | 4,05%   | 10,00%   | R\$5.976.919.933,46  | 05/07/2006 | 0,20%  | 0,00%   | R\$1.000,00 |

| Fundo de Investimento         | Mês   | Ano    | 6 meses | 12 meses | PL Médio 12 meses    | Início     | Tx Adm | Tx Perf | Aplic Mín   |
|-------------------------------|-------|--------|---------|----------|----------------------|------------|--------|---------|-------------|
| CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF | 0,57% | 10,93% | 4,56%   | 10,99%   | R\$13.616.106.385,04 | 28/05/2010 | 0,20%  | 0,00%   | R\$1.000,00 |



### 3. ENQUADRAMENTO

#### 3.1 Enquadramento na Resolução Atual

| Artigo/Fundo                                                                                               | Percent. Autorizado | Percent. Alocado | Total         |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------|------------------|---------------|
| Art. 7º - Inciso I, alínea b - até 100% em Títulos Publ - Ref                                              | 100,00%             | 73,43%           | R\$386.812,79 |
| - BB PREVIDENCIARIO RF IRF-M 1 TP                                                                          | 100,00%             | 45,76%           | R\$241.051,10 |
| - CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF                                                                            | 100,00%             | 27,67%           | R\$145.761,69 |
| Art. 7º - Inciso IV - até 30% em Renda Fixa                                                                | 30,00%              | 26,57%           | R\$139.945,73 |
| - BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA FLU                                                                         | 20,00%              | 16,10%           | R\$84.807,90  |
| - CAIXA FI BRASIL DI LP                                                                                    | 20,00%              | 10,47%           | R\$55.137,82  |
| Art. 7º § 5º A totalidade das aplicações previstas nos incisos VI e VII não deverá exceder o limite de 15% | 15,00%              | 0,00%            |               |
|                                                                                                            |                     |                  | R\$526.758,52 |

#### 3.2 Enquadramento na Política de Investimentos Atual

| Artigo/Fundo                                                       | Mínimo | Máximo  | Alocado |
|--------------------------------------------------------------------|--------|---------|---------|
| Art. 7º - Inciso I, alínea a - até 100% Títulos Publ. Fed.         | 0,00%  | 100,00% | 0,00%   |
| Art. 7º - Inciso I, alínea b - até 100% em Títulos Publ - Ref      | 0,00%  | 100,00% | 73,43%  |
| - BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS FIC        | 0,00%  | 100,00% | 45,76%  |
| - CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF                                    | 0,00%  | 100,00% | 27,67%  |
| Art. 7º - Inciso II - até 15% de Operações Compromissadas          | 0,00%  | 15,00%  | 0,00%   |
| Art. 7º - Inciso III - até 80% em Ind. IMA ou IDKA                 | 0,00%  | 80,00%  | 0,00%   |
| Art. 7º - Inciso IV - até 30% em Renda Fixa                        | 0,00%  | 30,00%  | 26,57%  |
| - CAIXA FI BRASIL DI LONGO PRAZO                                   | 0,00%  | 30,00%  | 10,47%  |
| - BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTA | 0,00%  | 30,00%  | 16,10%  |
| Art. 7º - Inciso V - até 20% em poupança                           | 0,00%  | 20,00%  | 0,00%   |
| Art. 7º - Inciso VI - até 15% FIDC, cond. Aberto                   | 0,00%  | 15,00%  | 0,00%   |
| Art. 7º - Inciso VII, alínea a - até 5% (FIDC Cond. Fechado)       | 0,00%  | 5,00%   | 0,00%   |
| Art. 7º - Inciso VII, alínea b - até 5% (Créd. Privado)            | 0,00%  | 5,00%   | 0,00%   |
| Art. 8º - Inciso I - até 30% FI em Ações, ind. IBOVESPA, IBrX      | 0,00%  | 30,00%  | 0,00%   |
| Art. 8º - Inciso II - até 20% em F Ind. referenciado em Ações      | 0,00%  | 20,00%  | 0,00%   |

| Artigo/Fundo                                                | Mínimo | Máximo | Alocado |
|-------------------------------------------------------------|--------|--------|---------|
| Art. 8º - Inciso III - até 15% em cotas FI em Ações         | 0,00%  | 15,00% | 0,00%   |
| Art. 8º - Inciso IV - até 5% em Multimercado, cond. Aberto  | 0,00%  | 5,00%  | 0,00%   |
| Art. 8º - Inciso V - até 5% em cotas de FI em participações | 0,00%  | 5,00%  | 0,00%   |
| Art. 8º - Inciso VI - até 5% Fundo de Inv. Imobiliário      | 0,00%  | 5,00%  | 0,00%   |

## 4. RANKINGS

### Renda Fixa

#### Art. 7º I, "b"

|    | Fundo de Investimento                                            | Mês   | Ano    | 6 meses | 12 meses | 24 meses |
|----|------------------------------------------------------------------|-------|--------|---------|----------|----------|
| 1  | CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO    | 1,38% | 16,15% | 7,04%   | 16,20%   | 50,44%   |
| 2  | BANRISUL FOCO IRF-M FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO | 1,24% | 14,39% | 6,35%   | 14,44%   | 40,31%   |
| 3  | BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INV | 1,22% | 14,91% | 6,54%   | 14,96%   | 41,61%   |
| 4  | ITAU INSTITUCION RF PRE FIXADO LP FICFI                          | 1,22% | 14,70% | 6,42%   | 14,75%   | 40,91%   |
| 5  | CAIXA FI BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RF LP                     | 1,19% | 14,80% | 6,40%   | 14,86%   | 41,54%   |
| 6  | WESTERN ASSET IMA B5 ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA      | 1,17% | 14,12% | 7,35%   | 14,41%   | 35,09%   |
| 7  | FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS REND | 1,05% | 7,41%  | 4,21%   | 7,45%    | 19,69%   |
| 8  | FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS RENDA | 1,05% | 10,33% | 6,94%   | 13,09%   | 20,26%   |
| 9  | FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 III TÍTULOS PÚBLICOS REN | 1,05% | 7,52%  | 4,22%   | 7,56%    | 20,38%   |
| 10 | FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS REND | 1,05% | 7,54%  | 4,22%   | 7,58%    | 20,39%   |
| 47 | CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF                                    | 0,57% | 10,93% | 4,56%   | 10,99%   | 27,23%   |
| 48 | BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS FIC        | 0,56% | 10,86% | 4,55%   | 10,91%   | 27,04%   |

#### Art. 7º III

|   | Fundo de Investimento                                            | Mês   | Ano    | 6 meses | 12 meses | 24 meses |
|---|------------------------------------------------------------------|-------|--------|---------|----------|----------|
| 1 | BRA1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA                            | 1,71% | -0,19% | 12,66%  | -0,16%   | 0,56%    |
| 2 | LMX IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA                       | 1,25% | 12,83% | 7,00%   | 12,86%   | 32,18%   |
| 3 | GGR INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B 5       | 1,22% | 13,73% | 6,53%   | 13,77%   | 30,76%   |
| 4 | FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IPIRANGA                        | 1,08% | 0,54%  | -0,13%  | 1,76%    | 21,59%   |
| 5 | BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FI | 0,91% | 13,27% | 5,89%   | 13,32%   | 36,28%   |
| 6 | BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA  | 0,90% | 12,95% | 5,91%   | 13,00%   | 35,93%   |
| 7 | BRABESCO FI RENDA FIXA IMA GERAL                                 | 0,89% | 13,07% | 6,14%   | 13,12%   | 37,40%   |
| 8 | SAFRA IMA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA                       | 0,88% | 12,87% | 7,61%   | 12,91%   | 38,90%   |
| 9 | BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVEST | 0,87% | 12,42% | 6,84%   | 12,46%   | 29,72%   |

|    | Fundo de Investimento                             | Mês   | Ano    | 6 meses | 12 meses | 24 meses |
|----|---------------------------------------------------|-------|--------|---------|----------|----------|
| 10 | BRANCO INSTITUCIONAL FIC DE FI RENDA FIXA IMA-B 5 | 0,87% | 12,66% | 6,96%   | 12,70%   | 30,05%   |

## Art. 7º IV

|    | Fundo de Investimento                                            | Mês   | Ano    | 6 meses | 12 meses | 24 meses |
|----|------------------------------------------------------------------|-------|--------|---------|----------|----------|
| 1  | BRANCO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IDKA PRE 2               | 1,36% | 15,82% | 7,21%   | 15,86%   |          |
| 2  | UNIBANCO RENDA FIXA LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO            | 1,16% | 14,07% | 6,10%   | 14,12%   | 39,32%   |
| 3  | BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI          | 1,05% | 13,94% | 7,93%   | 13,98%   | 37,71%   |
| 4  | BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INV  | 0,98% | 13,56% | 7,59%   | 13,60%   | 38,67%   |
| 5  | BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI               | 0,90% | 12,26% | 5,87%   | 12,31%   |          |
| 6  | MULTINVEST INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IRF-M1 | 0,89% | 12,16% | 6,73%   | 12,21%   | 26,82%   |
| 7  | BTG PACTUAL IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA                | 0,86% | 12,29% | 6,78%   | 12,33%   | 29,71%   |
| 8  | ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI                    | 0,80% | 12,87% | 6,46%   | 12,92%   | 37,23%   |
| 9  | FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RENDA FIXA             | 0,80% | 11,22% | 5,66%   | 11,26%   |          |
| 10 | BANRISUL PREVIDENCIA IPCA 2024 FI RF LP                          | 0,72% | 3,20%  | 1,50%   | 8,85%    | 10,48%   |
| 39 | CAIXA FI BRASIL DI LONGO PRAZO                                   | 0,52% | 9,94%  | 4,05%   | 10,00%   | 25,46%   |
| 64 | BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTA | 0,45% | 8,87%  | 3,55%   | 8,92%    | 23,26%   |

## Art. 7º VI

|   | Fundo de Investimento                                             | Mês     | Ano     | 6 meses | 12 meses | 24 meses |
|---|-------------------------------------------------------------------|---------|---------|---------|----------|----------|
| 1 | BANRISUL PREVIDENCIA IPCA 2030 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA   | 0,73%   | 3,14%   | 1,47%   | 3,18%    | 10,48%   |
| 2 | FIDC DA INDÚSTRIA EXODUS INSTITUCIONAL - SENIOR                   | 0,65%   | 12,06%  |         |          |          |
| 3 | LME REC MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS C | 0,59%   | -93,98% |         |          | -98,37%  |
| 4 | BBIF MASTER FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS LP      | -0,35%  | -83,35% |         |          | -85,85%  |
| 5 | FIDC INCENTIVO MULTISSETORIAL II                                  | -10,50% | -72,89% |         |          | -72,42%  |
| 6 | QT IPCA FIDC JUROS REAL                                           |         |         |         |          |          |
| 7 | ILLUMINATI FIDC                                                   |         |         |         |          |          |
| 8 | MAXPREV FIQ FIDC MULTISSETORIAL                                   |         |         |         |          |          |

|    | Fundo de Investimento                                          | Mês | Ano | 6 meses | 12 meses | 24 meses |
|----|----------------------------------------------------------------|-----|-----|---------|----------|----------|
| 9  | GFM FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTICRÉDITO |     |     |         |          |          |
| 10 | BCSUL VERAX CPP 360 FIDC SENIOR                                |     |     |         |          |          |

## Art. 7º VII, "a"

|    | Fundo de Investimento                                          | Mês    | Ano      | 6 meses | 12 meses | 24 meses |
|----|----------------------------------------------------------------|--------|----------|---------|----------|----------|
| 1  | FIDC MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA - SENIOR                        | 43,04% | 60,54%   |         |          | -70,29%  |
| 2  | RURAL PREMIUM FIDC SÊNIOR                                      | 1,38%  | -2,57%   |         |          | -17,73%  |
| 3  | FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS CASAN SANEAMENTO | 1,17%  | 8,48%    |         |          | -7,33%   |
| 4  | INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC - Série B                    | 0,00%  |          |         |          |          |
| 5  | INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC - Série A                    | 0,00%  | -100,00% |         |          | -100,00% |
| 6  | SUL INVEST FIDC - MULTISSETORIAL                               |        |          |         |          |          |
| 7  | FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR                       |        |          |         |          |          |
| 8  | FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL 3SEN         |        |          |         |          |          |
| 9  | RED FDO DE INVEST EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSETORIAL LP    |        |          |         |          |          |
| 10 | FIDC DA COMPANHIA ESTADUAL DE ÁGUAS E ESGOTOS - CEDAE          |        |          |         |          |          |

## Art. 7º VII, "b"

|   | Fundo de Investimento                                            | Mês   | Ano    | 6 meses | 12 meses | 24 meses |
|---|------------------------------------------------------------------|-------|--------|---------|----------|----------|
| 1 | BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FUNDO DE INVESTIM  | 1,02% | 14,91% | 7,55%   | 14,96%   | 37,98%   |
| 2 | BTG PACTUAL YIELD DI FI RENDA FIXA REFERENCIADO CRÉDITO PRIVADO  | 0,57% | 10,29% | 4,17%   | 10,34%   | 26,17%   |
| 3 | SANTANDER FI MASTER RENDA FIXA CREDITO PRIVADO LONGO PRAZO       | 0,55% | 10,39% | 4,27%   | 10,45%   | 26,16%   |
| 4 | SAFRA CAPITAL MARKET PREMIUM DI CREDITO PRIVADO FIC FI REFERENCI | 0,54% | 10,19% | 4,17%   | 10,25%   | 26,15%   |
| 5 | SAFRA CAPITAL MARKET - FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CRÉDITO  | 0,53% | 10,00% | 4,07%   | 10,05%   | 25,71%   |
| 6 | SAFRA CAPITAL MARKET INSTITUCIONAL DI FUNDO DE INVESTIMENTO EM C | 0,51% | 9,81%  | 3,99%   | 9,87%    | 25,28%   |
| 7 | FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA XVI RENDA FIXA CRÉDITO P | 0,41% | 9,42%  | 4,03%   | 9,46%    | -23,53%  |
| 8 | URCA FI RENDA FIXA CREDITO PRIVADO PREVIDENCIARIO                | 0,35% | 14,45% | 7,98%   | 14,49%   | 27,67%   |
| 9 | SECURITY FI REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP                   | 0,26% | 4,53%  | 1,96%   | 4,56%    | -21,56%  |

|    | Fundo de Investimento                                            | Mês   | Ano    | 6 meses | 12 meses | 24 meses |
|----|------------------------------------------------------------------|-------|--------|---------|----------|----------|
| 10 | INCENTIVO FUNDO DE INVESTIMENTO REFERENCIADO CDI CRÉDITO PRIVADO | 0,02% | 60,17% | 39,46%  | 60,21%   | -95,44%  |

## Renda Variável

### Art. 8º I

|    | Fundo de Investimento                                            | Mês   | Ano    | 6 meses | 12 meses | 24 meses |
|----|------------------------------------------------------------------|-------|--------|---------|----------|----------|
| 1  | CAIXA FI AÇÕES BRASIL IBX - 50                                   | 6,27% | 27,04% | 24,24%  | 27,04%   | 54,54%   |
| 2  | FI EM AÇÕES CAIXA BRASIL IBOVESPA                                | 6,23% | 25,87% | 22,19%  | 25,87%   | 76,19%   |
| 3  | BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS                                       | 6,22% | 26,37% | 22,21%  | 26,37%   | 74,70%   |
| 4  | BB AÇÕES IBRX INDEXADO FICFI                                     | 6,22% | 24,45% | 20,80%  | 24,44%   | 65,10%   |
| 5  | BB AÇÕES IBOVESPA INDEXADO FICFI                                 | 6,04% | 23,86% | 21,26%  | 23,85%   | 66,91%   |
| 6  | BRADESCO H FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES IBOVESPA               | 6,02% | 23,62% | 20,93%  | 23,63%   | 66,45%   |
| 7  | BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES INSTITUCIONAL IBRX ATIVO | 5,97% | 27,75% | 23,81%  | 27,75%   | 67,25%   |
| 8  | BNP PARIBAS ACE IBRX FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDO DE  | 5,96% | 23,29% | 19,07%  | 23,29%   | 66,50%   |
| 9  | FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES CAIXA IBOVESPA ATIVO              | 5,95% | 23,57% | 22,55%  | 23,56%   | 49,05%   |
| 10 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA IBOVESPA                    | 5,88% | 21,68% | 20,03%  | 21,66%   | 62,26%   |

### Art. 8º II

|   | Fundo de Investimento                                    | Mês   | Ano    | 6 meses | 12 meses | 24 meses |
|---|----------------------------------------------------------|-------|--------|---------|----------|----------|
| 1 | ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVA11                | 6,45% | 26,54% | 22,64%  | 27,48%   | 74,23%   |
| 2 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA | 6,19% | 25,83% | 22,01%  | 25,82%   | 76,47%   |

### Art. 8º III

|   | Fundo de Investimento                                  | Mês    | Ano    | 6 meses | 12 meses | 24 meses |
|---|--------------------------------------------------------|--------|--------|---------|----------|----------|
| 1 | CAIXA FI AÇÕES VALE DO RIO DOCE                        | 15,57% | 60,50% | 39,37%  | 60,49%   | 223,93%  |
| 2 | GW CLASSIC FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES              | 12,36% | 44,72% | 48,72%  | 44,70%   | 72,61%   |
| 3 | BB TOP AÇÕES SETORIAL SIDERURGIA FUNDO DE INVESTIMENTO | 10,93% | 36,53% | 40,80%  | 36,52%   | 192,59%  |
| 4 | BB TOP AÇÕES EXPORTAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO          | 9,00%  | 25,78% | 26,84%  | 25,77%   | 32,38%   |
| 5 | CAIXA FIC ACOES VALOR SMALL CAP RPPS                   | 7,88%  | 32,81% | 23,49%  | 32,83%   | 5,22%    |

|    | Fundo de Investimento                                   | Mês   | Ano    | 6 meses | 12 meses | 24 meses |
|----|---------------------------------------------------------|-------|--------|---------|----------|----------|
| 6  | BRDESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES SMALL CAP PLUS   | 7,86% | 41,92% | 23,78%  | 41,91%   | 76,00%   |
| 7  | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA DIVIDENDOS         | 7,74% | 23,73% | 20,31%  | 23,72%   | 42,13%   |
| 8  | ITAÚ SMALL CAP VALUATION FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES | 7,68% | 37,58% | 25,39%  | 37,58%   | 48,52%   |
| 9  | HSBC FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES SMALL CAPS          | 7,65% | 41,86% | 26,26%  | 41,85%   | 71,44%   |
| 10 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO   | 7,19% | 49,07% | 27,84%  | 49,06%   | 80,07%   |

## Art. 8º IV

|    | Fundo de Investimento                                            | Mês   | Ano    | 6 meses | 12 meses | 24 meses |
|----|------------------------------------------------------------------|-------|--------|---------|----------|----------|
| 1  | FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA OURO MULTIMERCADO LONGO PRAZO        | 2,37% | 18,56% | 6,58%   | 17,92%   | 39,35%   |
| 2  | TERCON FIC FIM MULTICRÉDITO CRÉDITO PRIVADO                      | 1,92% | -2,87% | 1,84%   | -2,91%   |          |
| 3  | WESTERN ASSET US INDEX 500 FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO    | 1,71% | 29,44% | 14,26%  | 29,45%   | 58,35%   |
| 4  | BRDESCO FIC DE FI MULTIMERCADO GOLDEN PROFIT MODERADO            | 1,26% | 9,75%  | 5,93%   | 9,79%    | 27,05%   |
| 5  | PERFIN LONG SHORT 15 FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE | 1,24% | 13,47% | 5,76%   | 13,50%   | 35,24%   |
| 6  | BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FEEDER FIC FI MULTIMERCADO CRÉDITO | 1,06% | 2,99%  | 2,87%   | 3,05%    |          |
| 7  | MULTINVEST EQUITY HEDGE FI MULTIMERCADO                          | 0,99% | 11,83% | 5,80%   | 11,89%   | 26,60%   |
| 8  | SAFRA CARTEIRA INSTITUCIONAL - FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCAD | 0,90% | 10,82% | 5,33%   | 10,87%   | 26,98%   |
| 9  | LEME FIC DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO            | 0,87% | 12,31% | 5,67%   | 12,36%   | -18,73%  |
| 10 | ITAÚ INSTITUCIONAL MULTIMERCADO JUROS E MOEDAS FI                | 0,83% | 9,05%  | 4,08%   | 9,11%    | 24,78%   |

## Art. 8º V

|   | Fundo de Investimento                                            | Mês    | Ano     | 6 meses | 12 meses | 24 meses |
|---|------------------------------------------------------------------|--------|---------|---------|----------|----------|
| 1 | FOCO CONQUEST FIP                                                | -0,04% | -19,79% |         |          | -20,70%  |
| 2 | FUNDO BRASIL DE INTERNACIONALIZAÇÃO DE EMPRESAS FIP II           | -0,05% | 3,66%   |         |          |          |
| 3 | ÁTICO FLORESTAL - FIP                                            | -0,12% | -1,54%  |         |          | -3,09%   |
| 4 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPACOES CAIXA INCORPORACAO IMOBIL | -0,13% | 15,87%  |         |          |          |

|    | Fundo de Investimento                                            | Mês    | Ano     | 6 meses | 12 meses | 24 meses |
|----|------------------------------------------------------------------|--------|---------|---------|----------|----------|
| 5  | FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES FONTAINE VILLE URBANISMO  | -0,14% | 26,97%  |         | 26,96%   | 107,78%  |
| 6  | ÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO E | -0,14% | -1,80%  |         |          | -3,58%   |
| 7  | INFRA SANEAMENTO - FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES        | -0,16% | -1,91%  |         |          | -0,90%   |
| 8  | W7 FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES                        | -0,24% | -2,10%  |         |          |          |
| 9  | BRB QAM FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES IMOB PARANÁ I     | -0,71% | -66,76% |         |          | -62,19%  |
| 10 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPACOES VENTURE BRASIL CENTRAL    | -8,33% | 9,40%   |         |          |          |

## Art. 8º VI

|    | Fundo de Investimento                                            | Mês     | Ano     | 6 meses | 12 meses | 24 meses |
|----|------------------------------------------------------------------|---------|---------|---------|----------|----------|
| 1  | RB CAPITAL RENDA II FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO            | 1,95%   | 37,60%  |         |          |          |
| 2  | FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO AGENCIAS CAIXA - FII           | 1,49%   | 4,98%   |         |          |          |
| 3  | FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO BR HOTÉIS - FII                | 1,43%   | -18,10% |         |          |          |
| 4  | FIRENZE FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO                        | -0,03%  | 0,50%   |         |          |          |
| 5  | AQUILLA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO                        | -0,20%  | -3,42%  |         |          |          |
| 6  | FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII SIA CORPORATE            | -0,92%  | 11,22%  |         |          | -33,70%  |
| 7  | CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FI | -2,07%  | 2,90%   |         |          |          |
| 8  | ÁTICO RENDA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII              | -31,29% | -31,79% |         |          | -37,72%  |
| 9  | BANRISUL NOVAS FRONTEIRAS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FI |         |         |         |          |          |
| 10 | KINEA II REAL ESTATE EQUITY FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO    |         |         |         |          |          |

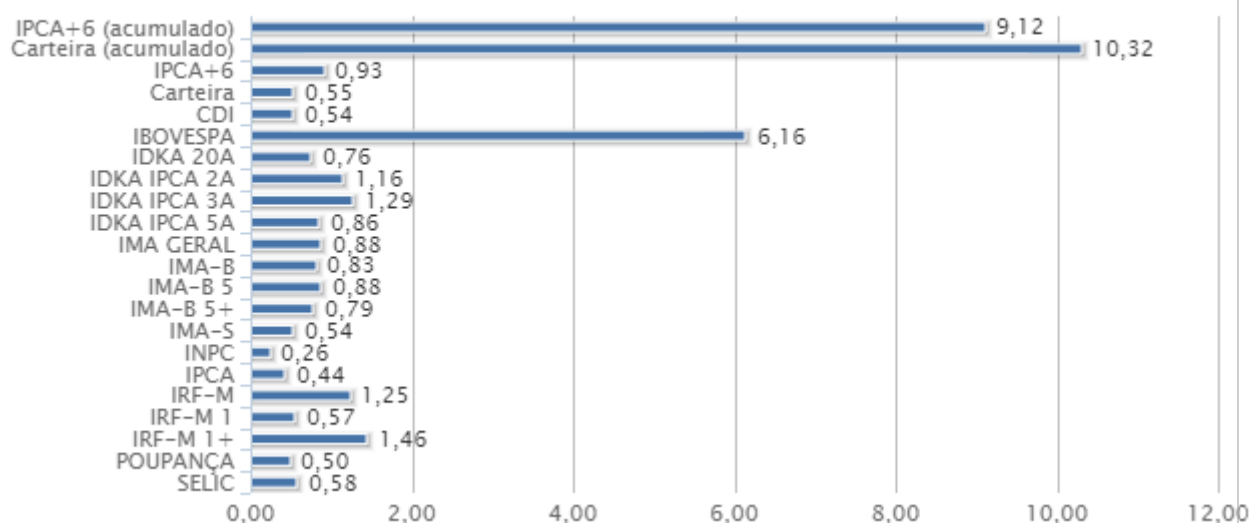


## 5. CONSIDERAÇÕES FINAIS

Após um ano conturbado com indicadores abaixo do previsto, sucessivos cortes de gastos, falta de recursos, aumento de tributos, tivemos um fechamento esperançoso de 2017. Com registro de altas no IPCA e no INPC, apesar dos reflexos da crise conseguimos ter uma faixa de esperança na economia de 2018.

O cálculo da TMA (representada pelo IPCA+6 a.a.) foi de 0,93%, porém o CORONEL PREV obteve uma rentabilidade agregada de sua carteira de 0,55%, não atingindo a Taxa de Meta Atuarial.

### Rentabilidade dos indicadores e da Carteira



### Resumo dos principais indicadores

Na situação financeira, o CORONEL PREV obteve rendimento de R\$ 3.439,49 neste mês, e, os resgates superaram as aplicações em um valor de R\$ -133.509,49. O saldo em conta corrente foi de R\$ 22.282,45.

Assim como em 2017, o cenário político deverá continuar ditando o rumo da economia em 2018, sobretudo por se tratar de um ano com eleições. O país está numa melhora, que justifica a possibilidade de rentabilidade positiva.

Achilles de Santana Junior

Consultor de Valores Mobiliários - Credenciado pela CVM

## Confirmação de Recebimento de Relatório

Atesto aos devidos fins, que recebi da diretoria executiva do FUNDO DE PREVIDENCIA SOCIAL DO MUNICIPIO DE CORONEL JOAO PESSOA, o Relatório de Investimentos CORONEL PREV, referente ao período: Dezembro / 2017.

Tal recebimento condiz com a obrigatoriedade exigida na PORTARIA MPS Nº 345, DE 28 DE DEZEMBRO DE 2009 - DOU DE 29/12/2009, onde de acordo com o Art. 2º, inciso "V", define:

**"V - elaborar relatórios detalhados, no mínimo ao término de cada trimestre, sobre a rentabilidade e risco das diversas modalidades de operações realizadas pelo regime próprio de previdência social com títulos, valores mobiliários e demais ativos alocados nos segmentos de renda fixa, renda variável e imóveis, e submetê-los às instâncias superiores de deliberação e controle;"**

Coronel João Pessoa-RN, 30 de Janeiro de 2018

\_\_\_\_\_  
**ADI HELDER ALVES DE SOUZA**  
MEMBRO DO CONSELHO ADMINISTRATIVO

\_\_\_\_\_  
**AELDOMAR DANTAS DE LIRA**  
MEMBRO DO CONSELHO ADMINISTRATIVO

\_\_\_\_\_  
**ALYSON MICLÉRISTON DA SILVA LOPES**  
MEMBRO DO CONSELHO ADMINISTRATIVO

\_\_\_\_\_  
**BONFIM BEZERRA DE ARAUJO**  
MEMBRO DO CONSELHO ADMINISTRATIVO

\_\_\_\_\_  
**JACIRO CABOCLO DA SILVA**  
MEMBRO DO CONSELHO ADMINISTRATIVO

\_\_\_\_\_  
**JOSÉ GENÁRIO DE LIMA**  
MEMBRO DO CONSELHO ADMINISTRATIVO

**JOSÉ SEVERIANO DE FIGUEIREDO MAIA JUNIOR**  
MEMBRO DO CONSELHO ADMINISTRATIVO

**JOSÉ SILVANO DE LIMA**  
MEMBRO DO CONSELHO ADMINISTRATIVO

**JOSEFA JUSILENE DE BESSA NUNES**  
MEMBRO DO CONSELHO ADMINISTRATIVO

**MARIA DAS GRAÇAS DE CARVALHO**  
MEMBRO DO CONSELHO ADMINISTRATIVO

**MARIA NARCISA DE SOUZA**  
MEMBRO DO CONSELHO ADMINISTRATIVO

**MARIA ZILAR DE AMORIM LIMA**  
MEMBRO DO CONSELHO ADMINISTRATIVO

**MARINETE DE SOUZA NUNES**  
MEMBRO DO CONSELHO ADMINISTRATIVO

**MARLA ELOIDES XAVIER DA SILVA MORAIS**  
MEMBRO DO CONSELHO ADMINISTRATIVO

**RAFAEL CARVALHO MORENO**  
MEMBRO DO CONSELHO ADMINISTRATIVO

**RAIMUNDA AUGUSTA DA SILVA**  
MEMBRO DO CONSELHO ADMINISTRATIVO

**RAIMUNDA JACINTA NOGUEIRA**  
MEMBRO DO CONSELHO ADMINISTRATIVO

**VERA LUCIA AUGUSTA DE SOUZA**

---

MEMBRO DO CONSELHO ADMINISTRATIVO

