

FUNDO DE PREVIDENCIA SOCIAL DO MUNICIPIO DE CORONEL JOAO PESSOA

Relatório de Investimentos CORONEL PREV

Janeiro / 2018

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	9
Renda Fixa	9
Art. 7º I, "b"	9
Art. 7º III	9
Art. 7º IV	10
Art. 7º VI	10
Art. 7º VII, "a"	11
Art. 7º VII, "b"	11
Renda Variável	12
Art. 8º I	12
Art. 8º II	12
Art. 8º III	12
Art. 8º IV	13
Art. 8º V	13
Art. 8º VI	14
5. CONSIDERAÇÕES FINAIS	15
Confirmação de Recebimento de Relatório	16

1. CENÁRIO ECONÔMICO

1.1 Destaques do mês

Mercado projeta inflação de 3,95% e crescimento do PIB de 2,7%, em 2018

A inflação medida pelo Índice Nacional de Preços ao Consumidor (IPCA) do ano de 2018 deve ficar em 3,95%. A projeção é de agentes do mercado financeiro consultados pelo Banco Central e divulgada no *Boletim Focus*, hoje (15). O IPCA projetado é levemente menor do que o divulgado há um mês, de 4%. Para 2019, a expectativa é que o índice seja de 4,25%.

O *Boletim Focus* é lançado no início da semana e traz a média das expectativas de bancos, instituições financeiras, consultorias e empresas sobre os principais indicadores relacionados à economia brasileira, como os diversos índices de inflação, o Produto Interno Bruto (PIB, soma das riquezas do país), a taxa de câmbio e a taxa de juros básica da economia, a Selic.

Taxa de juros - SELIC

Em fevereiro acontecerá a primeira reunião do ano de 2018 para a definição da taxa de juros (SELIC), onde o mercado já prevê uma baixa de 0,25 p.p o que ajudaria o País à atingir os resultados esperando neste ano, mesmo com a volatilidade política, que assolará o Brasil em um ano de conturbadas eleições, onde ninguém consegue prever o resultado final do pleito de outubro.

1.2 Cenário Brasileiro

Brasil deve puxar crescimento da América Latina em 2018

O Banco Mundial estima que o crescimento da América Latina dobre neste ano em relação a 2017, passando de 0,9% para 2%. O principal motivo da alta, segundo a instituição, é a recuperação do Brasil, que tem previsão de crescer 2% em 2018, após registrar dois anos seguidos de contração, em 2015 e 2016, e alta estimada em 1% em 2017. Em 2019, a expansão deve ser de 2,3%.

Além disso, o Banco Mundial projetou que o crescimento mais forte na América Latina ocorra no Panamá, onde deve alcançar 5,6%, de acordo com o relatório semestral *Perspectivas Econômicas Globais*.

Já os economistas brasileiro consultados pela pesquisa semanal *Focus*, do Banco Central, fizeram um leve ajuste para cima nas projeções para o crescimento da economia brasileira em 2017 e em 2018.

O Produto Interno Bruto (PIB) deve registrar um crescimento de 1% redondo em 2017, e não mais de 0,98% como era esperado na semana passada, segundo o levantamento. É a quinta alta consecutiva da projeção para esse indicador. Para 2018, a expectativa foi elevada de 2,68% para 2,70%, na sétima semana consecutiva de aumento no otimismo com relação ao indicador.

1.3 Cenário Internacional

Os riscos para a economia mundial em 2018

Neste início de 2018, diversos organismos internacionais listaram as possíveis ameaças à economia mundial. Apesar da previsão de crescimento de 3,1% para este ano, ainda existem incógnitas e ameaças latentes.

- Riscos geopolíticos e de estabilidade das instituições e das regras globais;
- Queda do crescimento da produtividade;
- A surpresa da inflação;
- Aumento dos níveis de endividamento; e por último
- Há um dilema moral.

Nesse cabe uma observação: As empresas precisam apostar no bem comum, e não apenas nos lucros dos acionistas. Isso é um risco, mas levanta a questão sobre como as empresas podem ganhar legitimidade perante uma sociedade cada vez mais cansada do aumento da desigualdade. Esse debate pode ter um efeito importante.

1.4 Bolsa

O principal índice de ações da B3 fechou em alta no último dia de janeiro, sustentado pelo avanço de bancos e Petrobras, e encerrou o primeiro mês do ano com valorização de mais de 11% em meio a um relevante fluxo de capital externo para as ações brasileiras.

No melhor momento da sessão, o índice renovou máxima intradia ao atingir 86.212 pontos. A bolsa brasileira registrou sucessivos recordes de fechamento no mês. O último foi na sexta-feira passada, quando o Ibovespa encerrou a 85.530 pontos, com os mercados ainda reagindo à condenação do ex-presidente Luiz Inácio Lula da Silva em segunda instância.

Para um futuro cenário, apesar das incertezas, as apostas seguem com bastante otimismo. A expectativa da maioria dos economistas é de que o IBOVESPA feche o ano acima dos 90 mil pontos, alguns até acreditam que o benchmark da bolsa brasileira vai exceder os 100 mil pontos, e outros mais conservadores esperam que ele termine 2018 abaixo dos 80 mil.

1.5 Projeções

Depois de dois anos de recessão e um 2017 marcado por recuperação lenta, a previsão entre os economistas, assim como as projeções do Fundo Monetário Internacional (FMI) e do próprio governo, é de que a economia brasileira vai crescer com mais força em 2018. No entanto, projeções sobre indicadores como câmbio, juros e inflação divergem em meio às incertezas sobre as eleições e reformas econômicas.

PIB

Os economistas estão mais otimistas em relação ao crescimento econômico do ano, embora ressalvem que as discussões sobre as reformas econômicas (especialmente a da Previdência) e a possível instabilidade que a disputa eleitoral pode ocasionar no mercado financeiro podem tornar o cenário incerto.

INFLAÇÃO

Após a inflação reduzir com força o poder de compra das pessoas nos dois anos anteriores, 2017 foi marcado por uma desaceleração da alta de preços. Para 2018, a previsão dos economistas é que a inflação volte a ganhar força, mas ainda se mantendo dentro da meta de 4,5% do Banco Central – e longe dos altos índices dos anos anteriores.

TAXA DE CÂMBIO

Os economistas são unânimes ao apontar 2018 como um ano de instabilidade para o mercado financeiro, diante do cenário eleitoral incerto. Eles avaliam que, até o final do ano, a tendência é que o dólar se estabilize, mas não há consenso sobre o patamar em que a moeda irá se firmar em relação ao real.

JUROS

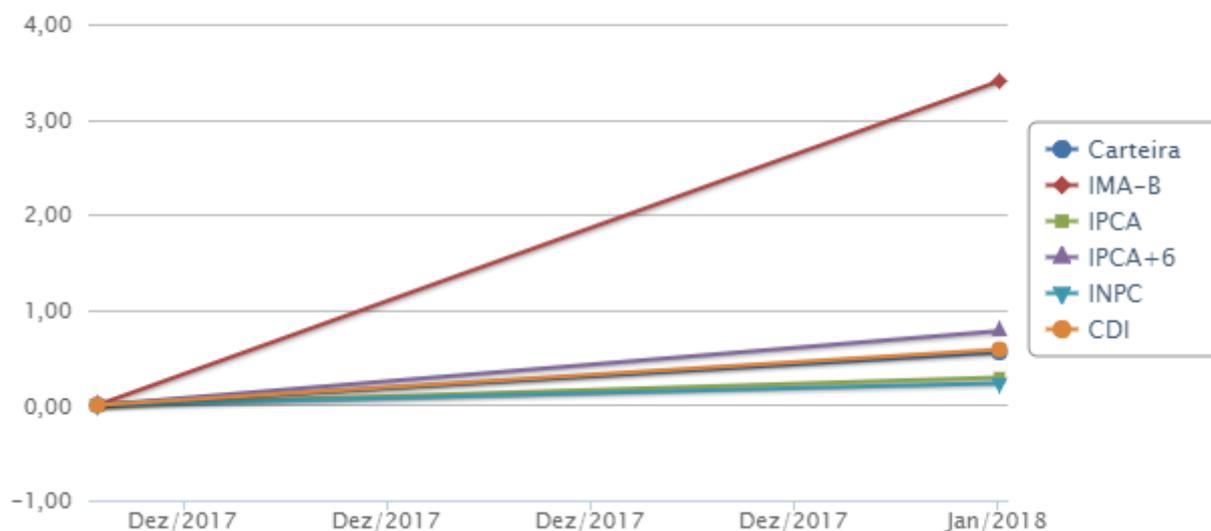
Os economistas acompanham as indicações do Banco Central em relação ao rumo da taxa Selic, que terminou o ano em 7% ao ano. A grande dúvida é sobre o patamar que deverá ser fixado para manter a inflação na meta de 4,5%.

DESEMPREGO

Apesar de a taxa de desemprego ter começado a cair em 2017, muitos brasileiros ainda não sentem uma melhora efetiva do mercado de trabalho. Uma das razões é que, durante o ano, a grande maioria dos postos de trabalho criados no Brasil foi composta de vagas informais.

No entanto, mesmo nesse cenário, é sabido que “o pior do desemprego já ficou para trás”, e é esperado que a taxa de desemprego encerre 2018 em 11,9%.

1.6 Indicadores Financeiros



2. ANÁLISE DA CARTEIRA

2.1 Composição da Carteira

Fundo de Investimento	Saldo em 29/12/2017	Saldo em 31/01/2018	Rentabilidade
CAIXA FI BRASIL DI LONGO PRAZO	R\$55.138,00	R\$29.644,00	0,57%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTA	R\$84.808,00	R\$65.491,00	0,49%
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	R\$145.762,00	R\$177.047,00	0,57%
BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS FIC	R\$241.051,00	R\$241.521,00	0,59%
	R\$526.759,00	R\$513.703,00	

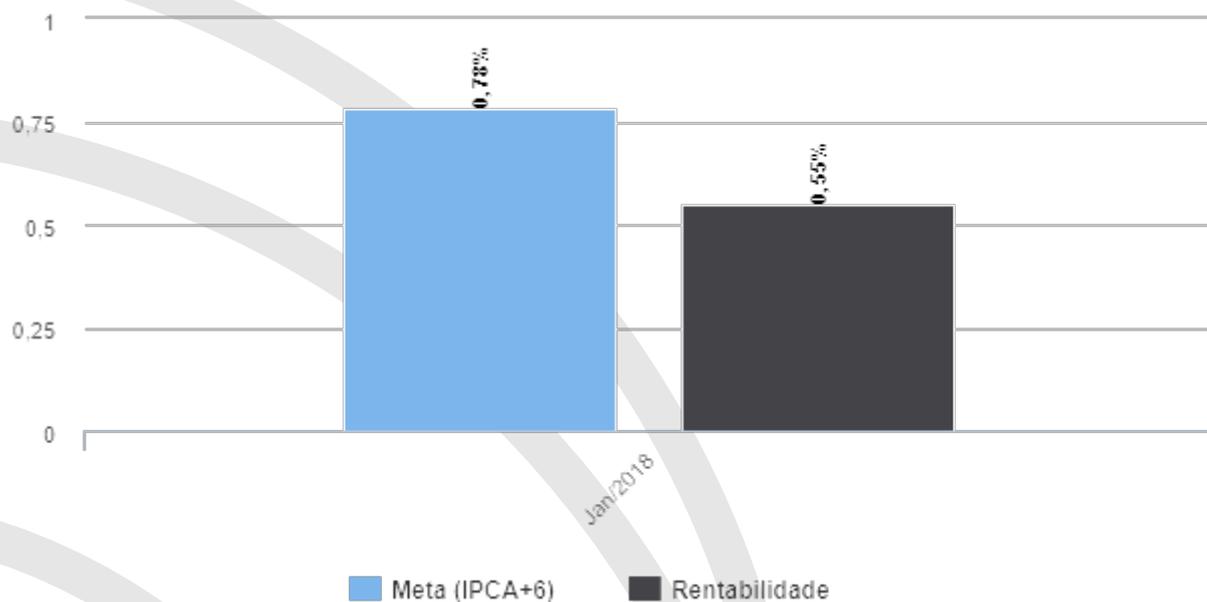
2.2 Investimentos por Segmento

Segmento	Saldo em 29/12/2017	Saldo em 31/01/2018	Rentabilidade
Renda Fixa	R\$471.620,69	R\$484.059,17	0,55%
Renda Fixa Referenciado	R\$55.137,82	R\$29.644,41	0,57%
	R\$526.758,51	R\$513.703,58	

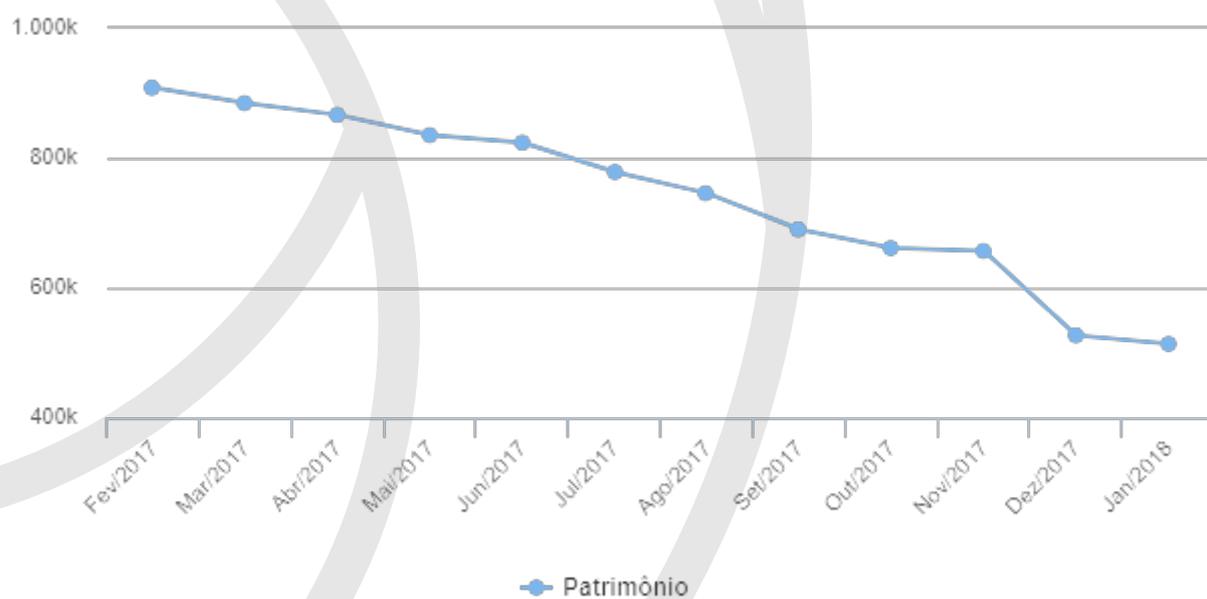
2.3 Investimentos por Instituição

Instituição Financeira	Saldo em 29/12/2017	Saldo em 31/01/2018	Rentabilidade
Banco do Brasil S.A.	R\$325.859,00	R\$307.012,48	0,56%
Caixa Econômica Federal	R\$200.899,51	R\$206.691,10	0,56%
	R\$526.758,51	R\$513.703,58	

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	0,49%	0,49%	3,28%	8,30%	R\$1.315.331.786,69	28/04/2011	1,00%	0,00%	R\$1.000,00
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS FIC	0,59%	0,59%	4,00%	10,12%	R\$10.624.921.638,82	08/12/2009	0,10%	0,00%	R\$1,00
CAIXA FI BRASIL DI LONGO PRAZO	0,57%	0,57%	3,78%	9,39%	R\$5.920.495.976,29	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 TPRF	0,57%	0,57%	4,02%	10,18%	R\$14.079.283.161,05	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%	81,48%	R\$418.568,18
- BB PREVIDENCIARIO RF IRF-M 1 TP	100,00%	47,02%	R\$241.521,49
- CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	100,00%	34,46%	R\$177.046,69
Art. 7º - Inciso IV - até 30% em Renda Fixa	30,00%	18,52%	R\$95.135,40
- BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA FLU	20,00%	12,75%	R\$65.490,99
- CAIXA FI BRASIL DI LP	20,00%	5,77%	R\$29.644,41
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\$513.703,58

3.2 Enquadramento na Política de Investimentos Atual

Artigo/Fundo	Mínimo	Máximo	Alocado
Art. 7º - Inciso I, alínea b - até 100% em Títulos Publ - Ref	0,00%	0,00%	81,48%
- BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS FIC	0,00%	0,00%	47,02%
- CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	0,00%	0,00%	34,46%
Art. 7º - Inciso IV - até 30% em Renda Fixa	0,00%	0,00%	18,52%
- CAIXA FI BRASIL DI LONGO PRAZO	0,00%	0,00%	5,77%
- BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTA	0,00%	0,00%	12,75%

4. RANKINGS

Renda Fixa

Art. 7º I, "b"

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
1	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE I	6,19%	6,19%	6,99%	15,27%	65,00%
2	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	4,92%	4,92%	6,96%	15,19%	52,17%
3	CAIXA BRASIL FI IMA B 5+ TITULOS PÚBLICOS RF LP	4,91%	4,91%	6,98%	15,45%	52,37%
4	BANESTES PREVIDENCIARIO - RENDA FIXA	4,67%	4,67%	7,22%	14,95%	46,05%
5	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS REN	4,46%	4,46%	4,38%	8,99%	32,60%
6	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS REND	4,46%	4,46%	4,42%	9,19%	33,53%
7	FUNDO DE INVESTIMENTO KANSAI RF IMA-B 100% TP - RPPS	4,11%	4,11%	3,51%	3,53%	22,20%
8	SUL AMÉRICA INFLATIE FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRA	4,08%	4,08%	6,95%	17,03%	46,74%
9	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INV	3,38%	3,38%	6,22%	14,22%	42,25%
10	SANTANDER FIC EM FI IMA B INSTITUCIONAL TP RF LP	3,38%	3,38%	6,22%	14,28%	42,43%
53	BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS FIC	0,59%	0,59%	4,00%	10,12%	25,62%
56	CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	0,57%	0,57%	4,02%	10,18%	25,79%

Art. 7º III

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
1	AD TRUST FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	5,14%	5,14%	5,77%	11,92%	22,39%
2	FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IPIRANGA	5,05%	5,05%	8,79%	4,15%	24,33%
3	BRANDESCO INSTITUCIONAL FIC DE FI RF IMA B 5+	4,88%	4,88%	6,92%	15,24%	52,07%
4	BANESTES INSTITUCIONAL - RENDA FIXA	4,31%	4,31%	7,30%	14,82%	45,93%
5	BRS IMA-B ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS - RENDA FIXA	3,98%	3,98%	6,41%	10,57%	28,86%
6	BNP PARIBAS INFLAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE	3,50%	3,50%	6,15%	14,28%	42,59%
7	SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B L	3,43%	3,43%	6,18%	14,09%	41,42%
8	UNIBANCO INDICE DE PRECOS FI RENDA FIXA	3,40%	3,40%	6,17%	13,95%	41,84%
9	BRANDESCO FI RF IMA B	3,39%	3,39%	6,32%	14,58%	43,05%

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
10	SAFRA IMA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	3,37%	3,37%	6,43%	14,67%	41,07%

Art. 7º IV

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
1	TOTEM FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA II	4,55%	4,55%	2,75%	-13,55%	4,39%
2	BRB FUNDO DE INVESTIMENTO EM RENDA FIXA LONGO PRAZO IMAB 1000	2,56%	2,56%		8,62%	33,30%
3	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INV	2,18%	2,18%	5,72%	14,43%	38,93%
4	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI	1,82%	1,82%	5,72%	14,62%	37,27%
5	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	1,72%	1,72%	4,99%	12,17%	
6	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	1,49%	1,49%	5,24%	12,18%	37,23%
7	BTG PACTUAL IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	1,30%	1,30%	5,02%	12,48%	27,13%
8	UNIBANCO RENDA FIXA LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO	1,22%	1,22%	4,84%	12,97%	37,30%
9	MULTINVEST INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IRF-M1	1,13%	1,13%	5,03%	12,65%	26,44%
10	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	1,09%	1,09%	5,10%	9,46%	23,44%
38	CAIXA FI BRASIL DI LONGO PRAZO	0,57%	0,57%	3,78%	9,39%	24,73%
63	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTA	0,49%	0,49%	3,28%	8,30%	22,54%

Art. 7º VI

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
1	BANRISUL PREVIDENCIA IPCA 2030 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	1,09%	1,09%	2,13%	3,30%	9,88%
2	QT IPCA FIDC JUROS REAL					
3	LME REC MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS C					
4	ILLUMINATI FIDC					
5	MAXPREV FIQ FIDC MULTISSETORIAL					
6	GFM FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTICRÉDITO					
7	BCSUL VERAX CPP 360 FIDC SENIOR					
8	FIDC DA INDÚSTRIA EXODUS INSTITUCIONAL - SENIOR					

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
9	FIDC ABERTO CAIXA RPPS CONSIGNADO BMG					
10	OURINVEST FIDC FINANCEIROS - SUPPLIERCARD					

Art. 7º VII, "a"

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
1	FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS CASAN SANEAMENTO	1,32%	1,32%	2,08%	9,66%	-8,59%
2	SUL INVEST FIDC - MULTISSETORIAL					
3	FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR					
4	FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL 3SEN					
5	RED FDO DE INVEST EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSETORIAL LP					
6	FIDC DA COMPANHIA ESTADUAL DE ÁGUAS E ESGOTOS - CEDAE					
7	FDO INV DIREITOS CREDIT BCSUL VERAX MULTICRED 4SERIE					
8	FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER					
9	FIDC MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA - SENIOR					
10	INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC - Série B					

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	1,36%	1,36%	5,72%	14,87%	36,01%
2	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA XVI RENDA FIXA CRÉDITO P	0,99%	0,99%	3,68%	9,48%	24,35%
3	SANTANDER FI MASTER RENDA FIXA CREDITO PRIVADO LONGO PRAZO	0,60%	0,60%	4,01%	9,81%	25,48%
4	BTG PACTUAL YIELD DI FI RENDA FIXA REFERENCIADO CRÉDITO PRIVADO	0,60%	0,60%	3,92%	9,75%	25,52%
5	SAFRA CAPITAL MARKET PREMIUM DI CREDITO PRIVADO FIC FI REFERENCI	0,59%	0,59%	3,89%	9,63%	25,40%
6	SAFRA CAPITAL MARKET - FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CRÉDITO	0,58%	0,58%	3,80%	9,43%	24,97%
7	SAFRA CAPITAL MARKET INSTITUCIONAL DI FUNDO DE INVESTIMENTO EM C	0,56%	0,56%	3,71%	9,25%	24,53%
8	URCA FI RENDA FIXA CREDITO PRIVADO PREVIDENCIARIO	0,40%	0,40%	7,31%	13,11%	25,95%
9	SECURITY FI REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	0,29%	0,29%	1,82%	4,26%	-21,90%

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
10	INCENTIVO FUNDO DE INVESTIMENTO REFERENCIADO CDI CRÉDITO PRIVADO	-0,12%	-0,12%	40,43%	66,07%	-95,34%

Renda Variável

Art. 8º I

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
1	HSBC FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES IBOVESPA VALUATION	12,65%	12,65%	33,21%	38,07%	121,31%
2	CAIXA FI AÇÕES BRASIL IBX - 50	11,94%	11,94%	31,39%	33,54%	86,33%
3	BRADERCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES INSTITUCIONAL IBRX ATIVO	11,60%	11,60%	29,74%	33,19%	97,85%
4	FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES CAIXA IBOVESPA ATIVO	11,34%	11,34%	29,18%	29,14%	80,08%
5	DAYCOVAL DIVIDENDOS IBOVESPA FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	11,15%	11,15%	21,80%	32,11%	87,76%
6	BRADERCO FIA IBOVESPA PLUS	11,11%	11,11%	28,34%	30,78%	109,59%
7	FI EM AÇÕES CAIXA BRASIL IBOVESPA	11,02%	11,02%	28,17%	30,40%	106,84%
8	BRADERCO H FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES IBOVESPA	10,87%	10,87%	26,98%	28,13%	99,56%
9	BB AÇÕES IBOVESPA INDEXADO FICFI	10,83%	10,83%	27,18%	28,08%	100,23%
10	SANTANDER FI IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL AÇÕES	10,73%	10,73%	27,75%	30,68%	99,24%

Art. 8º II

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
1	ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVA11	11,09%	11,09%	28,68%	30,98%	109,04%
2	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	10,91%	10,91%	27,85%	30,19%	106,90%

Art. 8º III

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
1	SANTANDER PETROBRÁS PLUS FIC AÇÕES	25,63%	25,63%	51,91%	27,51%	190,72%
2	BB AÇÕES BB FUNDO DE INVESTIMENTO	24,38%	24,38%	39,53%	29,40%	197,93%
3	BB TOP AÇÕES SETOR FINANCEIRO FUNDO DE INVESTIMENTO	18,94%	18,94%	33,21%	36,96%	128,22%
4	BB ACOES SETOR FINANCEIRO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUND	18,84%	18,84%	32,53%	35,58%	123,60%

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
5	BB TOP AÇÕES SETORIAL SIDERURGIA FUNDO DE INVESTIMENTO	18,54%	18,54%	56,34%	42,86%	316,34%
6	BB AÇÕES CIELO FUNDO DE INVESTIMENTO	14,05%	14,05%	4,47%	23,85%	16,71%
7	QUEST AÇÕES FIC FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	13,79%	13,79%	32,10%	31,91%	84,53%
8	BRASIL PLURAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE AÇÕES	12,62%	12,62%	29,76%	31,22%	54,36%
9	BNY MELLON ARX INCOME FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	12,02%	12,02%	28,08%	27,78%	98,06%
10	AZ LEGAN BRASIL FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	11,45%	11,45%	24,63%	28,57%	83,70%

Art. 8º IV

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
1	WESTERN ASSET US INDEX 500 FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	5,38%	5,38%	17,37%	33,69%	78,17%
2	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA OURO MULTIMERCADO LONGO PRAZO	3,29%	3,29%	7,49%	15,93%	36,07%
3	PERFIN LONG SHORT 15 FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE	2,60%	2,60%	7,44%	13,93%	37,64%
4	XP LONG SHORT FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST	2,59%	2,59%	2,44%	3,31%	29,58%
5	GERAÇÃO FUTURO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVES	1,68%	1,68%	5,52%	10,35%	21,66%
6	BRANCO FIC DE FI MULTIMERCADO GOLDEN PROFIT MODERADO	1,60%	1,60%	5,88%	9,79%	28,43%
7	BRASIL PLURAL INSTITUCIONAL 15 FIC DE FI MULTIMERCADO	1,60%	1,60%	5,58%	10,24%	21,08%
8	GERAÇÃO FUTURO LIQUIDEZ TOP FIC MULTIMERCADO	1,50%	1,50%	5,26%	9,75%	20,18%
9	SAFRA CARTEIRA INSTITUCIONAL - FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCAD	1,25%	1,25%	5,12%	10,76%	26,66%
10	VOTORANTIM ATUARIAL MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVEST	1,22%	1,22%	5,19%	12,94%	30,03%

Art. 8º V

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
1	FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPACOES VENTURE BRASIL CENTRAL	56,06%	56,06%	16,12%	109,32%	
2	FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPACOES CAIXA INCORPORACAO IMOBIL	-0,14%	-0,14%	-0,53%	15,87%	
3	FUNDO BRASIL DE INTERNACIONALIZAÇÃO DE EMPRESAS FIP II	-0,26%	-0,26%	-1,84%	3,61%	

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
4	BRB QAM FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES IMOB PARANÁ I	-0,30%	-0,30%	-2,33%	-56,39%	-62,85%
5	BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE					
6	FOCO CONQUEST FIP					
7	FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES LSH					
8	VIAJA BRASIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES					
9	W7 FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES					
10	PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FIC em FIP					

Art. 8º VI

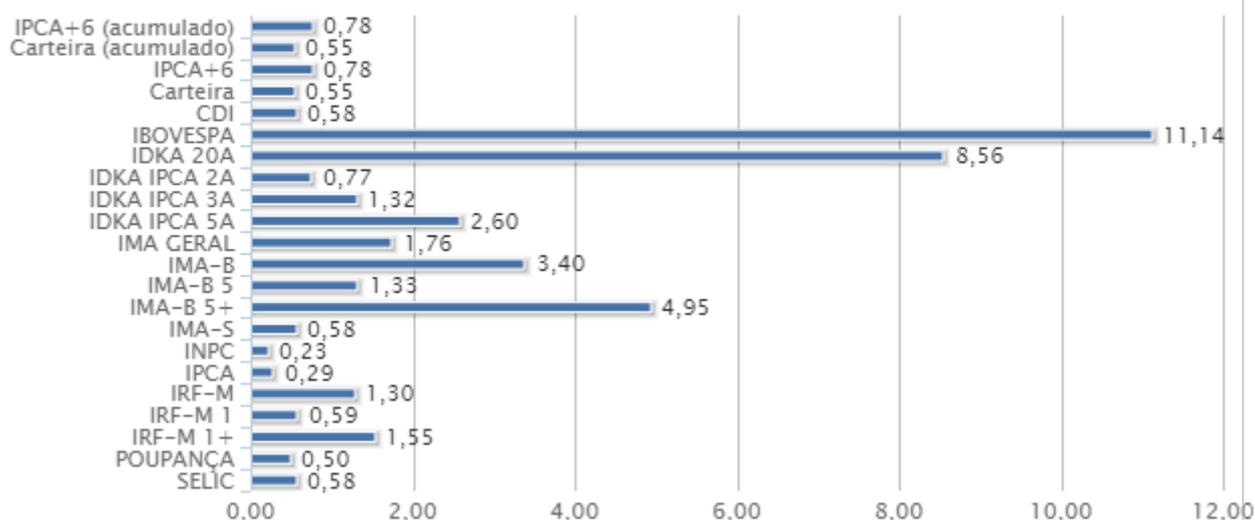
	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
1	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO AGENCIAS CAIXA - FII	2,34%	2,34%	0,04%	1,58%	
2	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FI	1,02%	1,02%	1,01%	4,85%	26,32%
3	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII SIA CORPORATE	0,04%	0,04%	3,65%	22,81%	-33,67%
4	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO BR HOTÉIS - FII					
5	ÁTICO RENDA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII					
6	BANRISUL NOVAS FRONTEIRAS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FI					
7	KINEA II REAL ESTATE EQUITY FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO					
8	FIRENZE FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO					
9	BB PROGRESSIVO II FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII					
10	BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO					

5. CONSIDERAÇÕES FINAIS

Um mês tranquilo no fechamento dos investimentos, mas que nos mostram que existe um bom espaço para análises e ganhos extras de juros nos recursos previdenciários. Indicadores como IMA Geral, IRF-M 1+ e IDKA 2A se mostram que podem ser um diferencial sem aumento dos riscos. #DicaOnFinance

O cálculo da TMA (representada pelo IPCA+6 a.a.) foi de 0,78%, 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\$ 3.075,53 neste mês, e, os resgates superaram as aplicações em um valor de R\$ -16.131,53. O saldo em conta corrente foi de R\$.

O ano de 2018 é daquele atípicos, com uma corrida presidencial em meio às rotinas necessárias de bons investimentos, ajustes previdenciários e acompanhamento dos mercados financeiros. Mantenha-se bem informado e ajuste o barco de acordo com as marés.

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: Janeiro / 2018.

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, 19 de Fevereiro 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

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