

FUNDO DE PREVIDENCIA SOCIAL DO MUNICIPIO DE CORONEL JOAO PESSOA

Relatório de Investimentos CORONEL PREV

Dezembro / 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
Brasil se consolida como maior exportador mundial de carne bovina	3
Vendas de veículos novos têm segundo ano seguido de crescimento	3
1.3 Cenário Internacional	3
1.4 Bolsa	4
1.5 Projeções	4
1.6 Indicadores Financeiros	5
2. ANÁLISE DA CARTEIRA	6
2.1 Composição da Carteira	6
2.2 Investimentos por Segmento	6
2.3 Investimentos por Instituição	6
2.4 Carteira x Meta Atuarial	7
2.5 Evolução do Patrimônio	7
2.6 Análise Comparativa de Fundos	7
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"	11
Art. 7º VII, "b"	12
Renda Variável	12
Art. 8º I	12
Art. 8º II	13
Art. 8º III	13
Art. 8º IV	14
Art. 8º V	14
Art. 8º VI	14
5. CONSIDERAÇÕES FINAIS	16
Confirmação de Recebimento de Relatório	17

1. CENÁRIO ECONÔMICO

1.1 Destaques do mês

IPCA varia 0,15% em dezembro e fecha 2018 em 3,75%

O **Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo (IPCA)** de dezembro foi de 0,15%, ficando acima dos -0,21% de novembro. Essa foi a menor variação para um mês de dezembro desde o início do Plano Real, em 1994. Em dezembro de 2017, o índice tinha sido de 0,44%. O IPCA acumulado em 2018 ficou em 3,75%, 0,80 ponto percentual acima dos 2,95% registrados em 2017.

Após a queda de 0,21% em novembro, o IPCA registrou variação de 0,15% em dezembro, sob influência, principalmente, do grupo **Alimentação e bebidas** (0,44%) que, com 0,11 p.p. de impacto, foi responsável por quase 3/4 do índice de dezembro. Por outro lado, os grupos **Transportes** (-0,54%) e **Habitação** (-0,15%) vieram com deflação, contribuindo com -0,12 p.p. no IPCA do mês.

O IPCA é calculado pelo IBGE desde 1980, se refere às famílias com rendimento monetário de um a 40 salários mínimos, qualquer que seja a fonte, e abrange 10 regiões metropolitanas, além dos municípios de Aracaju, Brasília, Campo Grande, Goiânia, Rio Branco e São Luís. Para cálculo do índice do mês, foram comparados os preços coletados no período de 29 de novembro a 28 de dezembro de 2018 (referência) com os preços vigentes no período de 27 de outubro a 28 de novembro de 2018 (base).

Quanto ao percentual do ano (3,75%), ele foi influenciado, especialmente, pelas despesas com produtos e serviços dos grupos **Habitação**, com alta de 4,72% e impacto de 0,74 p.p., **Transportes**, com alta de 4,19% e 0,76 p.p. e **Alimentação e Bebidas**, com alta de 4,04% e 0,99 p.p.. Juntos, estes três grupos somam 2,49 p.p., responsáveis por 66% do IPCA. A tabela a seguir mostra os resultados de todos os grupos de produtos e serviços.

INPC de dezembro fica em 0,14% e 3,43% no ano

O INPC de dezembro foi de 0,14%, acima dos -0,25% de novembro. Ao lado de dezembro de 2016 (0,14%), esta variação foi a menor para o mês desde o início do Plano Real. O acumulado de 2018 fechou em 3,43%, acima dos 2,07% de 2017.

Os **produtos alimentícios** tiveram alta de 0,45% em dezembro, mesmo resultado registrado no mês anterior. O agrupamento dos **não alimentícios** ficou com variação de 0,01%, acima da taxa de -0,55% de novembro.

No fechamento de 2018, o índice acumulou 3,43%, acima dos 2,07% de 2017 em 1,36 p.p. Os **alimentos** tiveram variação de 3,82% enquanto os **não alimentícios** variaram 3,25%. Em 2017, os **alimentos** haviam apresentado queda de 2,70% e, os **não alimentícios**, alta de 4,25%. A tabela a seguir apresenta os resultados por grupo de produtos e serviços.

1.2 Cenário Brasileiro

Melhores investimentos 2018 – Dezembro

Com a valorização de 0,49% em dezembro, o dólar, pela cotação de mercado, fechou 2018 com forte valorização: +16,91%. Já o Ibovespa, com a perda de -1,81% no mês, encerrou 2018 com alta de +15,03%, significativamente acima do CDI, que teve ganho de +6,42%. Já a poupança teve ganho de +4,62% neste período(+5,60%, se incluirmos o IR de 17,5% para efeito de comparação com os demais investimentos).

Já a variação do IPCA nos últimos 12 meses deverá ficar em +3,69%, caso a variação de dezembro ocorra de acordo com a expectativa de +0,10% feita pelo mercado, ficando abaixo do centro da meta.

Brasil se consolida como maior exportador mundial de carne bovina

As exportações brasileiras de carne bovina fecharam 2018 em 1,64 milhão de toneladas, volume 11% superior ao registrado em 2017, informou nesta segunda-feira, 7, a Associação Brasileira das Indústrias Exportadoras de Carnes (Abiec). O resultado confirma a previsão divulgada em dezembro pela entidade e representa o maior volume já embarcado pelo País, que o consolida como principal exportador mundial da proteína. Em receita, o valor alcançou US\$ 6,57 bilhões, crescimento de 7,9% frente ao resultado de 2017.

Hong Kong e China se revezam como o principal destino da carne bovina brasileira ao longo do ano passado.

Em volume, Hong Kong liderou com 24% do total embarcado pelo Brasil, somando quase 395 mil toneladas.

Já a China foi o maior destino em faturamento, ao representar 22,63% do total, com US\$ 1,49 bilhão. Outros mercados em destaque são União Europeia, Chile e Emirados Árabes.

Vendas de veículos novos têm segundo ano seguido de crescimento

A venda de automóveis, comerciais leves, ônibus e caminhões no País cresceu 14,6% no ano passado em relação a 2017, com 2.566.235 unidades emplacadas.

É o segundo ano seguido de crescimento. No ano passado, estes segmentos apresentaram crescimento de 9,23%. O dado foi divulgado nesta quinta-feira (3) pela Fenabrave (Federação Nacional da Distribuição de Veículos Automotores). As informações são da Agência Brasil.

No mês, estes segmentos cresceram 1,70% e, na comparação com o mesmo mês de 2017, o aumento foi de 10,33%.

Considerando apenas automóveis e comerciais leves (picapes e furgões), houve alta de 13,74% no ano passado na comparação com 2017, com o emplacamento de 2.470.654 unidades. A expectativa para este ano é de aumento de 11% nestes dois segmentos.

Em relação ao emplacamento de todos os segmentos somados (automóveis, comerciais leves, caminhões, ônibus, motocicletas, implementos rodoviários e outros veículos), o aumento foi de 13,58% em 2018, com a venda de 3.653.500 unidades. Para 2019, a expectativa é de que todos os segmentos automotivos apresentem crescimento de 10,1%.

1.3 Cenário Internacional

Economia dos EUA cria 312 mil empregos em dezembro, acima das expectativas do mercado

A economia dos Estados Unidos gerou 312 mil postos de trabalho em dezembro, segundo relatório de emprego (conhecido como Payroll) divulgado nesta sexta-feira (7). O resultado veio bem acima da estimativa do mercado de criação de 184 mil vagas de trabalho no mês passado, segundo mediana do levantamento da Bloomberg. No mês de novembro foram criadas 176 mil novas vagas.

O Departamento de Trabalho dos EUA informou também que a taxa de desemprego norte-americana subiu para 3,9% ante a expectativa de que o patamar ficasse estagnado em 3,7%, segundo analistas do mercado consultados pela Bloomberg. Apesar da criação de empregos acima do esperado, a taxa de desemprego aumentou em virtude da entrada de 419 mil pessoas na força de trabalho norte-americana.

Os ganhos médios por hora subiram 0,4%, ante estimativa de crescimento de 0,3%.

Reservas cambiais da China caem em 2018 com desaceleração econômica e pressão de guerra comercial

As reservas cambiais anuais da China caíram pela terceira vez em quatro anos em 2018, com o iuan sob forte pressão de venda da desaceleração da economia e com a intensificação das tensões comerciais entre os Estados Unidos e a China.

A pressão de depreciação sobre o iuan deverá persistir este ano, já que Pequim deve implementar mais medidas de flexibilização da política monetária para reduzir o risco de uma desaceleração mais acentuada.

Mas um teste das mínimas em 10 anos do iuan, que era temido pelos mercados financeiros globais há apenas alguns meses, pode ser um risco menor, caso os analistas estejam corretos ao terem previsto que o longo rali do dólar está chegando ao fim.

As reservas cambiais na China - que são as maiores do mundo - caíram em 67,24 bilhões de dólares no ano passado, para 3,073 trilhões de dólares, mostraram dados do banco central divulgados nesta segunda-feira. No ano passado, as reservas registraram um aumento de 129,4 bilhões, para 3,14 trilhões de dólares.

1.4 Bolsa

O **Índice Bovespa** terminou o mês com 87.887 pontos, -1,81% abaixo do fechamento do mês anterior e -2,15% abaixo do recorde histórico registrado em 3 de dezembro com 89.820 pontos.

Nos doze meses do ano, a cotação do principal índice do mercado acionário brasileiro oscilou entre 69.068,77 pontos (valor mínimo registrado no pregão de 19 de Junho) e 91.242,22 pontos (valor máximo registrado no pregão de 03 de Dezembro).

Na comparação com a cotação de fechamento do ano anterior, o Ibovespa ganhou 11.485,18 pontos em seu valor. No dia 28 de Dezembro de 2017, o principal índice do Mercado Bovespa fechou cotado em 76.402,08 pontos.

1.5 Projeções

Santander reafirma otimismo com Brasil e vê Ibovespa em 115 mil pontos em 2019

O Santander Brasil divulgou relatório no qual seus estrategistas reiteraram a recomendação 'overweight' para ações brasileiras conforme relatório a clientes nesta quinta-feira, enxergando melhora no balanço de riscos domésticos, bem como elevaram a meta para o Ibovespa para 115 mil pontos no final do ano.

Entre os fatores que sustentam a visão positiva quanto ao balanço de riscos interno, Daniel Gewehr e João Noronha citam crescimento de lucros atrativos, com pequenas revisões positivas nos resultados, preço ainda favorável, potencial retorno de alocação em ações e reformas, embora dependentes do Congresso.

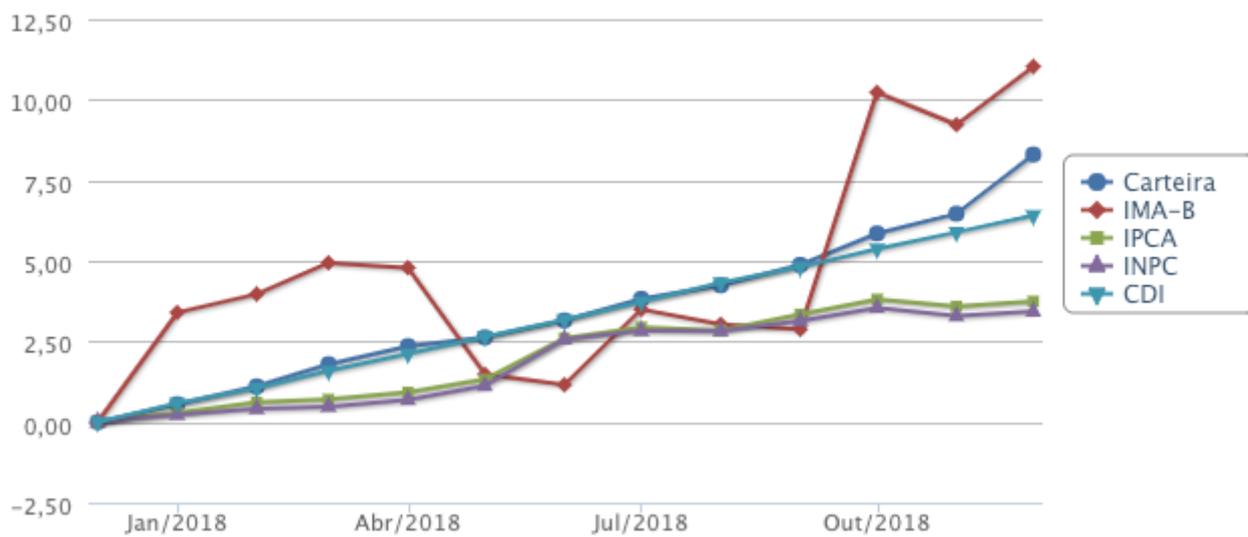
PROJEÇÃO BOLETIM FOCUS

Na manhã do dia 07 de Janeiro de 2019, o Banco Central do Brasil (BC) divulgou a primeira edição deste ano do Boletim Focus, relatório de mercado publicado semanalmente com as previsões de cerca de 100 (cem) analistas financeiros sobre diversos indicadores da economia brasileira.

A pesquisa do Banco Central foi realizada entre os dias 02 e 04 de Janeiro de 2019.

De acordo com o Boletim Focus, os principais economistas em atuação no país não pioraram nenhuma das projeções para 2018. Por outro lado, melhoraram suas projeções sobre a Produção Industrial e o Resultado Primário. Além disso, os analistas consultados mantiveram suas projeções anteriores sobre o Índice de Preços ao Consumidor Amplo (IPCA), o Índice Geral de Preços - Mercado (IGP-M), o Produto Interno Bruto (PIB), a Meta da Taxa Selic, a Balança Comercial, a Dívida Líquida do Setor Público, o Resultado Nominal, a Taxa de Crescimento dos Preços Administrados, o Valor do Dólar Comercial, o Investimento Direto no País e a Conta Corrente.

1.6 Indicadores Financeiros



2. ANÁLISE DA CARTEIRA

2.1 Composição da Carteira

Fundo de Investimento	Saldo em 30/11/2018	Saldo em 31/12/2018	Rentabilidade
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS FIC	R\$52.544,62	R\$0,00	345,80%
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	R\$22.130,44	R\$1.756,76	0,54%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTA	R\$0,00	R\$100.327,56	0,08%
	R\$74.675,07	R\$102.084,32	

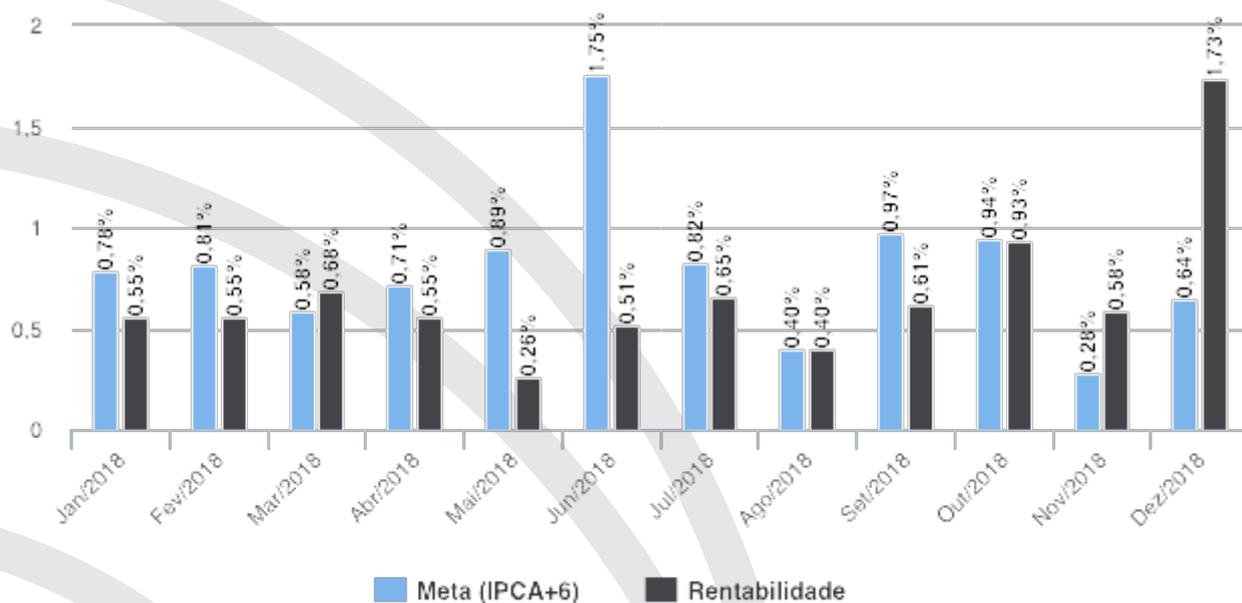
2.2 Investimentos por Segmento

Segmento	Saldo em 30/11/2018	Saldo em 31/12/2018	Rentabilidade
Renda Fixa	R\$74.675,07	R\$102.084,32	1,73%
	R\$74.675,07	R\$102.084,32	

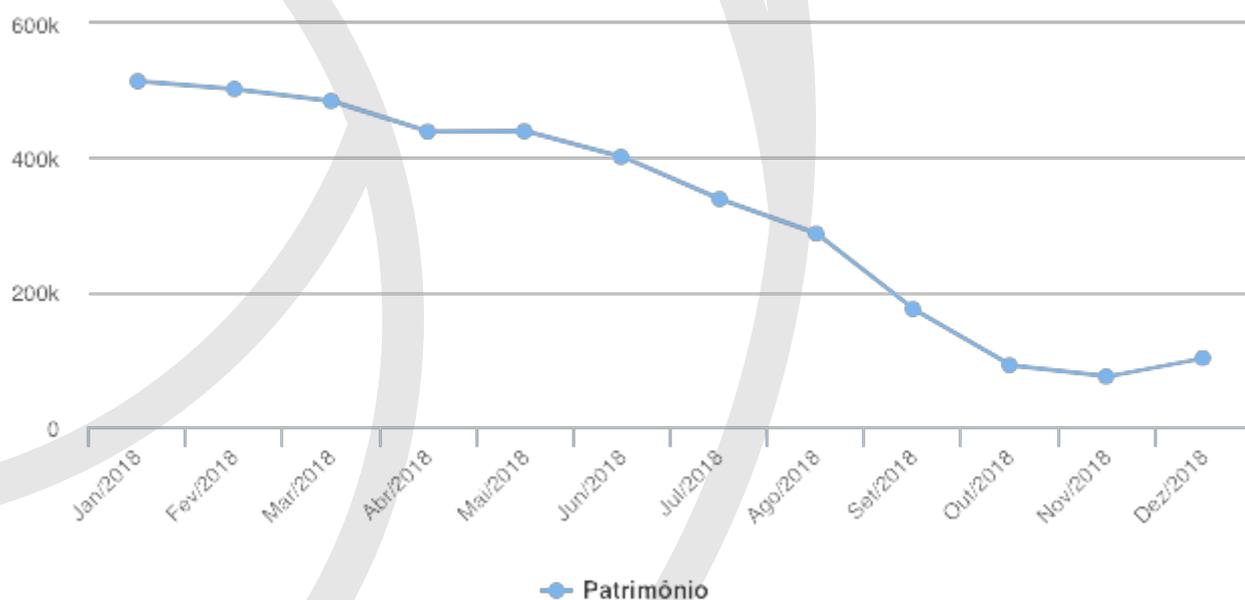
2.3 Investimentos por Instituição

Instituição Financeira	Saldo em 30/11/2018	Saldo em 31/12/2018	Rentabilidade
Banco do Brasil S.A.	R\$52.544,62	R\$100.327,56	0,53%
Caixa Econômica Federal	R\$22.130,44	R\$1.756,76	0,54%
	R\$74.675,07	R\$102.084,32	

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	0,41%	5,29%	2,60%	5,29%	R\$1.311.350.712,25	28/04/2011	1,00%	0,00%	R\$1.000,00
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	0,54%	6,81%	3,74%	6,81%	R\$17.632.380.675,60	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%	1,72%	R\$1.756,76
- CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	100,00%	1,72%	R\$1.756,76
Art. 7º - Inciso IV - até 30% em Renda Fixa	30,00%	98,28%	R\$100.327,56
- BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA FLU	20,00%	98,28%	R\$100.327,56
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\$102.084,32

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%	1,72%
- CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	0,00%	100,00%	1,72%
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%	98,28%
- BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTA	0,00%	30,00%	98,28%
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. IBOVESA, 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%
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%

Artigo/Fundo	Mínimo	Máximo	Alocado
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	SAFRA IMA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMEN	2,15%	14,48%	13,83%	14,48%	28,61%
2	WESTERN ASSET IMA B5 ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	2,12%	11,76%	9,34%	11,76%	27,54%
3	BANESTES PREVIDENCIARIO - RENDA FIXA	2,11%	13,43%	15,42%	13,43%	26,93%
4	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE I	2,07%	16,64%	19,51%	16,64%	30,19%
5	CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	1,85%	12,30%	10,10%	12,30%	30,44%
6	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,84%	15,14%	16,04%	15,14%	29,14%
7	FI CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF	1,80%	6,10%	6,71%	8,74%	13,92%
8	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA	1,80%	11,38%	9,41%	16,58%	13,87%
9	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 VI TITULOS PUBLICOS REND	1,80%	6,01%	6,61%	6,01%	13,87%
10	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RENDA	1,80%	6,00%	6,60%	6,00%	13,87%
50	CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	0,54%	6,81%	3,74%	6,81%	18,48%

Art. 7º III

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
1	BRS IMA-B ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS - RENDA FIXA	2,65%	3,30%		3,30%	10,68%
2	BANESTES INSTITUCIONAL - RENDA FIXA	2,25%	11,37%	13,20%	11,37%	25,09%
3	SAFRA IMA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	2,19%	15,03%	14,10%	15,03%	29,83%
4	BRDESCO INSTITUCIONAL FIC DE FI RF IMA B 5+	1,85%	15,04%	15,94%	15,04%	29,30%
5	BNP PARIBAS INFLAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE	1,74%	12,69%	12,15%	12,69%	26,80%
6	UNIBANCO INDICE DE PRECOS FI RENDA FIXA	1,73%	12,65%	11,58%	12,65%	26,45%
7	BRDESCO FI RF IMA B	1,70%	12,86%	11,90%	12,86%	27,50%
8	SICREDI - FUNDO DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IMA-B L	1,68%	13,14%	11,78%	13,14%	27,10%
9	SANTANDER FIC DE FI IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	1,64%	12,48%	11,49%	12,48%	26,32%
10	CAIXA FIC NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	1,63%	12,94%	11,66%	12,94%	26,90%

Art. 7º IV

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
1	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FUNDO DE INV	1,91%	11,28%	9,33%	11,28%	26,36%
2	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V FUNDO DE IN	1,90%	19,21%	13,24%	19,21%	29,91%
3	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI	1,63%	10,60%	8,41%	10,60%	26,02%
4	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	1,53%	17,68%	11,80%	17,68%	28,21%
5	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	1,51%	8,22%	4,19%	8,22%	22,15%
6	UNIBANCO RENDA FIXA LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO	1,45%	9,66%	7,65%	9,66%	25,09%
7	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	1,40%	17,99%	11,96%	17,99%	28,97%
8	BTG PACTUAL IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	1,35%	9,63%	6,79%	9,63%	23,10%
9	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RENDA FIXA	1,33%	7,82%	5,24%	7,82%	19,91%
10	QUEST YIELD FIC DE FI RENDA FIXA LONGO PRAZO	0,73%	5,76%	3,54%	5,76%	18,29%
47	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTA	0,41%	5,29%	2,60%	5,29%	14,62%

Art. 7º VI

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
1	BANRISUL PREVIDENCIA IPCA 2030 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	0,37%	4,41%	1,96%	4,41%	7,69%
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					
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	FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL 3SEN					
2	SUL INVEST FIDC - MULTISSETORIAL					
3	FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR					
4	RED FDO DE INVEST EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSETORIAL LP					
5	FIDC DA COMPANHIA ESTADUAL DE ÁGUAS E ESGOTOS - CEDAE					
6	FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER					
7	FDO INV DIREITOS CREDIT BCSUL VERAX MULTICRED 4SERIE					
8	INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC - Série B					
9	FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS CASAN SANEAMENTO					
10	FIDC MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA - SENIOR					

Art. 7º VII, "b"

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
1	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA XVI RENDA FIXA CRÉDITO P	1,17%	7,73%	5,83%	7,73%	17,88%
2	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FUNDO DE INVESTIM	1,10%	10,97%	7,68%	10,97%	27,52%
3	SANTANDER FI MASTER RENDA FIXA CREDITO PRIVADO LONGO PRAZO	0,52%	6,39%	3,17%	6,39%	17,44%
4	SAFRA CAPITAL MARKET PREMIUM DI CREDITO PRIVADO FIC FI REFERENCI	0,51%	6,56%	3,22%	6,56%	17,42%
5	BTG PACTUAL YIELD DI FI RENDA FIXA REFERENCIADO CRÉDITO PRIVADO	0,50%	6,51%	3,19%	6,51%	17,47%
6	SAFRA CAPITAL MARKET - FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CRÉDITO	0,49%	6,36%	3,11%	6,36%	16,99%
7	SAFRA CAPITAL MARKET INSTITUCIONAL DI FUNDO DE INVESTIMENTO EM C	0,48%	6,19%	3,04%	6,19%	16,61%
8	SANTOS CREDIT MASTER FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CRÉDITO PR	0,33%		37,37%		-42,54%
9	SECURITY FI REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	0,32%	-18,76%	-19,92%	-18,76%	-15,07%
10	PIATÁ FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO PREVIDENCIAR	-0,20%	-26,41%	-0,88%	-26,41%	-46,71%

Renda Variável

Art. 8º I

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
1	BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES INSTITUCIONAL IBRX ATIVO	0,20%	20,94%	22,26%	20,94%	54,50%
2	ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS	0,06%	16,10%	20,55%	16,10%	47,10%
3	HSBC FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES IBOVESPA VALUATION	-0,23%	20,81%	20,11%	20,81%	60,85%
4	BNP PARIBAS ACE IBRX FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDO DE	-0,73%	9,53%	20,02%	9,53%	35,04%
5	SANTANDER FI IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL AÇÕES	-0,90%	13,15%	19,82%	13,15%	43,91%
6	DAYCOVAL DIVIDENDOS IBOVESPA FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	-1,21%	19,82%	21,33%	19,82%	51,71%
7	BB AÇÕES IBRX INDEXADO FICFI	-1,43%	12,72%	20,17%	12,72%	40,28%
8	BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	-1,74%	15,06%	20,91%	15,06%	45,40%
9	FI EM AÇÕES CAIXA BRASIL IBOVESPA	-1,75%	14,52%	20,48%	14,52%	44,15%
10	BRADESCO H FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES IBOVESPA	-1,82%	13,12%	19,98%	13,12%	39,84%

Art. 8º II

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
1	ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVA11					

Art. 8º III

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
1	CAIXA FIC ACOES VALOR SMALL CAP RPPS	4,88%	15,62%	23,97%	15,62%	53,55%
2	BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES SMALL CAP PLUS	4,84%	23,60%	25,29%	23,60%	75,41%
3	QUEST SMALL CAPS FIC DE FIA	4,70%	26,44%	22,04%	26,44%	78,14%
4	BB AÇÕES BB FUNDO DE INVESTIMENTO	4,29%	50,11%	64,62%	50,11%	72,63%
5	BNP PARIBAS SMALL CAPS FUNDO DE INVESTIMENTO AÇÕES	3,67%	0,63%	13,97%	0,63%	45,85%
6	ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES PHOENIX FI	3,67%	26,02%	23,04%	26,02%	68,49%
7	JMALUCELLI SMALL CAPS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	3,31%	10,69%	22,77%	10,69%	66,49%
8	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	3,23%	12,74%	23,32%	15,37%	32,58%
9	ITAÚ SMALL CAP VALUATION FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	3,01%	11,99%	21,63%	11,99%	54,08%
10	GUEPARDO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS	2,97%	-10,57%	28,01%	-10,57%	-11,48%

Art. 8º IV

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
1	BRS PARTICIPAÇÕES FIC DE FI MULTIMERCADO CURTO PRAZO	11,70%	-8,54%	-7,36%	-8,54%	3,24%
2	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA OURO MULTIMERCADO LONGO PRAZO	5,33%	-2,07%	2,41%	-2,07%	16,10%
3	LEME FIC DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,55%	-94,76%	-94,92%	-94,76%	-94,11%
4	GERAÇÃO FUTURO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVES	1,16%	8,34%	4,36%	8,34%	19,59%
5	VOTORANTIM ATUARIAL MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVEST	1,02%	10,23%	5,81%	10,23%	24,87%
6	GERAÇÃO FUTURO LIQUIDEZ TOP FIC MULTIMERCADO	1,01%	7,39%	3,83%	7,39%	18,05%
7	CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO	0,96%	9,37%	7,14%	9,37%	21,77%
8	PERFIN LONG SHORT 15 FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE	0,82%	9,86%	7,47%	9,86%	24,65%
9	ITAÚ INSTITUCIONAL MULTIMERCADO JUROS E MOEDAS FI	0,68%	7,02%	3,62%	7,02%	16,71%
10	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL MULTIMERCADO	0,67%	5,73%	3,20%	5,73%	16,44%

Art. 8º V

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
1	BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE					
2	FOCO CONQUEST FIP					
3	FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES LSH					
4	FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES CAIXA INCORPORACAO IMOBIL					
5	FUNDO BRASIL DE INTERNACIONALIZAÇÃO DE EMPRESAS FIP II					
6	VIAJA BRASIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES					
7	W7 FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES					
8	PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FIC em FIP					
9	INFRA SANEAMENTO - FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES					
10	NORDESTE III FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES					

Art. 8º VI

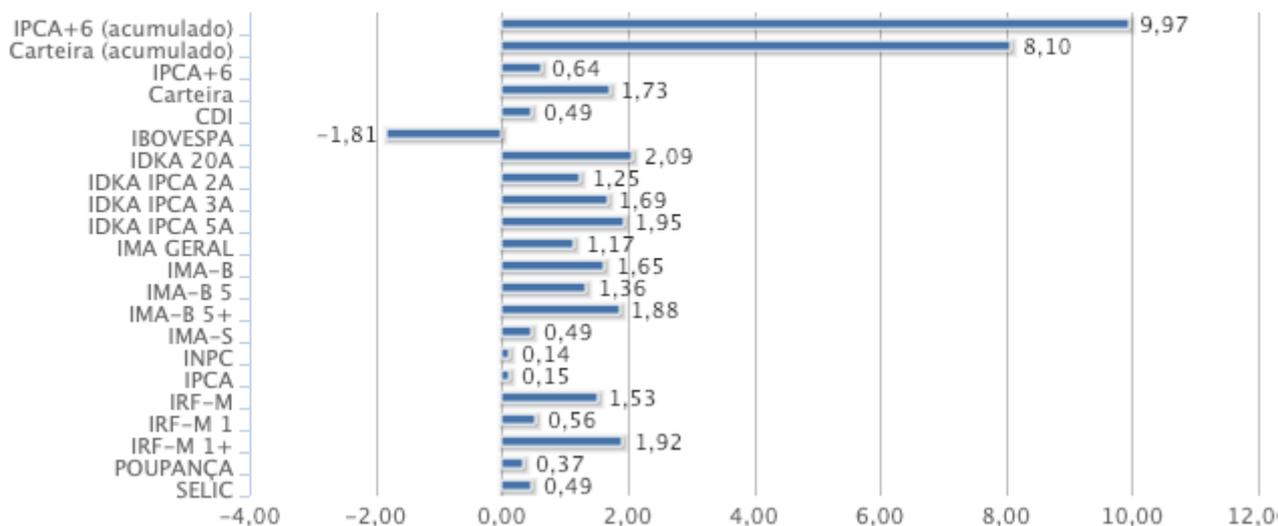
	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
1	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FI	2,42%	6,91%	9,88%	7,61%	-0,77%
2	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO BR HOTÉIS - FII					
3	HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO					
4	BANRISUL NOVAS FRONTEIRAS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FI					
5	AQUILLA RENDA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO					
6	KINEA II REAL ESTATE EQUITY FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO					
7	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO AGENCIAS CAIXA - FII					
8	BB PROGRESSIVO II FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII					
9	BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO					
10	AQUILLA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO					

5. CONSIDERAÇÕES FINAIS

Com valores tão baixos apresentados pelo IPCA, é mais fácil aos RPPS superar a meta atuarial. Com o fechamento do ano, os RPPS podem avaliar os resultados para apresentar como evoluíram neste ano de 2018, e especificamente no mês de dezembro, com os dados abaixo.

O cálculo da TMA (representada pelo a.a.) foi de 0,64%, porém o CORONEL PREV obteve uma rentabilidade agregada de sua carteira de 1,73%, superando com folga o percentual necessário.

Rentabilidade dos indicadores e da Carteira



Resumo dos principais indicadores

Na situação financeira, o CORONEL PREV obteve rendimento de R\$ 426,17 neste mês, e teve ainda uma sobra de capital previdenciário no valor de R\$ 26.983,09, sobra esta já investida no mercado financeiro. O saldo em conta corrente foi de R\$ 59.377,18.

Um ano atípico onde as eleições foram o ápice da instabilidade, saímos mais esperançosos. As mudanças desejadas estão mais claras, e resta ao povo brasileiro a confiança no eleito, e a colheita futura dos apertos que serão sentidos agora. Não será fácil, mas temos o que é preciso. Povo aguerrido que sempre está pronto para um novo tempo.

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 / 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, 29 de Janeiro de 2019

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