

FUNDO DE PREVIDENCIA SOCIAL DO
MUNICIPIO DE CORONEL JOAO PESSOA

Relatório de
Investimentos
CORONEL PREV

Junho / 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
IPCA foi de 1,26% em junho	2
1.2 Cenário Brasileiro	2
Mais um ano perdido?	2
1.3 Cenário Internacional	3
1.4 Bolsa	3
1.5 Projeções	4
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 foi de 1,26% em junho

O Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo (IPCA) de junho foi de 1,26%, a maior taxa para o mês desde 1995 (2,26%), e 0,86 ponto percentual (p.p.) acima do 0,40% registrado em maio. É a primeira vez desde janeiro de 2016 (1,27%) que o índice fica acima de 1,00%.

O acumulado no ano (2,60%) ficou acima do registrado em igual período do ano passado (1,18%). O acumulado nos últimos 12 meses subiu para 4,39%, enquanto havia registrado 2,86% nos 12 meses imediatamente anteriores. Em junho de 2017, a taxa atingiu -0,23%.

O **IPCA** é calculado pelo IBGE desde 1980, e se refere às famílias com rendimento monetário de 01 a 40 salários mínimos, qualquer que seja a fonte, e abrange dez regiões metropolitanas do país, além de Brasília e dos municípios de Goiânia, Campo Grande, Rio Branco, São Luís e Aracaju.

INPC cresce 1,43% em junho

O **Índice Nacional de Preços ao Consumidor - INPC** variou 1,43% em junho, a maior alta para o mês desde 1995 (2,18%), e ficou 1,00 p.p. acima da taxa de 0,43% de maio. É a primeira vez desde janeiro de 2016 (1,51%) que o índice ficou acima de 1,00%. O acumulado no ano ficou em 2,57%, acima do 1,12% registrado em igual período do ano passado. Nos últimos 12 meses, o índice ficou em 3,53%, bem acima do 1,76% dos 12 meses imediatamente anteriores. Em junho de 2017, a taxa atingiu -0,30%.

O **INPC** é calculado pelo IBGE desde 1979, se refere às famílias com rendimento monetário de 01 a 05 salários mínimos, sendo o chefe assalariado, e abrange dez regiões metropolitanas do país, além de Brasília e dos municípios de Goiânia, Campo Grande, Rio Branco, São Luís e Aracaju.

1.2 Cenário Brasileiro

Mais um ano perdido?

Há pouco a fazer para salvar a economia brasileira em 2018, e o futuro depende muito das eleições presidenciais deste ano, disseram economistas em debate na noite do dia 5 de junho de 2018.

Os participantes apontaram o desequilíbrio nas contas públicas como um dos principais problemas atuais, divergiram em parte nas soluções para o rombo ---que passam por elevar receitas e cortar custos--- e defenderam a urgência de uma reforma na Previdência.

Também manifestaram preocupação com a possibilidade de um candidato extremista vencer a eleição para presidente.

“A saída populista recorre à inflação para mascarar o conflito pelos recursos do Tesouro, que é normal na sociedade e precisa ser mediado de forma clara pelo Congresso. O populista prefere evitar esse conflito distributivo, e a inflação, uma vez que atinge determinado patamar, se descontrola. O custo para baixar fica muito alto”, afirmou um dos economistas participantes do evento.

Provavelmente, a principal perda ocorrida esse ano tenha sido a da confiança.

Assim como colocamos quando ocorreu a mudança de governo e equipe econômica, há dois anos, o aumento da confiança pode ser a mola propulsora para o próprio crescimento da economia. Da mesma forma, a falta de confiança leva pessoas e investidores a se retrair. Com um governo combalido e um novo ciclo prestes a iniciar, é normal que investimentos sejam

adiados até que haja maior definição sobre a política econômica do país.

Entretanto, essa situação tem prazo de validade. Teremos eleição em outubro e, a partir daí, iniciaremos um novo ciclo. Entendemos como pouco provável que o próximo presidente se esquive dos problemas atuais, especialmente o fiscal, e que não há motivo para esse pessimismo exagerado.

1.3 Cenário Internacional

Exportações da China para os EUA desaceleram em junho, mostram dados oficiais

As exportações de produtos da China para os Estados Unidos tiveram alta de 3,8% em junho em relação a igual mês do ano passado, desacelerando bruscamente em relação a um avanço médio de 13,6% na comparação anual de cada um dos primeiros cinco meses de 2018, revelam dados denominados em yuan divulgados antecipadamente pela Administração Geral Alfandegária do país asiático, já que as crescentes tensões comerciais com os Estados Unidos alimentam preocupações sobre uma desaceleração na segunda maior economia do mundo.

Na consolidado de janeiro a junho deste ano, as vendas de Pequim a Washington cresceram 5,4% ante igual intervalo em 2017, enquanto a comparação deste período com os primeiros seis meses de 2016 mostra ganho de 19,3%.

A economia da China já sentiu o aperto de uma ofensiva de vários anos sobre empréstimos mais arriscados, que elevou os custos de empréstimos corporativos, promovendo o banco central a injetar mais dinheiro reduzindo as exigências de reserva para os credores.

Economia dos EUA cria 231 mil postos de trabalho em junho

A economia dos Estados Unidos criou 231 mil postos de trabalho em junho, informou o Departamento do Trabalho nesta sexta-feira (6). O número é superior aos 195 mil esperados pelo mercado, segundo o site Briefing.com. Em maio, as vagas criadas ficaram em 244 mil.

A taxa de desemprego subiu para 4%, acima do estimado (3,8%) e alcançado em maio (3,8%). Os ganhos médios por hora subiram 0,2%, em junho, após o aumento de 0,3% em maio. O mercado esperava um crescimento de 0,3%.

1.4 Bolsa

Ibovespa tem queda de 5,2%

O principal índice acionário da B3 terminou o pregão em alta nesta sexta-feira (29), mas teve queda de 4,76% no primeiro semestre de 2018 - o pior resultado para o período desde 2013. Nesta sexta, o Ibovespa subiu 1,39%, aos 72.762 pontos. Na última semana de junho, o índice subiu 3%, mas mesmo assim terminou o mês em queda de 5,2%.

O movimento da bolsa nos últimos acompanha o cenário externo, com investidores de olho no rumo da taxa de juros dos Estados Unidos. Além disso, há temores sobre uma guerra comercial iniciada entre os norte-americanos e a China.

No cenário interno, pesam ainda as incertezas do ambiente interno, em meio a incertezas sobre o cenário eleitoral em outubro. Investidores seguem atentos à divulgação de pesquisas de intenção de votos, de olho nas chances de candidatos

que seriam mais comprometidos com reformas econômicas que os agentes financeiros.

Além disso, a greve dos caminhoneiros também impactou os mercados financeiros, com revisões de estimativas para o crescimento da economia e outros indicadores.

1.5 Projeções

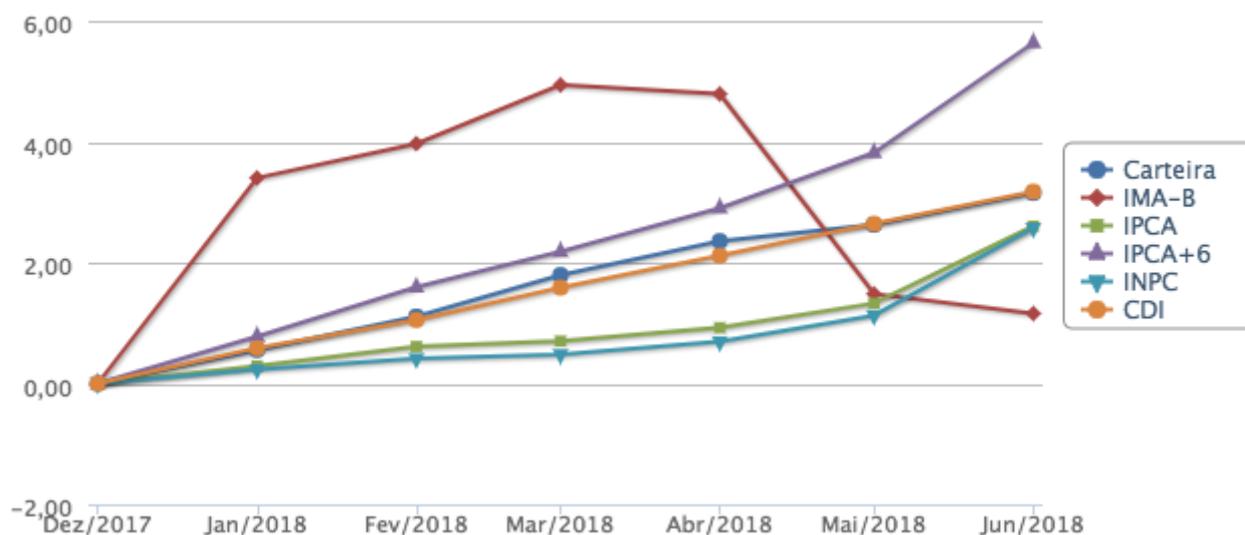
Mercado eleva projeção para inflação neste ano pela 8ª vez seguida

A mediana das projeções dos economistas do mercado para a inflação oficial em 2018 subiu de 4,03% para 4,17%, conforme a pesquisa semanal Focus, divulgada nesta segunda-feira pelo Banco Central (BC). Foi a oitava elevação consecutiva para a estimativa.

No caso de 2019, a previsão para o aumento no Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo (IPCA) permaneceu em 4,10%. Para os próximos 12 meses, a estimativa saiu de 4,02% para 3,80% de avanço entre uma semana e outra.

Entre os economistas que mais acertam as previsões, os chamados Top 5, de médio prazo, a mediana para a inflação de 2018 subiu de 3,83% para 4,10% e se manteve em 4% para 2019.

1.6 Indicadores Financeiros



2. ANÁLISE DA CARTEIRA

2.1 Composição da Carteira

Fundo de Investimento	Saldo em 30/05/2018	Saldo em 29/06/2018	Rentabilidade
CAIXA FI BRASIL DI LONGO PRAZO	R\$19.577,00	R\$11.482,00	0,50%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTA	R\$96.429,00	R\$57.399,00	0,43%
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	R\$150.288,00	R\$118.608,00	0,50%
BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS FIC	R\$173.042,00	R\$213.757,00	0,50%
	R\$439.336,00	R\$401.246,00	

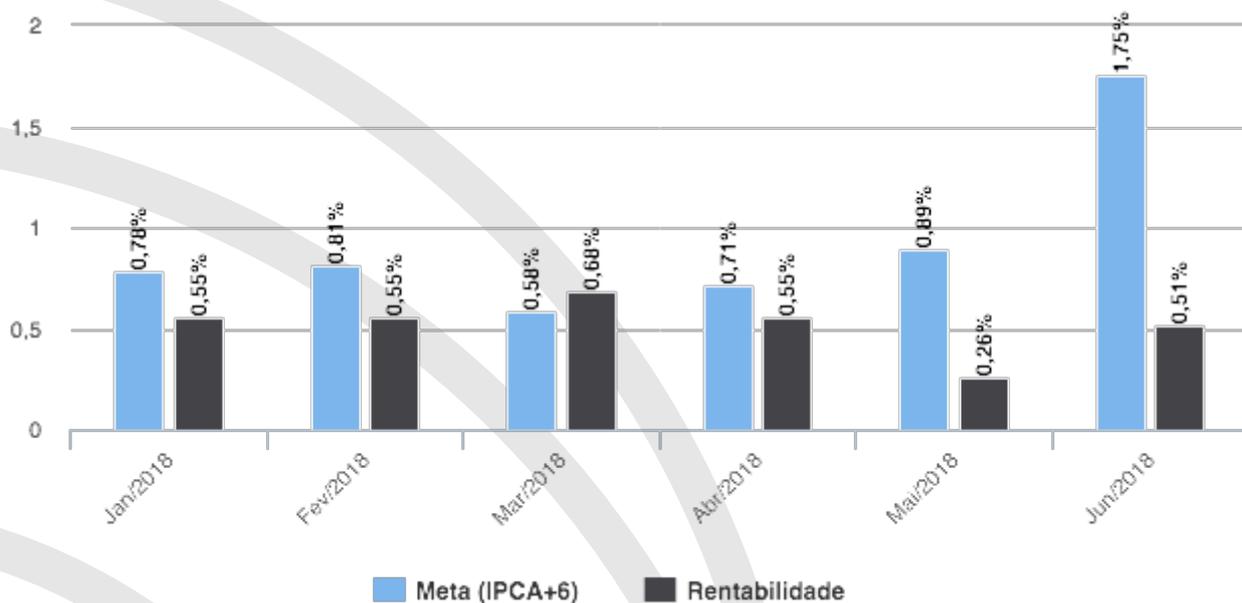
2.2 Investimentos por Segmento

Segmento	Saldo em 30/05/2018	Saldo em 29/06/2018	Rentabilidade
Renda Fixa	R\$419.759,46	R\$389.764,39	0,51%
Renda Fixa Referenciado	R\$19.576,51	R\$11.481,83	0,50%
	R\$439.335,97	R\$401.246,22	

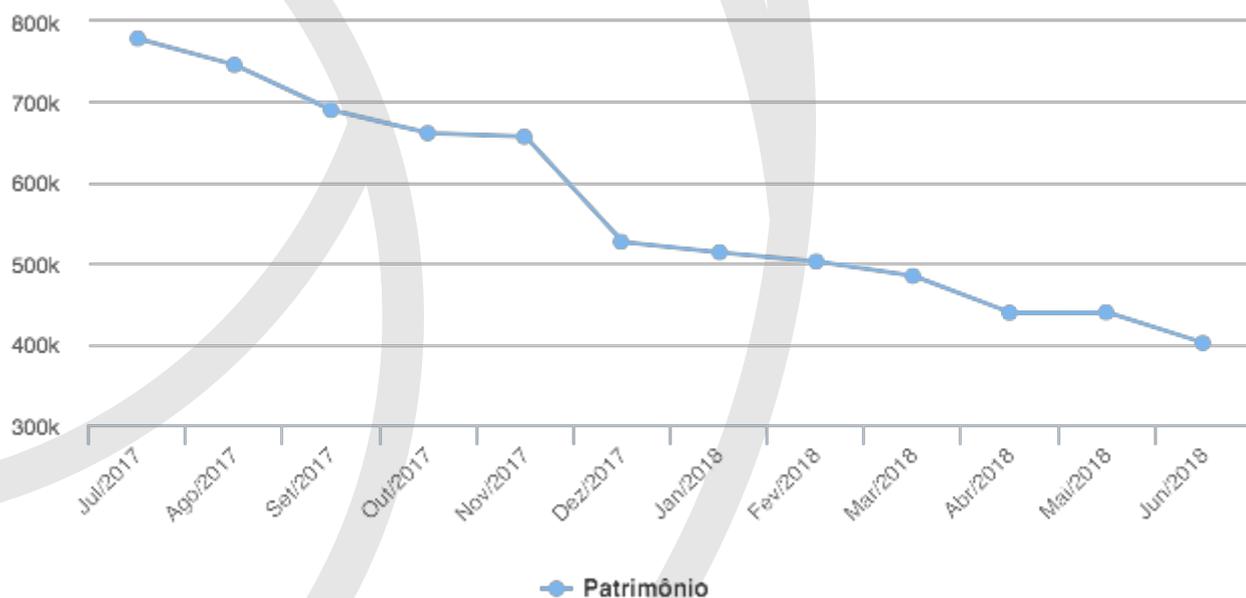
2.3 Investimentos por Instituição

Instituição Financeira	Saldo em 30/05/2018	Saldo em 29/06/2018	Rentabilidade
Banco do Brasil S.A.	R\$269.471,44	R\$271.156,37	0,47%
Caixa Econômica Federal	R\$169.864,53	R\$130.089,85	0,59%
	R\$439.335,97	R\$401.246,22	

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	0,43%	2,62%	2,62%	6,26%	R\$1.329.515.506,11	28/04/2011	1,00%	0,00%	R\$1.000,00
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS FIC	0,50%	2,94%	2,94%	7,62%	R\$11.531.274.406,78	08/12/2009	0,10%	0,00%	R\$1,00
CAIXA FI BRASIL DI LONGO PRAZO	0,50%	3,07%	3,07%	7,25%	R\$6.125.300.854,98	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	0,50%	2,95%	2,95%	7,65%	R\$15.782.089.023,36	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%	82,83%	R\$332.365,39
- BB PREVIDENCIARIO RF IRF-M 1 TP	100,00%	53,27%	R\$213.757,37
- CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	100,00%	29,56%	R\$118.608,02
Art. 7º - Inciso IV - até 30% em Renda Fixa	30,00%	17,17%	R\$68.880,83
- BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA FLU	20,00%	14,31%	R\$57.399,00
- CAIXA FI BRASIL DI LP	20,00%	2,86%	R\$11.481,83
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\$401.246,22

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%	82,83%
- BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS FIC	0,00%	100,00%	53,27%
- CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	0,00%	100,00%	29,56%
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%	17,17%
- CAIXA FI BRASIL DI LONGO PRAZO	0,00%	30,00%	2,86%
- BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTA	0,00%	30,00%	14,31%
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	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2018 II TP RF	1,13%	4,19%	4,19%	11,59%	8,69%
2	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2018 IV TÍTULOS PÚBLICOS REND	1,13%	4,19%	4,19%	11,47%	8,87%
3	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2018 III TÍTULOS PÚBLICOS REN	1,13%	1,49%	1,49%	3,30%	8,86%
4	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS XII FUNDO DE INVES	1,13%	4,27%	4,27%	9,07%	
5	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IX FI	1,12%	4,25%	4,25%	9,04%	21,21%
6	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI	0,63%	3,95%	3,95%	9,99%	23,19%
7	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII FUNDO DE INVES	0,58%	3,59%	3,59%	9,94%	22,90%
8	BANRISUL FOCO IRF-M 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	0,52%	2,96%	2,96%	7,65%	21,85%
9	BRADERCO FI RF IRF M 1 TITULOS PUBLICOS	0,50%	2,94%	2,94%	7,60%	21,84%
10	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS FIC	0,50%	2,94%	2,94%	7,62%	21,76%
11	CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	0,50%	2,95%	2,95%	7,65%	21,91%

Art. 7º III

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
1	BRADERCO INSTITUCIONAL FI RF B VÉRTICE 2019	0,80%	0,64%	0,64%	4,29%	7,58%
2	BRA1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	0,78%	6,91%	6,91%	20,45%	-0,45%
3	BRADERCO FI RENDA FIXA IRF M 1 **Descontinuado 02/07/2018	0,50%	2,94%	2,94%	7,60%	21,87%
4	FUNDO DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1	0,49%	2,97%	2,97%	7,70%	21,94%
5	DAYCOVAL PREVIDENCIÁRIO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IRFM1	0,46%	2,78%	2,78%	7,27%	21,06%
6	VOTORANTIM INFLATION RENDA FIXA FIC de FI	0,45%	2,48%	2,48%	9,43%	21,61%
7	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVEST	0,43%	2,70%	2,70%	9,72%	22,34%
8	BRADERCO INSTITUCIONAL FIC DE FI RENDA FIXA IMA-B 5	0,38%	2,59%	2,59%	9,73%	22,45%
9	LME REC IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO EM RENDA FIXA	0,36%	-0,70%	-0,70%	0,34%	-22,16%

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
10	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	0,16%	2,40%	2,40%	8,46%	23,83%

Art. 7º IV

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
1	MULTINVEST INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IRF-M1	3,22%	6,05%	6,05%	13,19%	25,53%
2	BANRISUL PREVIDENCIA IPCA 2024 FI RF LP	1,39%	2,43%	2,43%	6,69%	7,98%
3	BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA TITULOS PUBLICOS IPCA III FI	1,39%	5,38%	5,38%	10,08%	21,09%
4	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA	1,38%	2,37%	2,37%	3,77%	7,22%
5	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2018 I TP RF	1,38%	5,18%	5,18%	12,19%	7,64%
6	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA	1,38%	2,43%	2,43%	3,88%	7,55%
7	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS REN	1,38%	2,39%	2,39%	3,81%	7,38%
8	BTG PACTUAL FI NTN-B RF	1,37%	2,37%	2,37%	3,79%	7,71%
9	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA V FUNDO DE IN	1,37%	5,27%	5,27%	9,80%	20,39%
10	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	1,37%	5,26%	5,26%	9,78%	20,34%
29	CAIXA FI BRASIL DI LONGO PRAZO	0,50%	3,07%	3,07%	7,25%	21,10%
53	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTA	0,43%	2,62%	2,62%	6,26%	18,97%

Art. 7º VI

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
1	BANRISUL PREVIDENCIA IPCA 2030 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	1,40%	2,40%	2,40%	3,91%	7,85%
2	FIDC DA INDÚSTRIA EXODUS INSTITUCIONAL - SENIOR	0,62%	3,82%	3,82%		
3	FIDC INCENTIVO MULTISSETORIAL II	0,00%	58,94%	58,94%		-58,91%
4	BBIF MASTER FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS LP	-0,35%	2,90%	2,90%		-84,77%
5	LME REC MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS C	-3,55%	-17,23%	-17,23%		-97,51%
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	FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS CASAN SANEAMENTO	0,94%	6,54%	6,54%		-15,32%
2	INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC - Série B	0,00%	0,00%	0,00%		
3	SUL INVEST FIDC - MULTISSETORIAL					
4	FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER II SENIOR					
5	FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL 3SEN					
6	RED FDO DE INVEST EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSETORIAL LP					
7	FIDC DA COMPANHIA ESTADUAL DE ÁGUAS E ESGOTOS - CEDAE					
8	FDO INV DIREITOS CREDIT BCSUL VERAX MULTICRED 4SERIE					
9	FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER					
10	FIDC MULTISSETORIAL BVA ITÁLIA - SENIOR					

Art. 7º VII, "b"

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
1	SAFRA CAPITAL MARKET PREMIUM DI CREDITO PRIVADO FIC FI REFERENCI	0,52%	3,23%	3,23%	7,54%	21,77%
2	BTG PACTUAL YIELD DI FI RENDA FIXA REFERENCIADO CRÉDITO PRIVADO	0,51%	3,23%	3,23%	7,53%	21,87%
3	SAFRA CAPITAL MARKET - FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CRÉDITO	0,51%	3,15%	3,15%	7,36%	21,35%
4	SAFRA CAPITAL MARKET INSTITUCIONAL DI FUNDO DE INVESTIMENTO EM C	0,49%	3,06%	3,06%	7,17%	20,92%
5	SANTANDER FI MASTER RENDA FIXA CREDITO PRIVADO LONGO PRAZO	0,49%	3,11%	3,11%	7,51%	21,72%
6	SANTOS CREDIT MASTER FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CRÉDITO PR	0,38%			1,25%	-58,00%
7	SECURITY FI REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	0,25%	1,45%	1,45%	3,44%	9,62%
8	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA XVI RENDA FIXA CRÉDITO P	0,17%	1,80%	1,80%	5,90%	17,29%
9	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FUNDO DE INVESTIM	0,12%	3,06%	3,06%	10,84%	27,22%

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
10	INCENTIVO FUNDO DE INVESTIMENTO REFERENCIADO CDI CRÉDITO PRIVADO	-0,11%	-0,38%	-0,38%	38,93%	58,99%

Renda Variável

Art. 8º I

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
1	GERAÇÃO FUTURO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES PROGRAMADO IBOVESP	-2,99%	-4,73%	-4,73%	-0,01%	15,80%
2	HSBC FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES IBOVSPA VALUATION	-4,02%	0,58%	0,58%	28,57%	55,04%
3	DAYCOVAL DIVIDENDOS IBOVSPA FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	-4,34%	-1,24%	-1,24%	17,15%	43,75%
4	ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVSPA ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS	-4,59%	-3,69%	-3,69%	15,86%	36,62%
5	BRADERSCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES INSTITUCIONAL IBRX ATIVO	-4,79%	-1,08%	-1,08%	22,47%	47,28%
6	SANTANDER FI IBOVSPA ATIVO INSTITUCIONAL AÇÕES	-5,14%	-5,57%	-5,57%	15,04%	40,39%
7	BRADERSCO FIA IBOVSPA PLUS	-5,21%	-4,84%	-4,84%	16,29%	41,93%
8	FI EM AÇÕES CAIXA BRASIL IBOVSPA	-5,23%	-4,95%	-4,95%	16,14%	40,80%
9	BB AÇÕES IBRX INDEXADO FICFI	-5,28%	-6,21%	-6,21%	13,31%	35,85%
10	BRADERSCO H FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES IBOVSPA	-5,32%	-5,72%	-5,72%	14,01%	35,92%

Art. 8º II

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
1	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA BRASIL ETF IBOVSPA	-5,20%	-4,95%	-4,95%	15,97%	40,88%
2	ISHARES IBOVSPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVA11					

Art. 8º III

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
1	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	4,06%	18,05%	18,05%	31,20%	59,49%
2	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA BDR NÍVEL I	3,98%	17,52%	17,52%	30,02%	56,64%
3	ROMA AÇÕES FI DE AÇÕES	-0,45%	-2,68%	-2,68%	-5,25%	-14,03%

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
4	BB TOP AÇÕES EXPORTAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO	-1,76%	13,47%	13,47%	43,92%	80,37%
5	BTG ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	-1,91%	-2,72%	-2,72%	15,29%	25,91%
6	CAIXA FI AÇÕES VALE DO RIO DOCE	-2,22%	23,27%	23,27%	71,80%	222,00%
7	XP INVESTOR 30 FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FIA	-2,29%	4,85%	4,85%	24,14%	
8	BB AÇÕES TECNOLOGIA FUNDO DE INVESTIMENTO	-2,36%	-3,65%	-3,65%	15,72%	36,94%
9	BB AÇÕES DIVIDENDOS MIDCAPS FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FU	-2,40%	-7,57%	-7,57%	3,88%	21,22%
10	EQUITAS SELECTION INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM QUOTAS	-2,47%	-4,06%	-4,06%	12,06%	40,58%

Art. 8º IV

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
1	BRS PARTICIPAÇÕES FIC DE FI MULTIMERCADO CURTO PRAZO	2,62%	-1,27%	-1,27%	12,70%	27,73%
2	TERCON FIC FIM MULTICRÉDITO CRÉDITO PRIVADO	1,48%	3,69%	3,69%	5,60%	
3	INFINITY EAGLE FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	1,39%	4,61%	4,61%	9,56%	41,52%
4	XP LONG SHORT FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST	1,25%	10,81%	10,81%	10,98%	24,16%
5	VOTORANTIM ATUARIAL MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVEST	0,84%	4,17%	4,17%	10,63%	25,96%
6	GERAÇÃO FUTURO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVES	0,72%	3,82%	3,82%	9,24%	22,14%
7	BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI MULTIMERCADO CRÉDITO	0,64%	3,66%	3,66%	8,47%	25,76%
8	GERAÇÃO FUTURO LIQUIDEZ TOP FIC MULTIMERCADO	0,62%	3,43%	3,43%	8,70%	20,68%
9	INFINITY INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	0,62%	3,51%	3,51%	8,31%	25,96%
10	ITAÚ INSTITUCIONAL MULTIMERCADO JUROS E MOEDAS FI	0,58%	3,28%	3,28%	7,49%	20,40%

Art. 8º V

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
1	FUNDO BRASIL DE INTERNACIONALIZAÇÃO DE EMPRESAS FIP II	9,08%	7,65%	7,65%		
2	FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES VENTURE BRASIL CENTRAL	5,65%	100,66%	100,66%		

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
3	ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA - FIP	-0,03%	-0,35%	-0,35%		-22,81%
4	ÁTICO FLORESTAL - FIP	-0,13%	-0,76%	-0,76%		-3,07%
5	FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPACOES CAIXA INCORPORACAO IMOBIL	-0,14%	-0,80%	-0,80%		
6	ÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO E	-0,15%	-0,90%	-0,90%		-3,58%
7	INFRA SANEAMENTO - FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES	-0,17%	-0,99%	-0,99%		-0,89%
8	W7 FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES	-0,17%	11,92%	11,92%		
9	BRB BLUEJAY FIP IMOBILIÁRIO MULTISTRATEGIA PARANÁ I	-0,32%	-2,30%	-2,30%		-65,83%
10	BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE					

Art. 8º VI

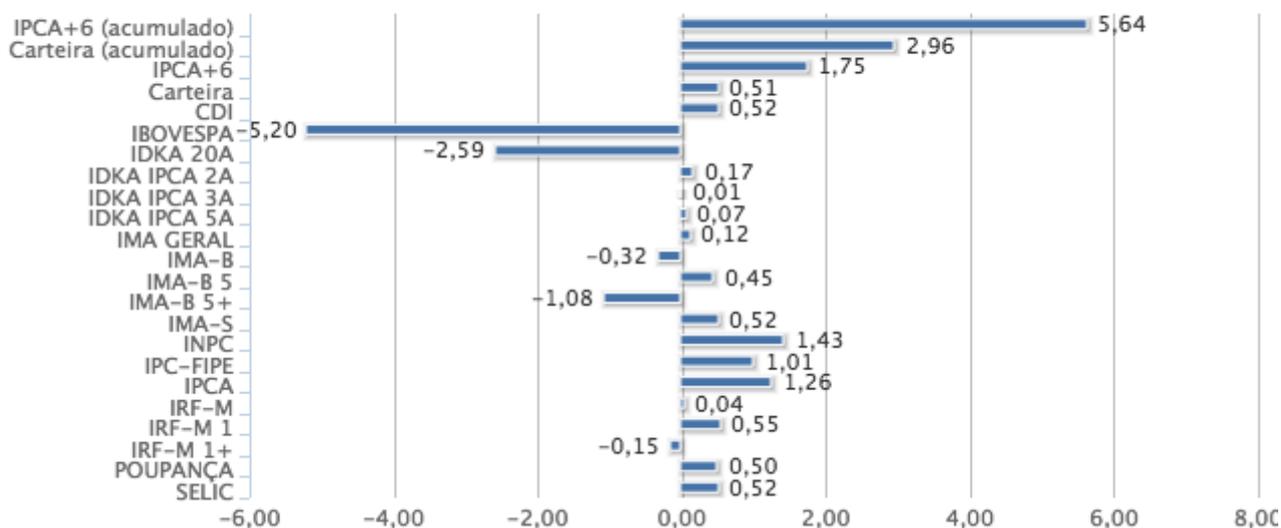
	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
1	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII SIA CORPORATE	0,21%	5,66%	5,66%		-15,81%
2	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO BR HOTÉIS - FII	-0,07%	9,04%	9,04%		
3	HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	-0,10%	0,14%	0,14%		-32,17%
4	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FI	-3,08%	-2,34%	-2,34%		
5	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO AGENCIAS CAIXA - FII	-7,68%	-11,78%	-11,78%		
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

A instabilidade econômica tem se refletido no IPCA. No mês de junho, com a maior taxa de inflação do ano, e dos últimos 12 meses, o impacto se dá nas baixas rentabilidades recebidas e o alto valor necessário para atingimento da meta mensal.

O cálculo da TMA (representada pelo IPCA+6 a.a.) foi de 1,75%, porém o CORONEL PREV obteve uma rentabilidade agregada de sua carteira de 0,51%, 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\$ 2.345,61 neste mês, e, os resgates superaram as aplicações em um valor de R\$ -40.435,61. O saldo em conta corrente foi de R\$ 398,85.

Este é um ano de sofrimento aos investidores. IBOVESPA no lado da renda variável e fundos mais alongados no lado da renda fixa amargam perdas em um ano que ainda está longe de acabar. IRF-M 1 e CDI estão entre os melhores, mas longe de atingir qualquer meta estipulada. É continuar a avaliação, mês a mês, dia a dia.

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: Junho / 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, 15 de Fevereiro 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