

FUNDO DE PREVIDENCIA SOCIAL DO
MUNICIPIO DE CORONEL JOAO PESSOA

Relatório de
Investimentos
CORONEL PREV

Agosto / 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 varia -0,09% em agosto	2
1.2 Cenário Brasileiro	2
1.3 Cenário Internacional	2
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"	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 -0,09% em agosto

O Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo (IPCA) de agosto variou - 0,09%, abaixo do resultado de julho (0,33%). Foi a menor taxa para um mês de agosto desde 1998, quando o IPCA registrou -0,51%. O acumulado no ano ficou em 2,85%, acima do 1,62% registrado em igual período de 2017. O acumulado dos últimos doze meses ficou em 4,19%, abaixo dos 4,48% dos 12 meses imediatamente anteriores. Em agosto de 2017, a taxa atingiu 0,19%.

INPC apresenta estabilidade em agosto, com taxa de 0,00%

O Índice Nacional de Preços ao Consumidor - INPC apresentou estabilidade na média de preços de julho para agosto, quando a taxa ficou em 0,00%. O acumulado no ano ficou em 2,83%, acima do 1,27% registrado em igual período do ano passado. Na ótica dos últimos doze meses, o índice ficou em 3,64%, acima dos 3,61% dos 12 meses imediatamente anteriores. Em agosto de 2017, a taxa foi de -0,03%.

1.2 Cenário Brasileiro

Economia perdeu ritmo de crescimento, diz IBGE

O IBGE revisou para baixo os dados do crescimento do país, mostrando um PIB (Produto Interno Bruto) mais fraco do que o que se acreditava com os dados disponíveis até então.

No primeiro trimestre do ano, em vez de um crescimento 0,4%, o PIB do período oscilou apenas 0,1% em relação ao quarto trimestre do ano passado.

Nos últimos três meses de 2017, em vez de uma expansão 0,2%, o PIB ficou no zero a zero.

Brasil registra saída de US\$ 4,25 bilhões no mês de agosto, diz Banco Central

A retirada de dólares da economia brasileira superou o ingresso de recursos em US\$ 4,250 bilhões no mês de agosto, informou o Banco Central nesta quarta-feira (5).

Essa foi a primeira saída de divisas do país desde março deste ano, ou seja, em cinco meses.

O ingresso de dólares se dá quando investidores enviam dinheiro ao Brasil para aplicações financeiras ou investimento em empresas, por exemplo.

O dólar sai quando esses investidores retiram recursos do Brasil e, normalmente, aplicam em outros países. Essas operações ocorrem por meio de remessas feitas por bancos contratados por esses investidores.

Porém, no acumulado deste ano, até o fim de agosto, o Banco Central informou que US\$ 24,178 bilhões entraram na economia brasileira.

1.3 Cenário Internacional

Entenda a turbulência econômica na Argentina e como isso pode afetar o Brasil

Uma queda de 8% no dia 29 e de 13% no dia 30 de agosto. Em dois dias, o peso argentino acumulou uma desvalorização histórica frente ao dólar. A turbulência financeira da Argentina gerou uma corrida às casas de câmbio para comprar dólares, fez com que o país firmasse acordo com o FMI (Fundo Monetário Internacional) para adiantar o repasse de um pacote de ajuda e virou assunto nos jornais dentro e fora do país.

Apesar de a situação do Brasil ser bem diferente (e mais sólida) que a do país vizinho, a economia brasileira também está vulnerável aos fatores que normalmente provocam a pressão cambial, como a elevação das taxas de juros nos Estados Unidos e na União Europeia, e os desequilíbrios macroeconômicos internos. Em 30 de agosto, a moeda norte-americana chegou a ser cotada a R\$ 4,2144 e forçou uma intervenção do Banco Central para conter a alta.

O lado positivo da crise, no entanto, para o Brasil e países da região, pode ser uma redistribuição de investidores que estavam apostando na Argentina. Crises anteriores mostraram que, quando a Argentina entra em dificuldade, países como o Paraguai e a Bolívia experimentam uma pequena injeção de investimentos.

Para isso, contudo, é preciso exibir a capacidade uma economia mais previsível e menos vulnerável, na avaliação de especialistas.

Apesar de a inflação brasileira estar controlada, a recente disparada do dólar em relação ao real tem potencial para gerar pressões inflacionárias no Brasil. Com o dólar alto, insumos, produtos e serviços ficam mais caros e essa diferença pode ser repassada ao consumidor.

No entanto, num cenário de baixo crescimento econômico e com o desemprego alto, como é o caso do Brasil, o repasse da alta do dólar para a inflação tende a ser pequeno. Além disso, a parcela em dólar da dívida brasileira é marginal, o país tem um volume expressivo de reservas internacionais e déficit relativamente pequeno em transações correntes (que contabiliza as trocas com o exterior) - ainda que, em julho, as transações correntes tenham sido deficitárias em US\$ 4,4 bilhões, após quatro meses de superávits, segundo o BC.

Tudo isso minimiza a vulnerabilidade do Brasil em relação aos efeitos adversos atrelados ao cenário externo mais turbulento e também às incertezas sobre o cenário eleitoral, fazendo com que as chances de o país viver uma crise como a da Argentina sejam muito pequenas.

1.4 Bolsa

Ibovespa perde 3,2% no acumulado de agosto

Em mais uma sessão volátil, o Ibovespa conseguiu terminar a sessão no campo positivo. A menor aversão ao risco no exterior e a expectativa em relação ao julgamento do registro de candidatura do ex-presidente Lula abriram espaço para um leve movimento de ajuste técnico, especialmente após as fortes quedas no penúltimo pregão do mês.

Apesar do desempenho negativo no acumulado do mês, o Ibovespa conseguiu manter-se em patamares relativamente altos, não perdendo muito terreno em meio à crescente tensão dos eleitores em relação às eleições -- o índice ainda está quase 7 mil pontos acima da mínima do ano, aos 69.814 pontos, registrada em 18 de junho.

O comportamento do Ibovespa em agosto chama a atenção quando comparado ao dólar, que acumulou alta de 8,49% no mesmo período e terminou o mês na faixa de R\$ 4,07. E a própria valorização da moeda americana foi um dos fatores que ajudou o índice a mostrar resiliência: o mercado acionário brasileiro tornou-se mais barato em dólares, atraindo investidores estrangeiros.

1.5 Projeções

Mercado reduz estimativa de inflação e crescimento da economia

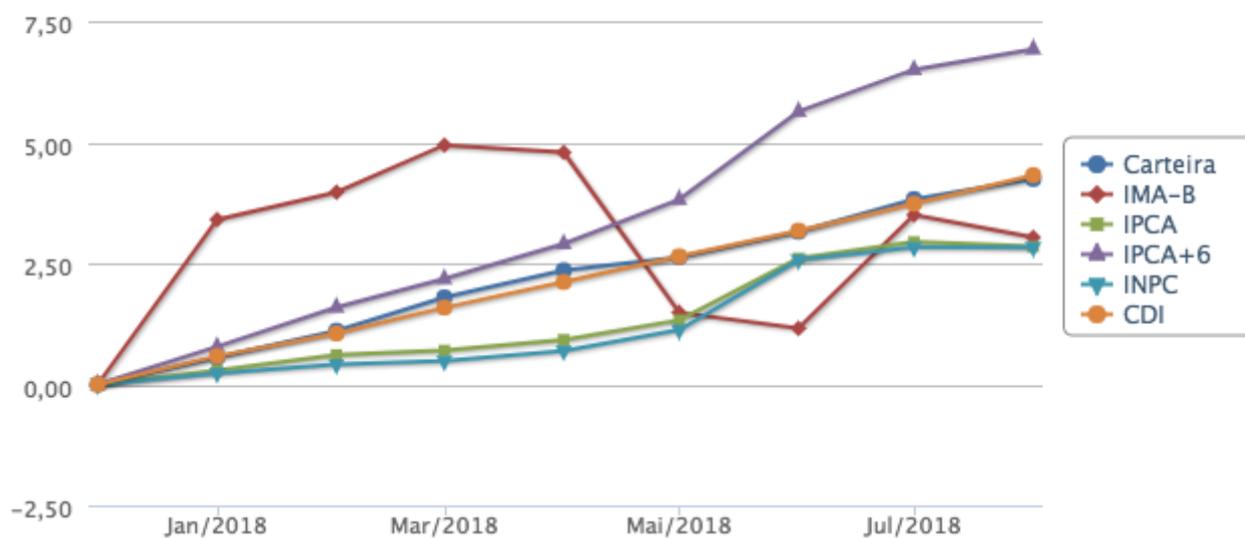
Instituições financeiras consultadas pelo Banco Central (BC) reduziram a estimativa de crescimento da economia e da inflação neste ano. A informação consta do *boletim Focus*, publicado semanalmente pelo BC, com projeções dessas instituições para os principais indicadores econômicos.

A estimativa para o Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo (IPCA) passou de 4,17% para 4,16%, neste ano. Para 2019, a projeção caiu de 4,12% para 4,11%. Para 2020 e 2021, a estimativa permanece em 4% e 3,92%, respectivamente.

Para 2018 e 2019, as estimativas estão abaixo do centro da meta que deve ser perseguida pelo BC neste ano, de 4,5%, com limite inferior de 3% e superior de 6%. Para 2019, a meta é 4,25%, com intervalo de tolerância entre 2,75% e 5,75%. Para 2020, a meta é 4% e 2021, 3,75%, com intervalo de tolerância de 1,5 ponto percentual para os dois anos (2,5% a 5,5% e 2,25% a 5,25%, respectivamente).

Para alcançar a meta de inflação, o BC usa como instrumento a taxa básica de juros, a Selic, atualmente em 6,5% ao ano.

1.6 Indicadores Financeiros



2. ANÁLISE DA CARTEIRA

2.1 Composição da Carteira

Fundo de Investimento	Saldo em 31/07/2018	Saldo em 31/08/2018	Rentabilidade
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTA	R\$6.936,00	R\$6.571,00	0,47%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS FIC	R\$22.922,00	R\$29.356,00	0,40%
CAIXA FI BRASIL DI LONGO PRAZO	R\$65.552,00	R\$55.514,00	0,56%
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	R\$243.124,00	R\$195.783,00	0,41%
	R\$338.534,00	R\$287.224,00	

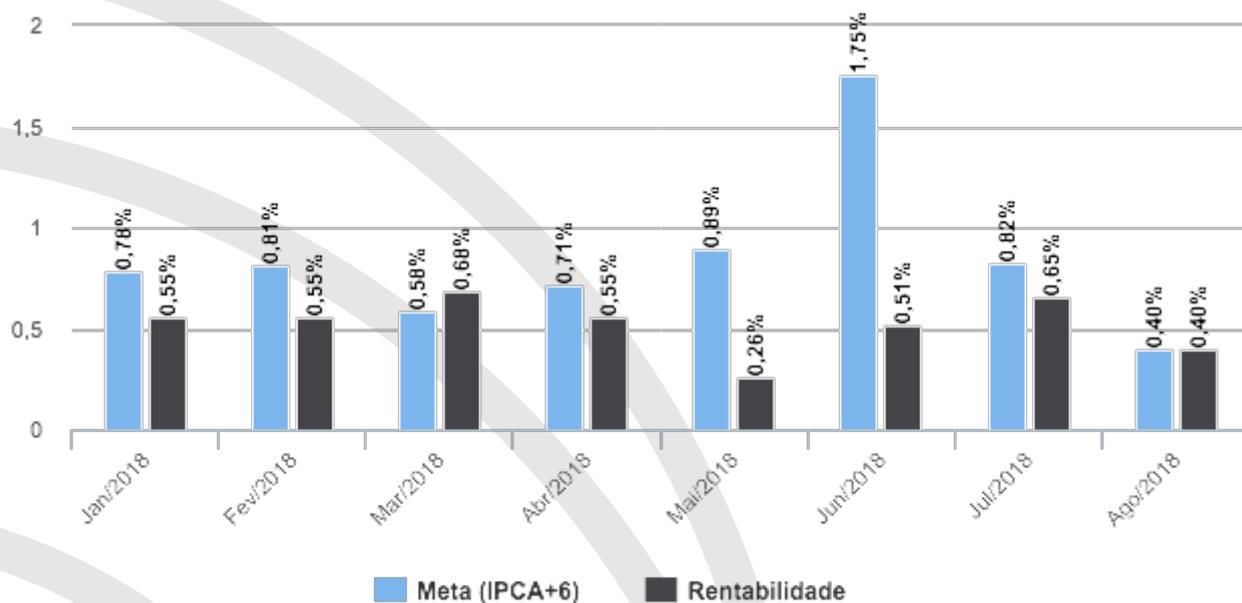
2.2 Investimentos por Segmento

Segmento	Saldo em 31/07/2018	Saldo em 31/08/2018	Rentabilidade
Renda Fixa	R\$272.982,69	R\$231.709,81	0,36%
Renda Fixa Referenciado	R\$65.551,64	R\$55.513,97	0,56%
	R\$338.534,33	R\$287.223,78	

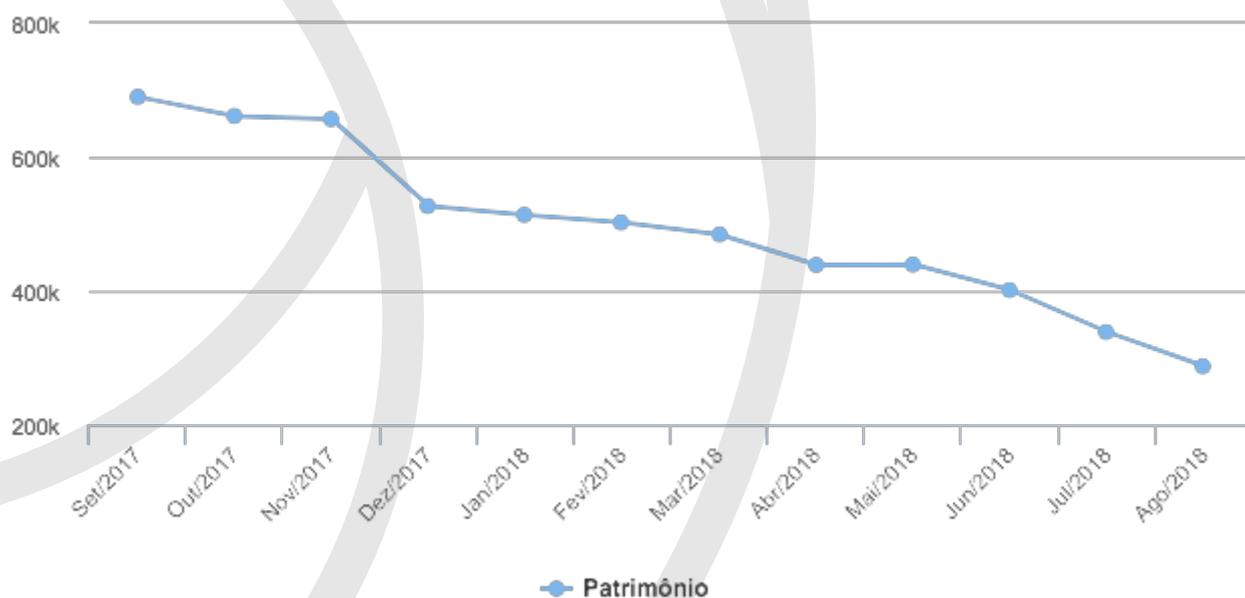
2.3 Investimentos por Instituição

Instituição Financeira	Saldo em 31/07/2018	Saldo em 31/08/2018	Rentabilidade
Banco do Brasil S.A.	R\$29.858,45	R\$35.926,79	0,42%
Caixa Econômica Federal	R\$308.675,88	R\$251.296,99	0,40%
	R\$338.534,33	R\$287.223,78	

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	0,47%	3,57%	2,67%	5,70%	R\$1.319.750.836,78	28/04/2011	1,00%	0,00%	R\$1.000,00
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS FIC	0,40%	4,04%	2,90%	6,64%	R\$11.721.992.360,51	08/12/2009	0,10%	0,00%	R\$1,00
CAIXA FI BRASIL DI LONGO PRAZO	0,56%	4,19%	3,15%	6,68%	R\$6.500.695.628,59	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	0,41%	4,08%	2,94%	6,70%	R\$16.430.774.110,32	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%	78,38%	R\$225.138,59
- BB PREVIDENCIARIO RF IRF-M 1 TP	100,00%	10,22%	R\$29.355,57
- CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	100,00%	68,16%	R\$195.783,02
Art. 7º - Inciso IV - até 30% em Renda Fixa	30,00%	21,62%	R\$62.085,20
- BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA FLU	20,00%	2,29%	R\$6.571,23
- CAIXA FI BRASIL DI LP	20,00%	19,33%	R\$55.513,97
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\$287.223,79

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%	78,38%
- BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS FIC	0,00%	100,00%	10,22%
- CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	0,00%	100,00%	68,16%
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%	21,62%
- CAIXA FI BRASIL DI LONGO PRAZO	0,00%	30,00%	19,33%
- BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTA	0,00%	30,00%	2,29%
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	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS XII FUNDO DE INVES	0,61%	5,43%	4,09%	7,63%	20,35%
2	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IX FI	0,61%	5,41%	4,08%	7,60%	20,32%
3	BANRISUL FOCO IRF-M 1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	0,42%	4,06%	2,92%	6,67%	20,46%
4	CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	0,41%	4,08%	2,94%	6,70%	20,53%
5	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 - FUNDO DE INVESTIMENTO	0,40%	4,01%	2,89%	6,61%	20,35%
6	BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS FIC	0,40%	4,04%	2,90%	6,64%	20,37%
7	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	0,38%	3,88%	2,79%	9,35%	20,03%
8	BRANDESCO FI RF IRF M 1 TITULOS PUBLICOS	0,38%	4,01%	2,88%	6,61%	20,42%
9	SUL AMÉRICA INFLATIE FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRA	0,21%	4,51%	-0,04%	5,69%	24,58%
10	SAFRA EXECUTIVE 2 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	0,19%	3,89%	2,63%	6,61%	20,90%

Art. 7º III

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
1	FUNDO DE INVESTIMENTO DIFERENCIAL RENDA FIXA LONGO PRAZO	1,19%	-32,18%	-33,44%	-30,77%	-22,03%
2	FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IPIRANGA	0,52%	3,89%	-0,75%	6,91%	8,85%
3	BRA1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	0,43%	8,85%	4,95%	365,28%	-0,54%
4	FUNDO DE INVESTIMENTO INSTITUCIONAL RENDA FIXA IRF-M 1	0,40%	4,09%	2,92%	6,75%	20,55%
5	DAYCOVAL PREVIDENCIARIO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IRFM1	0,38%	3,85%	2,79%	6,34%	19,70%
6	BRANDESCO INSTITUCIONAL FI RF B VÉRTICE 2019	0,36%	1,66%	0,54%	1,92%	6,43%
7	TERRA NOVA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA INSTITUCIONAL IMA-B	0,27%	2,04%	-0,05%	1,99%	9,83%
8	LME REC IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO EM RENDA FIXA	-0,11%	0,46%	-1,25%	1,60%	-23,01%
9	LMX IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	-0,12%	1,15%	-1,88%	3,43%	19,32%
10	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	-0,18%	3,58%	1,11%	6,03%	21,93%

Art. 7º IV

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
1	BTG PACTUAL FI NTN-B RF	0,73%	4,49%	2,74%	4,52%	7,76%
2	BRB FUNDO DE INVESTIMENTO EM RENDA FIXA 2023	0,71%	7,36%	5,58%	10,40%	20,12%
3	JMALUCELLI EXECUTIVO FUNDO DE INVESTIMENTO REFERENCIADO DI	0,62%	4,02%	3,04%	6,38%	18,83%
4	FI CAIXA MEGA RENDA FIXA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	0,56%	4,18%	3,13%	6,64%	19,51%
5	ITAÚ INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI - FUNDO DE INVESTIMENTO	0,56%	4,23%	3,16%	6,70%	19,56%
6	FIC DE FI CAIXA APORTE IMEDIATO 216 RENDA FIXA LP	0,56%	4,24%	3,17%	6,73%	19,54%
7	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FIXA	0,56%	4,19%	3,14%	6,69%	19,60%
8	CAIXA FI BRASIL DI LONGO PRAZO	0,56%	4,19%	3,15%	6,68%	19,56%
9	BTG PACTUAL MASTER CASH FUNDO DE INVESTIMENTO REFERENCIADO DI	0,56%	4,15%	3,11%	6,60%	19,37%
10	BB INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	0,56%	4,27%	3,19%	6,86%	20,05%
38	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTA	0,47%	3,57%	2,67%	5,70%	17,40%

Art. 7º VI

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
1	BANRISUL PREVIDENCIA IPCA 2030 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	-2,08%	1,64%	2,85%	4,71%	7,97%
2	ILLUMINATI FIDC					
3	QT IPCA FIDC JUROS REAL					
4	LME REC MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS C					
5	GFM FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTICRÉDITO					
6	MAXPREV FIQ FIDC MULTISSETORIAL					
7	FIDC DA INDÚSTRIA EXODUS INSTITUCIONAL - SENIOR					
8	BCSUL VERAX CPP 360 FIDC SENIOR					
9	FIC FIDC BRASIL PLUS SENIOR					
10	FIDC ABERTO CAIXA RPPS CONSIGNADO BMG					

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 CREDITARIOS 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	SAFRA CAPITAL MARKET PREMIUM DI CREDITO PRIVADO FIC FI REFERENCI	0,58%	4,41%	3,30%	6,96%	20,21%
2	SANTANDER FI MASTER RENDA FIXA CREDITO PRIVADO LONGO PRAZO	0,58%	4,23%	3,12%	10,49%	20,15%
3	BTG PACTUAL YIELD DI FI RENDA FIXA REFERENCIADO CRÉDITO PRIVADO	0,57%	4,38%	3,26%	6,96%	20,30%
4	SAFRA CAPITAL MARKET - FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CRÉDITO	0,56%	4,29%	3,21%	6,78%	19,79%
5	SAFRA CAPITAL MARKET INSTITUCIONAL DI FUNDO DE INVESTIMENTO EM C	0,55%	4,17%	3,12%	6,59%	19,38%
6	SECURITY FI REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	0,27%	2,00%	1,47%	3,16%	8,88%
7	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA XVI RENDA FIXA CRÉDITO P	0,00%	3,02%	1,58%	5,15%	16,21%
8	PIATÁ FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO PREVIDENCIÁR	-0,15%	-25,99%	-1,06%	-41,58%	-45,92%
9	INCENTIVO FUNDO DE INVESTIMENTO REFERENCIADO CDI CRÉDITO PRIVADO	-0,24%	-0,65%	-0,16%	-5,03%	61,23%
10	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FUNDO DE INVESTIM	-0,36%	5,40%	3,38%	8,45%	26,33%

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	-2,41%	4,42%	-9,15%	13,72%	42,56%
2	FI EM AÇÕES CAIXA BRASIL IBOVESPA	-3,14%	0,14%	-10,27%	7,71%	31,30%
3	BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	-3,16%	0,34%	-10,18%	7,95%	31,87%
4	BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES INSTITUCIONAL IBRX ATIVO	-3,20%	3,83%	-7,99%	11,99%	37,31%
5	BB AÇÕES IBRX INDEXADO FICFI	-3,23%	-1,46%	-11,01%	5,04%	25,77%
6	CAIXA FI AÇÕES BRASIL IBX - 50	-3,30%	-0,02%	-11,29%	9,25%	30,84%
7	BRADESCO H FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES IBOVESPA	-3,31%	-0,89%	-10,94%	6,03%	26,51%
8	BB AÇÕES IBOVESPA INDEXADO FICFI	-3,33%	-1,03%	-11,06%	5,92%	26,50%
9	DAYCOVAL DIVIDENDOS IBOVESPA FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	-3,43%	2,33%	-9,52%	7,76%	35,71%
10	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA IBOVESPA	-3,44%	-2,15%	-11,84%	3,98%	22,47%

Art. 8º II

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
1	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	-3,07%	0,17%	-10,13%	7,60%	31,41%
2	ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVA11	-3,19%	0,25%	-10,24%	8,07%	31,84%

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	12,88%	33,66%	33,50%	52,90%	71,68%
2	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA BDR NÍVEL I	12,75%	32,79%	32,82%	51,45%	68,56%
3	BB AÇÕES CIELO FUNDO DE INVESTIMENTO	5,31%	-33,73%	-35,46%	-29,40%	-42,73%
4	BB AÇÕES BB SEGURIDADE FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	2,83%	-9,71%	-14,08%	-7,66%	-8,47%
5	SANTANDER PETROBRÁS PLUS FIC AÇÕES	0,59%	28,49%	-5,70%	92,71%	41,35%
6	CAIXA FI AÇÕES VALE DO RIO DOCE	0,31%	36,47%	22,49%	57,25%	231,80%
7	EQUITAS SELECTION INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM QUOTAS	-0,40%	-0,24%	-9,39%	1,41%	28,85%
8	ROMA AÇÕES FI DE AÇÕES	-0,47%	-3,58%	-2,74%	-5,25%	-27,96%
9	BB TOP AÇÕES EXPORTAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO	-0,83%	22,37%	11,85%	33,15%	78,90%
10	BB AÇÕES INFRAESTRUTURA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDO	-0,91%	-0,68%	-6,75%	9,80%	37,72%

Art. 8º IV

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
1	WESTERN ASSET US INDEX 500 FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	3,71%	11,14%	9,04%	22,46%	55,06%
2	MÉRITO MULTIMERCADO I FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS D	1,27%	10,76%		16,12%	32,63%
3	BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIQ DE FI MULTIMERCADO CRÉDITO	0,67%	4,99%	3,72%	7,85%	23,90%
4	GERAÇÃO FUTURO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVES	0,55%	5,07%	2,96%	7,97%	21,01%
5	SAFRA CARTEIRA INSTITUCIONAL - FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCAD	0,51%	2,70%	1,22%	5,47%	18,56%
6	INFINITY INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	0,50%	4,64%	3,47%	7,31%	24,39%
7	CAPITÂNIA MULTI CRÉDITO PRIVADO FIC FI MULTIMERCADO	0,50%	-2,50%	-2,70%	-3,13%	6,78%
8	GERAÇÃO FUTURO LIQUIDEZ TOP FIC MULTIMERCADO	0,49%	4,53%	2,65%	7,40%	19,55%
9	INSTITUTIONAL ACTIVE FIX IB - MULTIMERCADO FUNDO DE INVESTIMENTO	0,49%	4,21%	3,12%	6,68%	19,53%
10	ITAÚ INSTITUCIONAL MULTIMERCADO JUROS E MOEDAS FI	0,49%	4,39%	3,29%	6,77%	18,85%

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 PARTICIPACOES 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

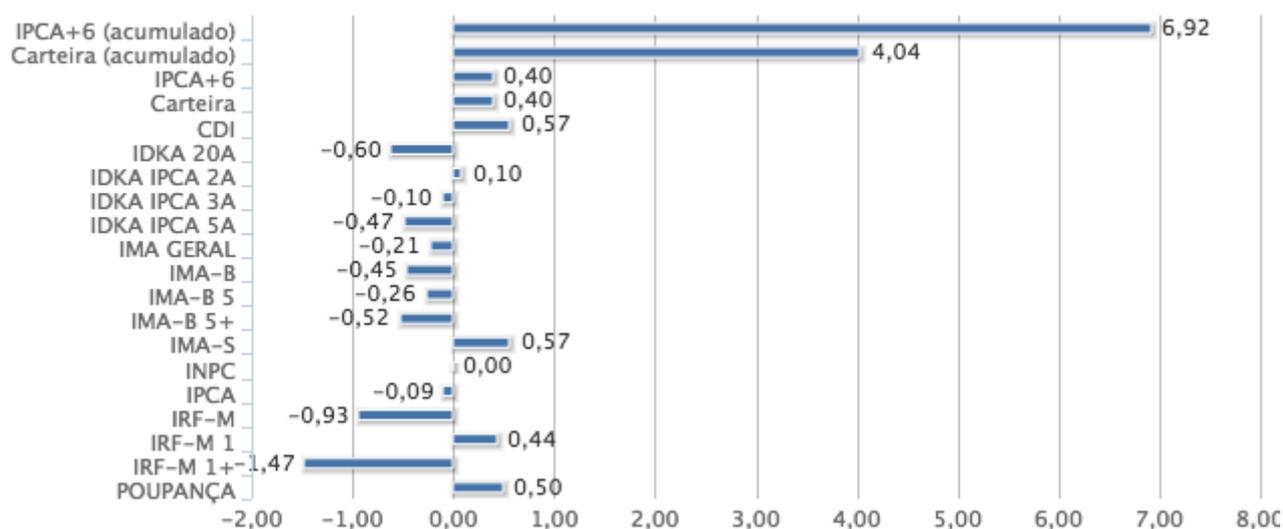
	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
1	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII SIA CORPORATE	0,13%	6,91%	4,65%	22,02%	-15,74%
2	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO BR HOTÉIS - FII					
3	HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO					
4	BANRISUL NOVAS FRONTEIRAS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FI					
5	KINEA II REAL ESTATE EQUITY FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO					
6	FIRENZE FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO					
7	BB PROGRESSIVO II FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII					
8	BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO					
9	AQUILLA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO					
10	AQUILLA RENDA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO					

5. CONSIDERAÇÕES FINAIS

O baixo índice de inflação ajuda muito a meta de rentabilidade dos RPPS. Mesmo assim, os indicadores de rentabilidade apontam que títulos de longo prazo não estavam atrativos no mês de agosto, apresentando valores negativos para os ativos com prazos maiores de 1 ano. Veja o comportamento da sua carteira, abaixo:

O cálculo da TMA (representada pelo IPCA+6 a.a.) foi de 0,40%, porém o CORONEL PREV obteve uma rentabilidade agregada de sua carteira de 0,40%, conseguindo cumprir a meta necessária.

Rentabilidade dos indicadores e da Carteira



Resumo dos principais indicadores

Na situação financeira, o CORONEL PREV obteve rendimento de R\$ 1.485,31 neste mês, e, os resgates superaram as aplicações em um valor de R\$ -52.795,31. O saldo em conta corrente foi de R\$ 10.310,52.

Reviravoltas no mercado internacional (Americano e Europeu), e o cenário político brasileiro demonstram que até o melhor analista financeiro não pode contemplar todas as variáveis. No fechamento deste relatório o candidato Bolsonaro já havia sofrido o atentado à faca. Ninguém é capaz de vislumbrar o resultado dessa ação perante a eleição. É aguardar e se preparar para todos os possíveis acontecimentos.

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: Agosto / 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, 23 de Outubro 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