

FUNDO DE PREVIDENCIA SOCIAL DO MUNICIPIO DE CORONEL JOAO PESSOA

Relatório de Investimentos CORONEL PREV

Setembro / 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	3
1.4 Bolsa	3
Ibovespa recua 0,82% no último pregão, mas acumula alta de mais de 3% no mês.	3
Saúde das empresas 'segura' Bolsa em ano turbulento	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	9
3.1 Enquadramento na Resolução Atual	9
3.2 Enquadramento na Política de Investimentos Atual	9
4. RANKINGS	11
Renda Fixa	11
Art. 7º I, "b"	11
Art. 7º III	11
Art. 7º IV	12
Art. 7º VI	12
Art. 7º VII, "a"	13
Art. 7º VII, "b"	13
Renda Variável	14
Art. 8º I	14
Art. 8º II	14
Art. 8º III	14
Art. 8º IV	15
Art. 8º V	15
Art. 8º VI	16
5. CONSIDERAÇÕES FINAIS	17
Confirmação de Recebimento de Relatório	18

1. CENÁRIO ECONÔMICO

1.1 Destaques do mês

Inflação é a maior para o mês de setembro desde 2015

O **Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo (IPCA)** de setembro variou 0,48%, acima da taxa de -0,09% registrada em agosto. Este resultado é o maior para um mês de setembro desde 2015, quando o IPCA registrou 0,54%. O acumulado no ano ficou em 3,34%, acima do 1,78% registrado em igual período do ano passado. Na ótica dos últimos doze meses, o índice ficou em 4,53%, acima dos 4,19% dos 12 meses imediatamente anteriores. Em setembro de 2017, a taxa atingiu 0,16%.

O resultado está dentro do limite da meta do governo, de manter a inflação em 4,5% no ano, com uma tolerância de 1,5 ponto para cima ou para baixo, ou seja, pode variar entre 3% e 6%.

No ano, o indicador acumula alta de 3,34%. Em agosto, a taxa havia ficado negativa em 0,09%. As informações foram divulgadas pelo IBGE (Instituto Brasileiro de Geografia e Estatística) na sexta-feira (5/10).

INPC varia 0,30% em setembro

O **Índice Nacional de Preços ao Consumidor - INPC** apresentou variação de 0,30% em setembro, após a estabilidade na média de preços em agosto (0,00%). Este resultado é o maior para um mês de setembro desde 2015, quando o INPC registrou 0,51%. O acumulado no ano ficou em 3,14%, acima do 1,24% registrado em igual período do ano passado. Na ótica dos últimos doze meses, o índice ficou em 3,97%, acima dos 3,64% dos 12 meses imediatamente anteriores. Em setembro de 2017, a taxa foi de -0,02%.

1.2 Cenário Brasileiro

Saída de dólares do Brasil chega a US\$ 6,13 bilhões em setembro, a maior do ano, informa BC

A saída de dólares da economia brasileira superou o ingresso de recursos em US\$ 6,138 bilhões no mês de setembro, informou o Banco Central nesta quarta-feira (3).

Foi a maior retirada mensal de recursos do país desde dezembro do ano passado, quando US\$ 9,331 bilhões deixaram a economia.

A saída de recursos em setembro já havia sido precedida por outra retirada de valores em agosto, no montante de US\$ 4,250 bilhões.

Nos últimos dois meses, período que coincide com o início da corrida eleitoral, com o aumento das tensões comerciais entre Estados Unidos e China, US\$ 10,387 bilhões foram levados para fora do Brasil.

Entretanto, na parcial de todo este ano, ainda foi contabilizada uma entrada de recursos. Nos nove primeiros meses de 2018, o ingresso de divisas no Brasil superou a retirada de recursos em US\$ 18,040 bilhões.

Exportação do complexo soja do Brasil terá alta de 21%

em 2018, diz Abiove

O Brasil, maior exportador de **soja** do mundo, deverá registrar um faturamento recorde de 38,3 bilhões de dólares com os embarques do grão, farelo e óleo de soja em 2018, um crescimento de 21 por cento ante 2017, com o país sendo beneficiado por forte demanda da **China**, bons preços e uma safra histórica para comercializar.

O preço médio da exportação de soja do Brasil, que até setembro havia somado quase 70 milhões de toneladas –sendo 55 milhões de toneladas para a China–, foi visto em 400 dólares por tonelada, ante 377 dólares no ano passado.

A receita com as exportações de óleo de soja do Brasil deverão recuar para 980 milhões de dólares, ante pouco mais de 1 bilhão de dólares em 2017, com preços mais baixos do produto exportado.

1.3 Cenário Internacional

Desemprego nos EUA cai para 3,7% em setembro, menor taxa em quase 50 anos

A criação de vagas de trabalho nos Estados Unidos desacelerou com força em setembro provavelmente porque o furacão Florence prejudicou os setores de restaurantes e varejo, mas a taxa de desemprego caiu para 3,7%, a menor desde dezembro de 1969.

O relatório mensal de emprego do Departamento de Trabalho, divulgado nesta sexta-feira (5), também mostrou aumento constante dos salários, sugerindo pressões inflacionárias moderadas, o que pode aliviar as preocupações com o superaquecimento da economia e manter o Federal Reserve (BC dos EUA) na trajetória de aumentos graduais da taxa de juros, segundo a agência Reuters.

Reservas cambiais da China caem pelo segundo mês consecutivo em setembro

As reservas cambiais da China encolheram em setembro pelo segundo mês consecutivo, à medida que o Banco do Povo da China (PBoC, na sigla em inglês) intensificou os esforços para estabilizar a moeda chinesa.

O acúmulo de divisas declinou em US\$ 22,69 bilhões em setembro em relação ao mês anterior, para US\$ 3,087 trilhões, segundo dados do banco central divulgados neste domingo. Em agosto, as reservas cambiais caíram US\$ 8,23 bilhões.

No domingo anterior, o BC cortou o compulsório dos bancos para impulsionar o crescimento à medida que a briga comercial entre os EUA e a China se intensifica. A medida, que liberará quase US\$ 175 bilhões de liquidez no sistema bancário do país, é esperada pelos economistas para colocar mais pressão sobre o yuan.

1.4 Bolsa

Ibovespa recua 0,82% no último pregão, mas acumula alta de mais de 3% no mês.

O principal índice da bolsa brasileira de valores, a B3, fechou em queda nesta sexta-feira (28), após ter chegado a 80.000 pontos no dia anterior com a forte valorização das ações da Petrobras.

A bolsa acumulou alta de 3,48% em setembro e de 8,9% no trimestre. No ano, o avanço do Ibovespa é de 3,85%.

Saúde das empresas 'segura' Bolsa em ano turbulento

A Bolsa tem mostrado uma resistência incomum para um ano eleitoral. Mesmo com todas as incertezas do quadro político e do cenário externo desfavorável para emergentes, ela tem se mantido no território positivo em 2018. Até setembro, subiu quase 4%.

A atual resiliência do mercado, segundo analistas, é resultado da "lição de casa" feita pelas empresas durante a crise, que fizeram pesados ajustes para voltar a lucrar. Isso aponta expectativa de ganhos no médio prazo --que, é claro, também dependem do resultado das urnas.

1.5 Projeções

FMI reduz a previsão de crescimento do Brasil em 2018 e 2019

O **Fundo Monetário Internacional (FMI)**, que deu início nesta segunda-feira, dia 8, à sua reunião anual com o **Banco Mundial em Bali**, na Indonésia, reduziu suas previsões para o crescimento do Brasil para 2018 e 2019, que passam agora a ser de 1,4% e 2,4%, respectivamente, segundo o documento *Perspectiva Econômica Mundial*, com o título "Desafios para crescimento constante". A mudança para baixo da previsão para este ano foi uma das maiores feitas pelo FMI. Em julho, as projeções para o PIB do País estavam em 1,8% para 2018 e 2,5% para 2019. Em abril, o Fundo estimou que a economia brasileira avançaria 2,3% neste ano e 2,5% no próximo.

A instituição multilateral ressalta que o País está numa rota de recuperação, com alta do PIB de 1,0% em 2017, depois de ter passado pela forte recessão de 2015-2016. Contudo, o FMI aponta que a retomada da economia em países emergentes, além de ser influenciada por fatores internos, sofre efeitos do processo de normalização da política monetária nos EUA, que afetou neste ano esses países em geral. O Fundo estima que, no médio prazo, a taxa de expansão do Brasil deve ser de 2,2%, marca que deverá ser alcançada em 2023.

Mercado prevê mais inflação para 2018 e reduz estimativa de crescimento do PIB

Os analistas das instituições financeiras elevaram a estimativa de inflação para este ano e também passaram a prever um crescimento menor do Produto Interno Bruto (PIB).

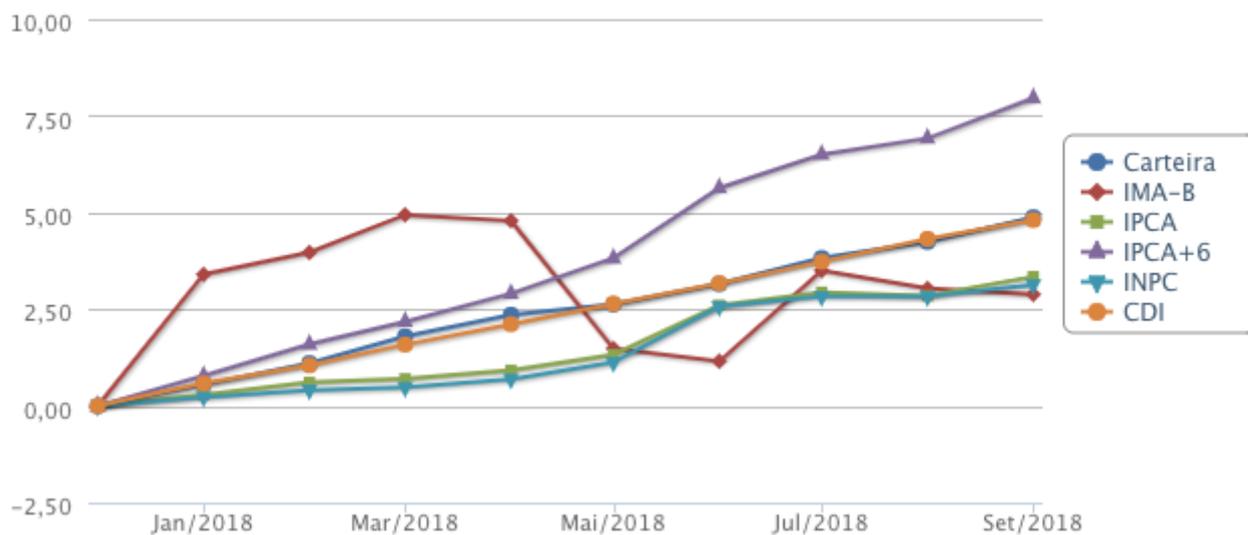
Para o Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo (IPCA), a inflação oficial do país, o mercado financeiro elevou a estimativa de 4,30% para 4,40% para este ano. Foi a quarta alta seguida do indicador.

O aumento aconteceu após a divulgação do IPCA de setembro, que somou 0,48% e foi o maior para esse mês desde 2015. A alta da inflação no mês passado foi puxada pelos preços de transportes e combustíveis.

Mesmo assim, a expectativa do mercado segue abaixo da meta de inflação, que é de 4,5% neste ano, e dentro do intervalo de tolerância previsto pelo sistema. A meta terá sido cumprida se o IPCA ficar entre 3% e 6% em 2018.

Para 2019, os economistas das instituições financeiras mantiveram sua expectativa de inflação em 4,20%. A meta central do próximo ano é de 4,25%, e o intervalo de tolerância do sistema de metas varia de 2,75% a 5,75%.

1.6 Indicadores Financeiros



2. ANÁLISE DA CARTEIRA

2.1 Composição da Carteira

Fundo de Investimento	Saldo em 31/08/2018	Saldo em 28/09/2018	Rentabilidade
CAIXA FI BRASIL DI LONGO PRAZO	R\$55.514,00	R\$5.749,00	0,44%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTA	R\$6.571,00	R\$7.005,00	0,39%
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	R\$195.783,00	R\$76.157,00	0,59%
BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS FIC	R\$29.356,00	R\$86.076,00	0,59%
	R\$287.224,00	R\$174.987,00	

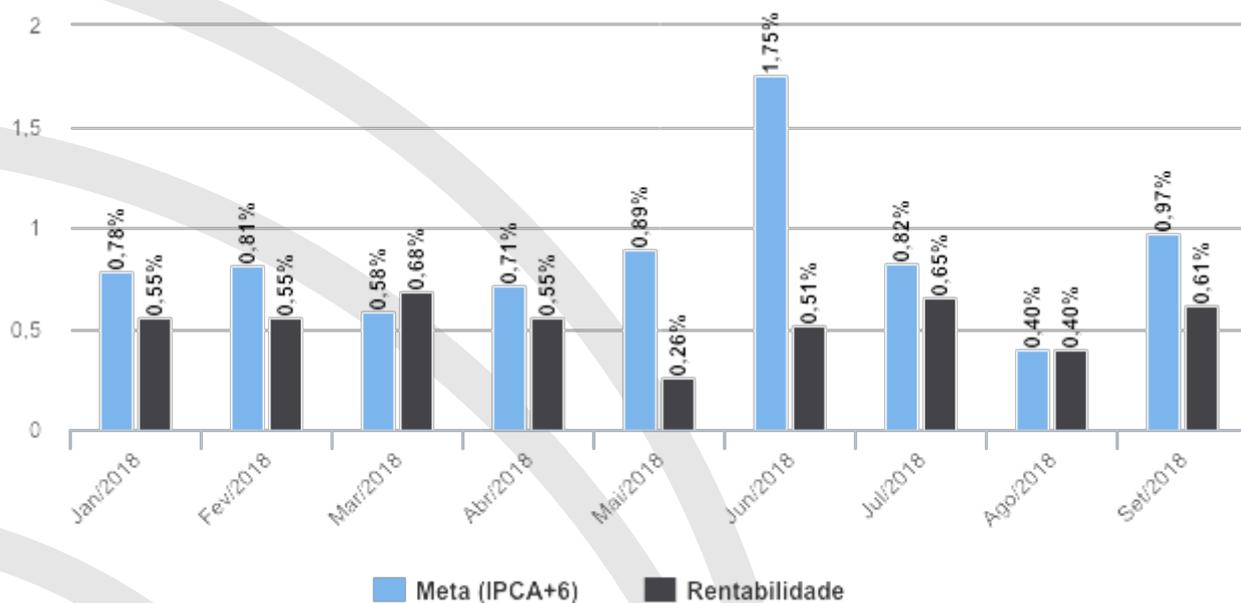
2.2 Investimentos por Segmento

Segmento	Saldo em 31/08/2018	Saldo em 28/09/2018	Rentabilidade
Renda Fixa	R\$231.709,81	R\$169.237,41	0,63%
Renda Fixa Referenciado	R\$55.513,97	R\$5.748,74	0,44%
	R\$287.223,78	R\$174.986,16	

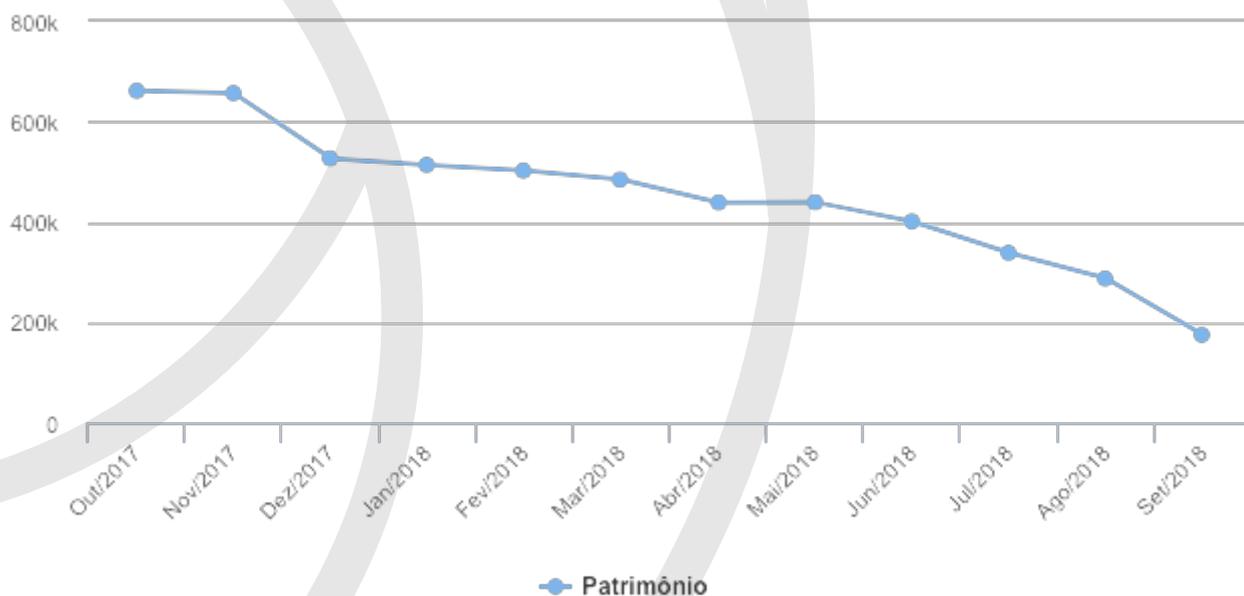
2.3 Investimentos por Instituição

Instituição Financeira	Saldo em 31/08/2018	Saldo em 28/09/2018	Rentabilidade
Banco do Brasil S.A.	R\$35.926,79	R\$93.080,35	0,55%
Caixa Econômica Federal	R\$251.296,99	R\$81.905,81	0,64%
	R\$287.223,78	R\$174.986,16	

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	0,39%	3,97%	2,63%	5,55%	R\$1.322.426.505,09	28/04/2011	1,00%	0,00%	R\$1.000,00
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS FIC	0,59%	4,66%	2,89%	6,55%	R\$11.846.665.630,28	08/12/2009	0,10%	0,00%	R\$1,00
CAIXA FI BRASIL DI LONGO PRAZO	0,44%	4,65%	3,10%	6,51%	R\$6.667.936.150,82	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	0,59%	4,69%	2,92%	6,60%	R\$16.786.238.179,15	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%	92,71%	R\$162.232,65
- BB PREVIDENCIARIO RF IRF-M 1 TP	100,00%	49,19%	R\$86.075,59
- CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	100,00%	43,52%	R\$76.157,06
Art. 7º - Inciso IV - até 30% em Renda Fixa	30,00%	7,29%	R\$12.753,51
- BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA FLU	20,00%	4,00%	R\$7.004,76
- CAIXA FI BRASIL DI LP	20,00%	3,29%	R\$5.748,74
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\$174.986,16

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%	92,71%
- BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS FIC	0,00%	100,00%	49,19%
- CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	0,00%	100,00%	43,52%
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%	7,29%
- CAIXA FI BRASIL DI LONGO PRAZO	0,00%	30,00%	3,29%
- BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTA	0,00%	30,00%	4,00%
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 KANSAI RF IMA-B 100% TP - RPPS	2,42%	5,06%	0,95%	1,93%	8,41%
2	CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	1,42%	3,72%	-0,77%	5,02%	24,71%
3	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INV	1,28%	4,10%	0,45%	5,67%	23,69%
4	ITAU INSTITUCION RF PRE FIXADO LP FICFI	1,26%	3,91%	0,33%	5,42%	23,16%
5	BANRISUL FOCO IRF-M FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	1,23%	3,84%	0,29%	5,35%	22,71%
6	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS REND	1,22%	0,58%	0,11%	2,17%	10,47%
7	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 III TÍTULOS PÚBLICOS REN	1,22%	0,58%	0,10%	2,16%	10,61%
8	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 V TITULOS PUBLICOS RENDA	1,22%	5,97%	2,89%	10,29%	10,62%
9	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI	1,22%	6,17%	3,61%	7,85%	21,52%
10	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS REND	1,21%	0,59%	0,09%	2,16%	10,64%
28	BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS FIC	0,59%	4,66%	2,89%	6,55%	19,80%
29	CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	0,59%	4,69%	2,92%	6,60%	19,95%

Art. 7º III

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
1	GGR INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B 5	1,72%	-8,61%	-3,57%	-7,34%	6,36%
2	FUNDO DE INVESTIMENTO DIFERENCIAL RENDA FIXA LONGO PRAZO	1,03%	-31,49%		-30,85%	-22,49%
3	BRANDESCO INSTITUCIONAL FI RF B VÉRTICE 2019	0,90%	2,57%	0,52%	2,09%	5,71%
4	VITÓRIA RÉGIA FUNDO DE INVESTIMENTO DE RENDA FIXA LONGO PRAZO	0,88%	-13,60%	-9,85%	-13,13%	-12,09%
5	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVEST	0,87%	4,83%	1,49%	6,32%	20,57%
6	BRANDESCO INSTITUCIONAL FIC DE FI RENDA FIXA IMA-B 5	0,86%	4,67%	1,23%	6,07%	20,69%
7	VOTORANTIM INFLATION RENDA FIXA FIC de FI	0,84%	4,39%	1,17%	5,82%	19,75%

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
8	ADINVEST TOP FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	0,84%	-21,42%	-9,75%	-20,95%	-14,56%
9	BRADESCO FI RENDA FIXA IMA GERAL	0,62%	4,19%	0,66%	5,18%	21,37%
10	BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FI	0,61%	4,14%	0,88%	5,31%	21,19%

Art. 7º IV

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
1	UNIBANCO RENDA FIXA LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO	1,22%	3,48%	0,04%	4,83%	21,84%
2	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	0,89%	11,40%	8,78%	14,10%	23,94%
3	BTG PACTUAL IPCA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	0,88%	4,80%	1,48%	6,27%	20,40%
4	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI	0,84%	4,22%	-0,04%	5,23%	21,38%
5	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	0,78%	12,16%	9,46%	14,94%	25,29%
6	BB INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	0,76%	5,06%	3,44%	6,99%	19,80%
7	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RENDA FIXA	0,66%	4,24%	1,48%	5,84%	
8	BANRISUL PREVIDENCIA IPCA 2024 FI RF LP	0,56%	2,32%	2,72%	4,85%	7,89%
9	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA	0,55%	2,01%	2,44%	4,51%	7,00%
10	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA	0,55%	2,13%	2,49%	4,62%	7,37%
36	CAIXA FI BRASIL DI LONGO PRAZO	0,44%	4,65%	3,10%	6,51%	18,91%
52	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTA	0,39%	3,97%	2,63%	5,55%	16,74%

Art. 7º VI

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
1	BANRISUL PREVIDENCIA IPCA 2030 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	0,57%	2,22%	2,69%	4,79%	7,76%
2	FIDC DA INDÚSTRIA EXODUS INSTITUCIONAL - SENIOR	0,56%	5,80%			
3	FIDC INCENTIVO MULTISSETORIAL II	0,00%	58,94%			
4	LME REC MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS C	-0,34%	1.131,37%			
5	BBIF MASTER FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS LP	-0,34%	1,80%			

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
6	QT IPCA FIDC JUROS REAL					
7	ILLUMINATI FIDC					
8	MAXPREV FIQ FIDC MULTISSETORIAL					
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	INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC - Série B	0,00%	0,00%			
2	INCENTIVO MULTISSETORIAL I - FIDC - Série A	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	FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS CASAN SANEAMENTO					

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	1,16%	4,21%	2,18%	5,77%	16,64%
2	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FUNDO DE INVESTIM	0,89%	6,33%	2,65%	8,07%	25,41%
3	BTG PACTUAL YIELD DI FI RENDA FIXA REFERENCIADO CRÉDITO PRIVADO	0,48%	4,88%	3,20%	6,81%	19,59%
4	SANTANDER FI MASTER RENDA FIXA CREDITO PRIVADO LONGO PRAZO	0,48%	4,74%	3,08%	6,66%	19,51%
5	SAFRA CAPITAL MARKET PREMIUM DI CREDITO PRIVADO FIC FI REFERENCI	0,48%	4,91%	3,26%	6,80%	19,57%
6	SAFRA CAPITAL MARKET - FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CRÉDITO	0,46%	4,77%	3,16%	6,62%	19,14%
7	SAFRA CAPITAL MARKET INSTITUCIONAL DI FUNDO DE INVESTIMENTO EM C	0,45%	4,63%	3,07%	6,43%	18,74%

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
8	SECURITY FI REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	0,21%	2,21%	1,47%	3,08%	8,56%
9	PIATÁ FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO PREVIDENCIAR	-0,10%	-26,07%	-1,01%	-41,22%	-46,09%
10	URCA FI RENDA FIXA CREDITO PRIVADO PREVIDENCIARIO	-0,15%	-79,68%	-62,12%	-79,29%	-76,94%

Renda Variável

Art. 8º I

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
1	SANTANDER FI IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL AÇÕES	3,64%	1,41%	-6,58%	4,02%	29,84%
2	BNP PARIBAS ACE IBRX FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDO DE	3,56%	-1,26%	-6,85%	0,87%	24,42%
3	BRADERSCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES INSTITUCIONAL IBRX ATIVO	3,48%	7,45%	-4,11%	11,13%	39,14%
4	BRADERSCO FIA IBOVESPA PLUS	3,48%	3,83%	-5,41%	7,63%	33,16%
5	HSBC FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES IBOVESPA VALUATION	3,43%	8,00%	-5,48%	12,85%	44,03%
6	FI EM AÇÕES CAIXA BRASIL IBOVESPA	3,40%	3,55%	-5,56%	7,32%	32,27%
7	DAYCOVAL DIVIDENDOS IBOVESPA FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	3,36%	5,77%	-5,53%	6,80%	36,12%
8	BRADERSCO H FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES IBOVESPA	3,34%	2,42%	-6,18%	5,73%	27,79%
9	BB AÇÕES IBOVESPA INDEXADO FICFI	3,26%	2,20%	-6,38%	5,52%	27,64%
10	CAIXA FI AÇÕES BRASIL IBX - 50	3,19%	3,17%	-6,51%	7,32%	31,87%

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	MINT VALUE FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIME	11,87%	7,70%	-0,60%	7,49%	44,05%
2	CAIXA FI AÇÕES VALE DO RIO DOCE	11,06%	51,56%	46,00%	93,23%	243,69%
3	SANTANDER PETROBRÁS PLUS FIC AÇÕES	9,54%	40,75%	4,09%	48,43%	49,22%

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
4	GW CLASSIC FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	6,23%	-76,45%	318,35%	-46,05%	-59,37%
5	BB TOP AÇÕES SETORIAL SIDERURGIA FUNDO DE INVESTIMENTO	4,31%	17,92%	4,18%	36,07%	83,90%
6	BRASIL PLURAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE AÇÕES	4,05%	9,83%	-3,93%	14,12%	38,24%
7	GERAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	4,00%	0,75%	-7,50%	-1,52%	8,68%
8	BB PREVIDENCIARIO ACOES ALOCACAO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS	3,67%	7,26%	-1,40%	10,37%	29,33%
9	SANTANDER FUNDO DE INVESTIMENTO PIBB AÇÕES	3,57%	3,31%	-6,02%	7,09%	30,79%
10	BRDESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES DIVIDENDOS	3,47%	6,40%	-6,06%	9,95%	41,99%

Art. 8º IV

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
1	BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FEEDER FIC FI MULTIMERCADO CRÉDITO	11,59%	-36,29%	-37,21%	-35,23%	-33,09%
2	CAIXA FI MULTIMERCADO RV 30 L P	1,24%	3,85%	0,18%	6,27%	21,38%
3	BB PREVIDENCIÁRIO MULTIMERCADO FUNDO DE INVESTIMENTO LONGO PRAZO	1,16%	5,07%	3,28%	7,53%	20,57%
4	MÉRITO MULTIMERCADO I FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS D	1,07%	11,95%	7,26%	15,45%	34,69%
5	GERAÇÃO FUTURO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVES	0,91%	6,02%	2,98%	7,74%	21,08%
6	INFINITY EAGLE FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	0,91%	5,60%	3,45%	7,85%	29,64%
7	VOTORANTIM ATUARIAL MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVEST	0,90%	6,26%	3,05%	8,18%	23,86%
8	CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO	0,81%	4,57%	1,43%	6,49%	19,83%
9	XP LONG SHORT FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVEST	0,81%	9,88%	2,23%	8,42%	17,45%
10	GERAÇÃO FUTURO LIQUIDEZ TOP FIC MULTIMERCADO	0,79%	5,36%	2,65%	7,11%	19,52%

Art. 8º V

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
1	ÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO E	0,00%	-0,90%			
2	ÁTICO FLORESTAL - FIP	0,00%	-0,76%			
3	ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA - FIP	-0,02%	-0,43%			
4	INFRA SANEAMENTO - FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES	-0,14%	-1,49%			

	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
5	W7 FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES	-0,15%	11,34%			
6	BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE					
7	FOCO CONQUEST FIP					
8	FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES LSH					
9	FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPACOES CAIXA INCORPORACAO IMOBIL					
10	FUNDO BRASIL DE INTERNACIONALIZAÇÃO DE EMPRESAS FIP II					

Art. 8º VI

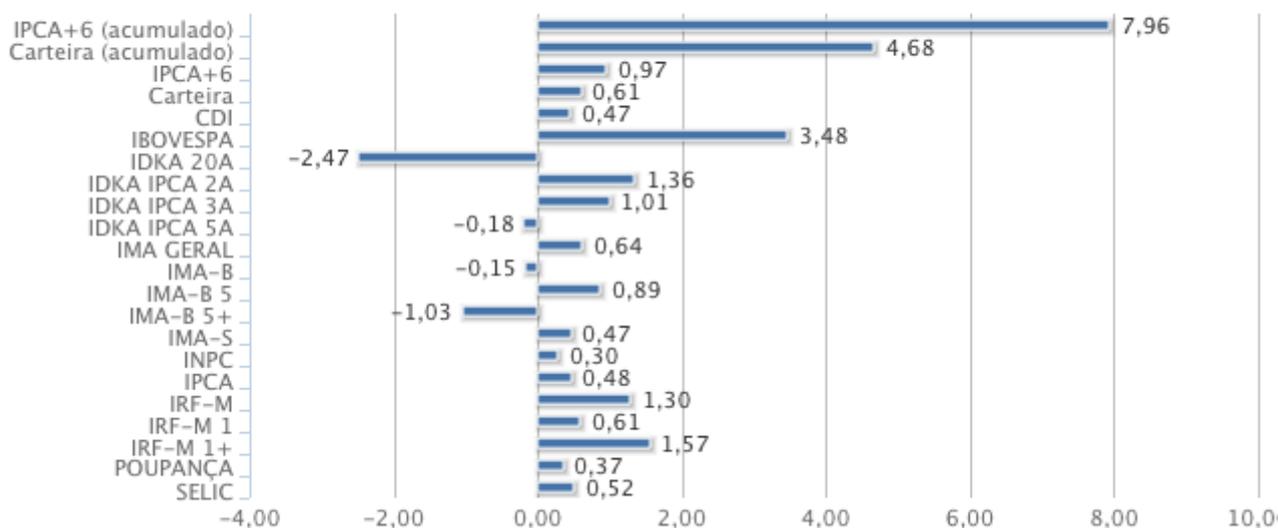
	Fundo de Investimento	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses
1	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FI	0,24%	-1,47%			
2	HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	0,06%	15,30%			
3	FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO BR HOTÉIS - FII	-0,05%	8,84%			
4	BANRISUL NOVAS FRONTEIRAS FUNDO DE INVESTIMENTO 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

A alta dos indicadores de inflação continuam trazendo problemas aos gestores de RPPS, onde o atingimento da Taxa de Meta Atuarial se torna cada vez mais difícil neste ano conturbado para o País. Veja o sumário abaixo:

O cálculo da TMA (representada pelo IPCA+6 a.a.) foi de 0,97%, porém o CORONEL PREV obteve uma rentabilidade agregada de sua carteira de 0,61%, 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\$ 1.569,84 neste mês, e, os resgates superaram as aplicações em um valor de R\$ -113.806,84. O saldo em conta corrente foi de R\$ 200,39.

Com o termino das eleições se aproximando, e o mercado financeiro deixando claro quem poderia lidar melhor com a condição do Brasil, aos RPPS basta esperar que a melhor escolha seja feita, pois disso dependem milhares de aposentadorias e benefícios que necessitam de uma economia forte para se manterem consistentes.

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: Setembro / 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