



Instituto de Previdência Matinhos - PR

[RELATÓRIO MENSAL DE GESTÃO]

Dezembro - 2017

Introdução

O presente relatório tem por objetivo cumprir as exigências legais, dispostos pela Resolução do CMN nº 3.922/10, e a Portaria MPS nº 519/11 e as suas alterações subsequentes.

O conteúdo do relatório é baseado em informações obtidas nos Regimes Próprios de Previdência Social (RPPS), além de outras informações de domínio público.

A análise de investimentos se limita a carteira de investimentos, excluindo movimentações em conta corrente, ou outros investimentos fora do contexto de alocação dos RPPS.

O trabalho de consultoria de investimentos é feito com imparcialidade e transparência, e busca tão somente contribuir aos institutos de previdência para buscar as melhores alocações baseados em risco e retorno, sempre com objetivo de cumprir as metas atuariais.

Nossas análises de investimento, em conformidade com as normas da CVM e ANBIMA, não devem assegurar prometer ou sugerir a existência de resultados futuros ou isenção de risco para o investidor.

A análise de desempenho e características gerais de investimento é limitada aos fundos de investimento, e não indicamos ou recomendamos gestores de fundos ou instituições financeiras.

Conteúdo

O Relatório Mensal de Gestão do abrangerá os seguintes aspectos:

RELATÓRIOS GERENCIAIS

| | |
|--|-----------|
| Carteira de Investimentos - Composição | <u>1</u> |
| Carteira de Investimentos – Riscos | <u>2</u> |
| Carteira de Investimentos – Evolução Mensal | <u>3</u> |
| Rentabilidade dos Fundos de Investimento | <u>4</u> |
| Rentabilidade da Carteira Consolidada | <u>5</u> |
| Participação dos Fundos na Rentabilidade da Carteira | <u>6</u> |
| Distribuição da Carteira por Índices e Perfil | <u>7</u> |
| Enquadramento da Carteira por Fundos | <u>8</u> |
| Enquadramento da Carteira por Aplicações | <u>9</u> |
| DAIR - Informações dos Fundos | <u>10</u> |
| DAIR - APR Movimentações | <u>11</u> |
| DAIR - Carteira de Investimentos | <u>12</u> |

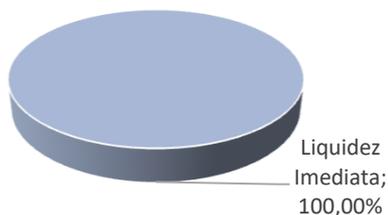


Instituto de Previdência Matinhos

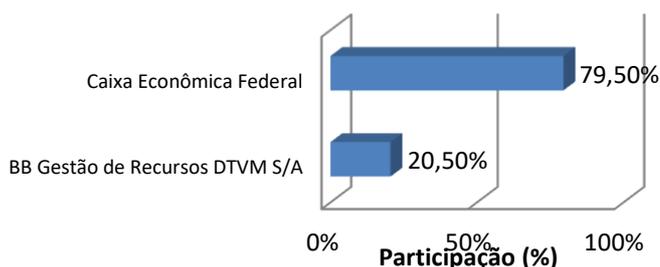
CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - COMPOSIÇÃO

| FUNDOS DE INVESTIMENTO (FI) | novembro-17 | dezembro-17 | % |
|---|----------------------|----------------------|---------------|
| FI de Renda Fixa | 61.577.737,32 | 62.613.803,27 | 1,68% |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LP | 3.421.882,90 | 3.451.667,46 | 0,87% |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RENDA FIXA | 36.226.380,34 | 36.405.139,68 | 0,49% |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LP | 2.766.994,25 | 2.805.307,72 | 1,38% |
| FIC-FI CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP | 4.401.924,38 | 4.438.155,50 | 0,82% |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RENDA FIXA LP | 2.658.347,61 | 2.679.787,87 | 0,81% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TP FI | 576.577,50 | 583.628,22 | 1,22% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TP FI | 793.172,86 | 799.586,42 | 0,81% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP FIC FI | 7.789.562,69 | 7.833.087,13 | 0,56% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC-FI | 922.169,03 | 1.580.212,47 | 71,36% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC-FI | 353.093,95 | 355.152,14 | 0,58% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 20 TP FI | 240.522,66 | 241.329,49 | 0,34% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP IPCA FI | 1.167.649,04 | 1.179.049,70 | 0,98% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TP FI | 259.460,11 | 261.699,47 | 0,86% |
| Disponibilidades Financeiras | 294.691,71 | 494.849,43 | 67,92% |
| TOTAL DA CARTEIRA | 61.872.429,03 | 63.108.652,70 | 2,00% |

Liquidez da Carteira (%)



Composição da Carteira por Gestor (%)



LEGENDA:

- ↓ Resgate de Recursos
- ↑ Entrada de Recursos
- ⊗ Resgate Total Efetuado
- Nova Aplicação Efetuada

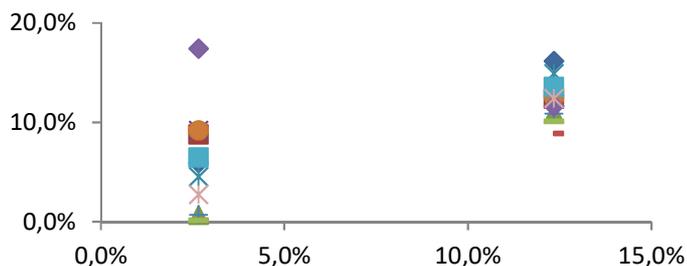


Instituto de Previdência Matinhos

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - RISCOS

| FUNDOS DE INVESTIMENTO (FI) | % CDI | | Volatilidade | | | Risco | | |
|---|-------|--------|--------------|------|-------|--------|------------|------|
| | Acima | Abaixo | 3m | 6m | 12m | Sharpe | VaR | % |
| FI de Renda Fixa | | | | | | | | |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LP | 139 | 112 | 1,1% | 1,3% | 2,7% | 0,90 | R\$ 13.483 | 0,4% |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RENDA FIXA | 145 | 106 | 0,1% | 0,2% | 0,7% | 1,52 | R\$ 35.334 | 0,1% |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LP | 144 | 107 | 3,0% | 3,0% | 5,9% | 1,05 | R\$ 24.356 | 0,9% |
| FIC-FI CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP | 135 | 116 | 3,7% | 3,8% | 8,8% | 0,28 | R\$ 57.091 | 1,3% |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RENDA FIXA LP | 137 | 114 | 3,8% | 4,0% | 9,2% | 0,29 | R\$ 36.094 | 1,3% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TP FI | 146 | 105 | 2,2% | 2,2% | 4,5% | 1,10 | R\$ 3.876 | 0,7% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TP FI | 137 | 114 | 3,8% | 3,9% | 9,2% | 0,28 | R\$ 10.775 | 1,3% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP FIC FI | 142 | 109 | 0,1% | 0,3% | 0,7% | 1,39 | R\$ 7.703 | 0,1% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC-FI | 3 | 248 | 0,0% | 0,1% | 0,1% | -8,57 | R\$ 287 | 0,0% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC-FI | 135 | 116 | 0,1% | 0,1% | 0,1% | 1,18 | R\$ 67 | 0,0% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 20 TP FI | 132 | 119 | 7,0% | 7,6% | 17,4% | 0,10 | R\$ 6.161 | 2,6% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP IPCA FI | 138 | 113 | 3,1% | 3,3% | 6,5% | 0,56 | R\$ 11.154 | 0,9% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TP FI | 140 | 111 | 1,1% | 1,3% | 2,7% | 0,90 | R\$ 1.049 | 0,4% |

Risco x Retorno (diariamente últimos 12 meses)



- ▲ FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RENDA FIXA
- ◆ FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LP
- FIC-FI CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP
- × FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RENDA FIXA LP
- × BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TP FI
- BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TP FI
- + BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP FIC FI
- BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC-FI
- BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC-FI
- ◆ BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 20 TP FI
- BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP IPCA FI
- × BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TP FI

Descrição

% CDI = Quantidade de vezes acima ou abaixo do CDI diariamente nos últimos 252 dias úteis.

VaR - Perda máxima esperada de um ativo para 1 dia, com 99% de confiança, considerando a volatilidade histórica do ativo no último ano.

Volatilidade - Volatilidade é a medida de dispersão dos retornos de um fundo. Geralmente associada ao risco do fundo, mede a previsibilidade dos retornos. Quanto mais volátil um fundo, menos previsível e mais dispersos são os seus retornos, representando maior risco para o investidor.

Sharpe - Excesso de retorno médio entre um ativo e um benchmark, por unidade de volatilidade do retorno do ativo, em um período.

$$IS = (R_i - R_f) / (\sigma)$$

Onde:

IS = Índice de Sharpe
 Ri = Retorno do Ativo
 Rf = Retorno Livre de Risco (Risk-Free)
 σ = Risco do Ativo (a letra grega sigma representa volatilidade)



Instituto de Previdência Matinhos

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - MENSAL

| FUNDOS DE INVESTIMENTO (FI) | janeiro-17 | fevereiro-17 | março-17 |
|---|----------------------|----------------------|----------------------|
| FI de Renda Fixa | 53.691.721,95 | 54.801.464,51 | 55.712.080,76 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LP | 3.105.162,82 | 3.145.286,42 | 3.189.926,38 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RENDA FIXA | 32.177.709,68 | 32.667.138,74 | 33.184.998,76 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LP | 2.280.858,14 | 2.335.558,84 | 2.371.063,89 |
| FIC-FI CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP | 4.024.560,54 | 4.176.539,68 | 4.216.186,42 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RENDA FIXA LP | 2.424.851,60 | 2.517.643,35 | 2.543.689,88 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TP FI | 519.561,89 | 529.982,32 | 537.799,17 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TP FI | 723.722,73 | 751.560,60 | 759.218,67 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP FIC FI | 5.446.301,40 | 5.500.053,33 | 5.560.606,32 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC-FI | 1.329.830,36 | 1.469.343,61 | 1.617.391,55 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC-FI | 326.172,16 | 329.080,32 | 332.590,24 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 20 TP FI | 222.316,48 | 238.495,41 | 239.269,49 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP IPCA FI | 1.110.834,15 | 1.140.781,89 | 1.159.339,99 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TP FI | 235.352,05 | 238.472,90 | 241.831,03 |
| Disponibilidades Financeiras | - | - | - |
| TOTAL DA CARTEIRA | 53.691.721,95 | 54.801.464,51 | 55.712.080,76 |
| FUNDOS DE INVESTIMENTO (FI) | abril-17 | maio-17 | junho-17 |
| FI de Renda Fixa | 56.341.089,88 | 56.937.126,01 | 57.675.453,01 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LP | 3.215.026,32 | 3.228.316,40 | 3.248.480,28 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RENDA FIXA | 33.616.328,44 | 34.062.142,05 | 34.518.364,84 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LP | 2.378.990,37 | 2.381.227,11 | 2.416.678,38 |
| FIC-FI CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP | 4.193.961,88 | 4.153.496,00 | 4.158.303,32 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RENDA FIXA LP | 2.535.013,73 | 2.504.776,02 | 2.508.527,65 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TP FI | 540.495,70 | 541.841,04 | 549.011,78 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TP FI | 756.603,88 | 747.545,85 | 748.643,38 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP FIC FI | 7.367.337,91 | 7.432.681,58 | 7.497.062,23 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC-FI | 5.073,49 | 193.359,40 | 334.909,43 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC-FI | 335.193,58 | 338.285,12 | 341.038,17 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 20 TP FI | 235.851,91 | 227.769,08 | 226.884,57 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP IPCA FI | 1.161.212,67 | 1.125.686,36 | 1.127.548,98 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TP FI | 243.674,84 | 244.630,12 | 246.125,95 |
| Disponibilidades Financeiras | - | - | - |
| TOTAL DA CARTEIRA | 56.341.089,88 | 56.937.126,01 | 57.675.453,01 |



Instituto de Previdência Matinhos

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - MENSAL

| FUNDOS DE INVESTIMENTO (FI) | julho-17 | agosto-17 | setembro-17 |
|---|----------------------|----------------------|----------------------|
| FI de Renda Fixa | 58.691.793,55 | 59.549.969,72 | 60.367.260,50 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LP | 3.326.848,34 | 3.358.918,50 | 3.388.869,40 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RENDA FIXA | 34.867.042,31 | 35.341.885,32 | 35.739.794,91 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LP | 2.483.628,72 | 2.509.644,90 | 2.551.795,34 |
| FIC-FI CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP | 4.315.230,44 | 4.373.800,30 | 4.452.125,70 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RENDA FIXA LP | 2.608.188,37 | 2.642.796,11 | 2.690.362,72 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TP FI | 561.671,72 | 567.497,21 | 575.748,30 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TP FI | 778.264,86 | 788.558,14 | 802.600,50 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP FIC FI | 7.576.299,57 | 7.642.678,74 | 7.697.038,30 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC-FI | 420.908,94 | 545.722,67 | 665.088,77 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC-FI | 343.785,71 | 346.511,62 | 348.762,70 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 20 TP FI | 239.529,55 | 242.009,28 | 249.687,47 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP IPCA FI | 1.170.395,02 | 1.189.946,93 | 1.205.386,39 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TP FI | 252.120,15 | 254.601,81 | 256.784,04 |
| Disponibilidades Financeiras | - | - | - |
| TOTAL DA CARTEIRA | 58.691.793,55 | 59.549.969,72 | 60.367.260,50 |
| FUNDOS DE INVESTIMENTO (FI) | outubro-17 | novembro-17 | dezembro-17 |
| FI de Renda Fixa | 60.887.264,60 | 61.318.277,21 | 62.352.103,80 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LP | 3.414.090,34 | 3.421.882,90 | 3.451.667,46 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RENDA FIXA | 35.883.424,55 | 36.226.380,34 | 36.405.139,68 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LP | 2.769.258,64 | 2.766.994,25 | 2.805.307,72 |
| FIC-FI CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP | 4.434.599,26 | 4.401.924,38 | 4.438.155,50 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RENDA FIXA LP | 2.679.264,23 | 2.658.347,61 | 2.679.787,87 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TP FI | 576.191,93 | 576.577,50 | 583.628,22 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TP FI | 799.368,26 | 793.172,86 | 799.586,42 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP FIC FI | 7.743.923,69 | 7.789.562,69 | 7.833.087,13 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC-FI | 785.423,12 | 922.169,03 | 1.580.212,47 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC-FI | 351.121,69 | 353.093,95 | 355.152,14 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 20 TP FI | 245.506,92 | 240.522,66 | 241.329,49 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP IPCA FI | 1.205.091,97 | 1.167.649,04 | 1.179.049,70 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TP FI | 258.723,43 | 259.460,11 | 261.699,47 |
| Disponibilidades Financeiras | - | - | - |
| TOTAL DA CARTEIRA | 60.887.264,60 | 61.318.277,21 | 62.352.103,80 |



Instituto de Previdência Matinhos

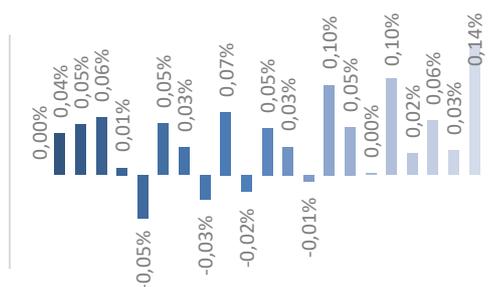
RENTABILIDADE DOS FUNDOS DE INVESTIMENTO

| FUNDOS DE INVESTIMENTO (FI) | Index | Rentabilidade | | | % da Meta | | |
|---|----------|---------------|--------|--------|-----------|------|------|
| | | dez | 2017 | 12 m | dez | 2017 | 12 m |
| FI de Renda Fixa | | | | | | | |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LP | IDKA 2 | 0,87% | 12,34% | 12,34% | 179% | 206% | 206% |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RENDA FIXA | IRF-M 1 | 0,57% | 10,93% | 10,93% | 117% | 182% | 182% |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LP | IRF-M 1+ | 1,38% | 16,15% | 16,15% | 284% | 269% | 269% |
| FIC-FI CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP | IMA-B | 0,82% | 12,36% | 12,36% | 169% | 206% | 206% |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RENDA FIXA LP | IMA-B | 0,81% | 12,55% | 12,55% | 166% | 209% | 209% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TP FI | IRF-M | 1,22% | 14,91% | 14,91% | 251% | 248% | 248% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TP FI | IMA-B | 0,81% | 12,52% | 12,52% | 166% | 209% | 209% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP FIC FI | IRF-M 1 | 0,56% | 10,86% | 10,86% | 115% | 181% | 181% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC-FI | CDI | 0,45% | 8,87% | 8,87% | 92% | 148% | 148% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC-FI | CDI | 0,58% | 10,08% | 10,08% | 120% | 168% | 168% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 20 TP FI | IDKA 20 | 0,34% | 11,62% | 11,62% | 69% | 194% | 194% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP IPCA FI | IPCA | 0,98% | 13,56% | 13,56% | 201% | 226% | 226% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TP FI | IDKA 2 | 0,86% | 12,40% | 12,40% | 177% | 207% | 207% |

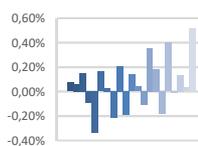
| PRINCIPAIS INDICADORES | Index | Rentabilidade | | | % da Meta | | |
|---|-------------|---------------|--------|--------|-----------|------|------|
| | | dez | 2017 | 12 m | dez | 2017 | 12 m |
| CDI (CERTIFICADO DE DEPÓSITO INTERFINANCEIRO) | CDI | 0,54% | 9,93% | 9,93% | 72% | 139% | 140% |
| IMA - GERAL (ÍNDICE DE MERCADO ANBIMA - GERAL) | IMA - Geral | 0,88% | 12,82% | 12,82% | 118% | 179% | 181% |
| IMA-B (ÍNDICE DE MERCADO ANBIMA - B) | IMA-B | 0,83% | 12,79% | 12,79% | 111% | 179% | 181% |
| IMA-B 5 (ÍNDICE DE MERCADO ANBIMA - B 5) | IMA-B 5 | 0,88% | 12,58% | 12,58% | 118% | 176% | 178% |
| IMA-B 5+ (ÍNDICE DE MERCADO ANBIMA - B 5+) | IMA-B 5+ | 0,79% | 12,75% | 12,75% | 105% | 178% | 180% |
| IRF-M (ÍNDICE DE RENDA FIXA DO MERCADO) | IRF-M | 1,24% | 15,20% | 15,20% | 166% | 213% | 215% |
| IRF-M 1 (ÍNDICE DE RENDA FIXA DO MERCADO - 1) | IRF-M 1 | 0,57% | 11,12% | 11,12% | 76% | 156% | 157% |
| IRF-M 1+ (ÍNDICE DE RENDA FIXA DO MERCADO - 1+) | IRF-M 1+ | 1,46% | 16,67% | 16,67% | 195% | 233% | 236% |
| IBOVESPA (ÍNDICE DA BOLSA DE SÃO PAULO) | Ibovespa | 6,16% | 26,86% | 26,86% | 823% | 376% | 380% |
| IBX-50 (ÍNDICE BRASIL 50) | IBX-50 | 6,20% | 26,81% | 26,81% | 829% | 375% | 379% |

RENTABILIDADE DIÁRIA CARTEIRA x INDICES NO MÊS

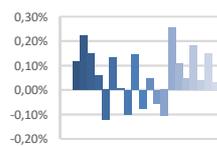
CARTEIRA



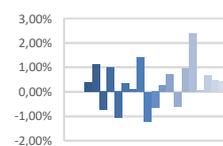
IMA-B



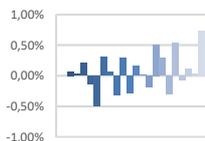
IRF-M



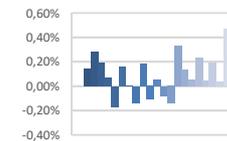
IBOVESPA



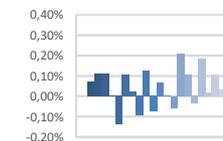
IMA-B 5+



IRF-M +1



IMA Geral



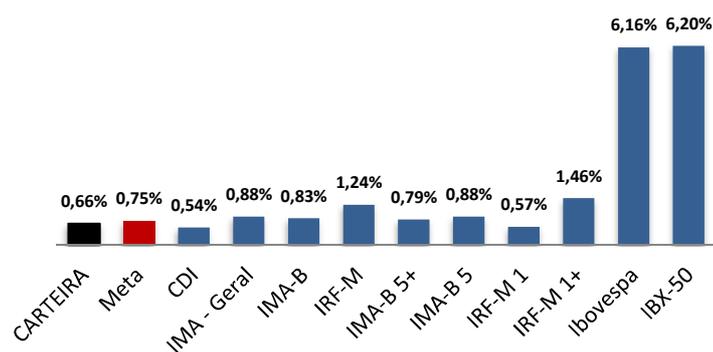


Instituto de Previdência Matinhos

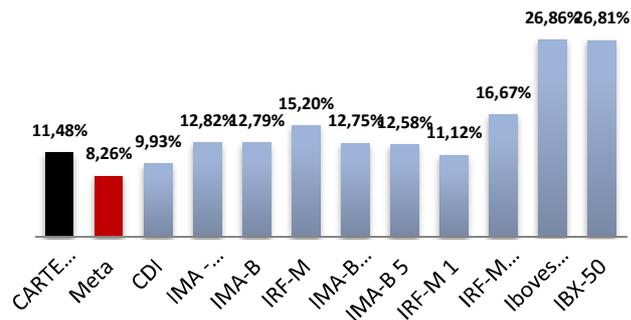
RENTABILIDADE DA CARTEIRA CONSOLIDADA

| PERÍODO | Carteira | Meta | CDI | IMA-B | IMA Geral | p.p Meta | % Meta | % CDI | % IMA-B | % IMA Geral |
|-------------------------|---------------|--------------|--------------|---------------|---------------|-----------------|---------------|---------------|--------------|--------------|
| janeiro-17 | 1,40% | 0,91% | 1,08% | 1,87% | 1,80% | 0,49p.p. | 153,8% | 128,9% | 74,9% | 77,5% |
| fevereiro-17 | 1,51% | 0,73% | 0,86% | 3,85% | 2,26% | 0,78p.p. | 206,8% | 174,3% | 39,1% | 66,5% |
| março-17 | 1,14% | 0,81% | 1,05% | 1,04% | 1,22% | 0,33p.p. | 140,6% | 108,2% | 108,8% | 93,6% |
| abril-17 | 0,63% | 0,57% | 0,79% | -0,32% | 0,29% | 0,06p.p. | 111,0% | 80,2% | -195,7% | 219,6% |
| maio-17 | 0,53% | 0,85% | 0,93% | -1,19% | 0,01% | -0,32p.p. | 62,6% | 57,4% | -44,7% | 4228,2% |
| junho-17 | 0,76% | 0,19% | 0,81% | 0,16% | 0,82% | 0,58p.p. | 412,40% | 94,15% | 464,64% | 93,59% |
| julho-17 | 1,63% | 0,66% | 0,80% | 4,00% | 2,34% | 0,98p.p. | 248,59% | 205,07% | 40,89% | 69,88% |
| agosto-17 | 0,97% | 0,52% | 0,80% | 1,34% | 1,07% | 0,46p.p. | 188,44% | 121,53% | 72,54% | 90,91% |
| setembro-17 | 0,93% | 0,47% | 0,64% | 1,81% | 1,33% | 0,46p.p. | 199,45% | 145,95% | 51,40% | 69,75% |
| outubro-17 | 0,43% | 0,86% | 0,64% | -0,38% | 0,13% | -0,43p.p. | 49,88% | 66,59% | -112,18% | 333,89% |
| novembro-17 | 0,33% | 0,67% | 0,57% | -0,76% | 0,00% | -0,34p.p. | 48,97% | 57,62% | -42,98% | 9196,41% |
| dezembro-17 | 0,66% | 0,75% | 0,54% | 0,83% | 0,88% | -0,08p.p. | 88,82% | 123,57% | 80,22% | 75,32% |
| 2017 (acumulado) | 11,48% | 8,26% | 9,93% | 12,79% | 12,82% | 3,22p.p. | 139,0% | 115,6% | 89,7% | 89,5% |

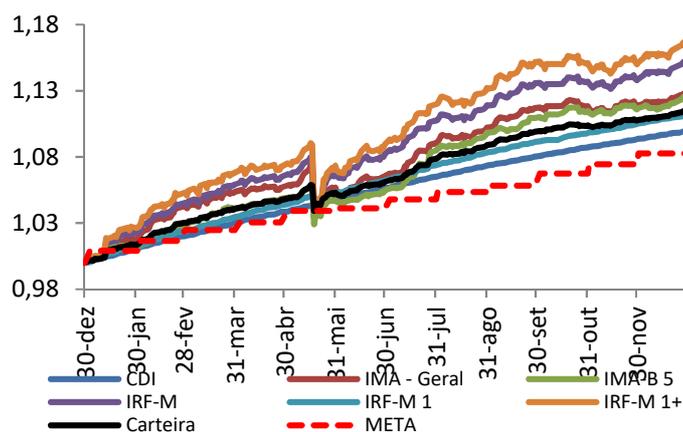
Carteira x Indicadores (dez/17)



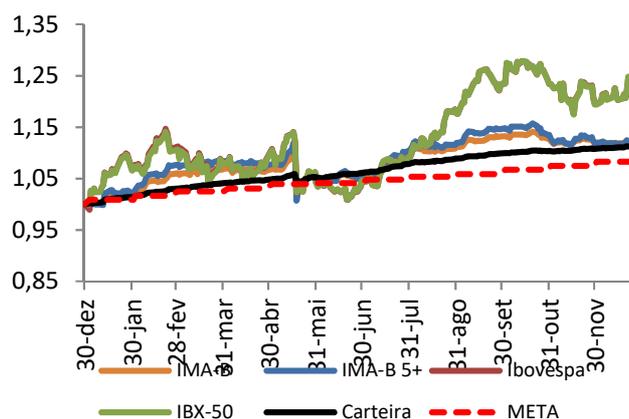
Carteira x Indicadores (2017)



Rentabilidade Diária no Ano (%) - Séries Menor Vol



Rentabilidade Diária no Ano (%) - Séries Maior Vol





Instituto de Previdência Matinhos

PARTICIPAÇÃO DOS FUNDOS NA RENTABILIDADE DA CARTEIRA

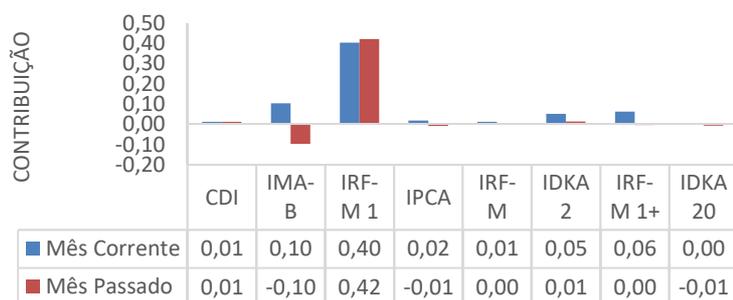
Últimos 6 meses

| FUNDOS DE INVESTIMENTO (FI) | Indexador | Rentabilidade Diária x Peso Diário | | | | | |
|---|-----------|------------------------------------|--------|--------|------|------|------|
| | | dez | nov | out | set | ago | jul |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LP | IDKA 2 | 0,05 | 0,01 | 0,04 | 0,05 | 0,05 | 0,13 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RENDA FIXA | IRF-M 1 | 0,33 | 0,35 | 0,36 | 0,42 | 0,52 | 0,62 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LP | IRF-M 1+ | 0,06 | - 0,00 | - 0,01 | 0,07 | 0,04 | 0,11 |
| FIC-FI CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP | IMA-B | 0,06 | - 0,05 | - 0,03 | 0,13 | 0,10 | 0,27 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RENDA FIXA LP | IMA-B | 0,03 | - 0,03 | - 0,02 | 0,08 | 0,06 | 0,17 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TP FI | IRF-M | 0,01 | 0,00 | 0,00 | 0,01 | 0,01 | 0,02 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TP FI | IMA-B | 0,01 | - 0,01 | - 0,01 | 0,02 | 0,02 | 0,05 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP FIC FI | IRF-M 1 | 0,07 | 0,07 | 0,08 | 0,09 | 0,11 | 0,14 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC-FI | CDI | 0,01 | 0,01 | 0,01 | 0,01 | 0,01 | 0,01 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC-FI | CDI | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 20 TP FI | IDKA 20 | 0,00 | - 0,01 | - 0,01 | 0,01 | 0,00 | 0,02 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP IPCA FI | IPCA | 0,02 | - 0,01 | - 0,00 | 0,03 | 0,03 | 0,07 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TP FI | IDKA 2 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,01 |

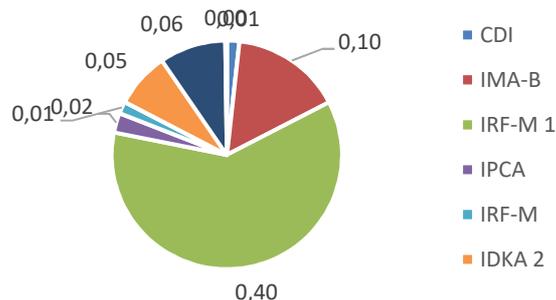
Últimos 6 meses

| FUNDOS DE INVESTIMENTO (FI) | Indexador | Peso Fechamento Carteira | | | | | |
|---|-----------|--------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|
| | | dez | nov | out | set | ago | jul |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LP | IDKA 2 | 6,71% | 6,79% | 6,82% | 6,85% | 6,89% | 6,92% |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RENDA FIXA | IRF-M 1 | 58,31% | 59,05% | 59,08% | 59,52% | 59,56% | 59,59% |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LP | IRF-M 1+ | 5,32% | 5,39% | 5,41% | 5,00% | 5,02% | 5,05% |
| FIC-FI CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP | IMA-B | 5,87% | 5,94% | 5,97% | 6,00% | 6,03% | 6,06% |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RENDA FIXA LP | IMA-B | 3,78% | 3,82% | 3,84% | 3,86% | 3,88% | 3,90% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TP FI | IRF-M | 0,44% | 0,45% | 0,45% | 0,45% | 0,45% | 0,46% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TP FI | IMA-B | 0,64% | 0,64% | 0,65% | 0,65% | 0,65% | 0,66% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP FIC FI | IRF-M 1 | 12,00% | 12,14% | 12,19% | 12,26% | 12,31% | 12,38% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC-FI | CDI | 2,98% | 1,76% | 1,52% | 1,30% | 1,08% | 0,84% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC-FI | CDI | 0,63% | 0,64% | 0,64% | 0,64% | 0,65% | 0,65% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 20 TP FI | IDKA 20 | 0,54% | 0,55% | 0,55% | 0,56% | 0,56% | 0,56% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP IPCA FI | IPCA | 2,37% | 2,40% | 2,47% | 2,48% | 2,50% | 2,51% |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TP FI | IDKA 2 | 0,42% | 0,43% | 0,43% | 0,43% | 0,43% | 0,43% |

Contribuição por Indexador - dez/17 contra nov/17



Contribuição por Indexador - Global dez/17





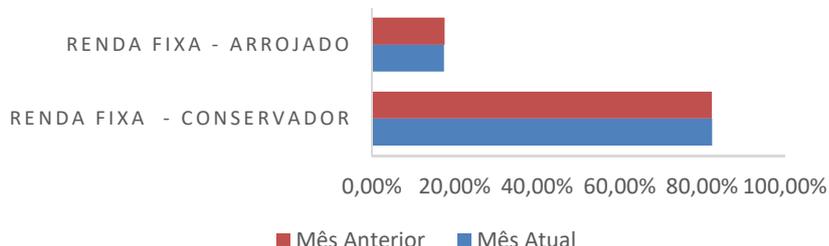
DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES

| ÍNDICES | nov/17 | dez/17 |
|------------------|---------------|---------------|
| CDI | 2,07% | 3,09% |
| IRF-M | 76,91% | 76,06% |
| IRF-M | 0,94% | 0,93% |
| IRF-M 1 | 71,48% | 70,65% |
| IRF-M 1+ | 4,49% | 4,48% |
| IMA-B | 12,75% | 12,65% |
| IMA-B | 12,75% | 12,65% |
| IMA-B 5 | 0,00% | 0,00% |
| IMA-B 5+ | 0,00% | 0,00% |
| IMA Geral | 0,00% | 0,00% |
| IDkA | 6,37% | 6,32% |
| IDkA 2 | 5,98% | 5,93% |
| IDkA 20 | 0,39% | 0,39% |
| Outros RF | 0,00% | 0,00% |
| RV | 0,00% | 0,00% |
| Ibovespa | 0,00% | 0,00% |
| IBrX | 0,00% | 0,00% |
| IBrX-50 | 0,00% | 0,00% |
| Outros RV | 0,00% | 0,00% |
| IPCA | 1,90% | 1,88% |

Conceitos

CDI = FIDC + Multimercados + LFT + FI no qual o índice é o CDI
IRF-M = FI no qual o índice é o IRF-M
IRF-M 1 = NTN-F e/ou LTN com vencimento igual ou inferior a 1 ano + FI no qual o índice é o IRF-M 1
IRF-M 1+ = NTN-F e/ou LTN com vencimento superior a 1 ano + FI no qual o índice é o IRF-M 1+
IMA-B = FI no qual o índice é o IMA-B
IMA-B 5 = NTN-B com vencimento igual ou inferior a 5 anos + FI no qual o índice é o IMA-B 5
IMA-B 5+ = NTN-B com vencimento superior a 5 anos + FI no qual o índice é o IMA-B 5+
IMA Geral = FI no qual o índice é o IMA Geral
IDkA = Fundos com o benchmark IDkA
Outros RF = Fundos de Renda Fixa com outro índice de referência
Ibovespa = FIA no qual o índice é o Ibovespa
IBrX = FIA no qual o índice é o IBrX
IBrX-50 = FIA no qual o índice é o IBrX-50
Outros = FIA no qual o índice não é Ibovespa, IBrX ou IBrX-50
IPCA = Fundos que tem o indicador de desempenho atrelado ao IPCA ou uma composição que inclua o IPCA.

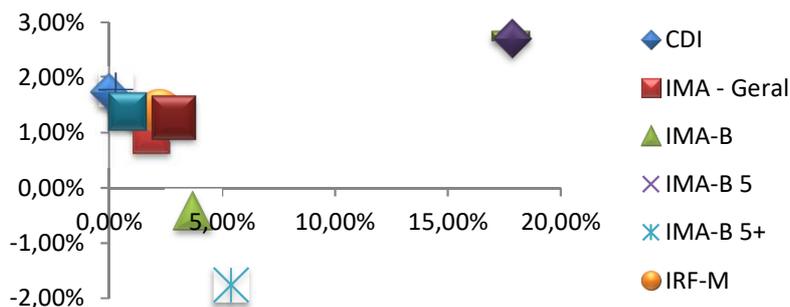
Distribuição da Carteira por Classes (mensalmente)



Classificação Classes de Fundos

1) Renda Fixa - Arrojado = IMA - B 5+ | IMA-B | IRF-M | IRF-M 1+ | IDkA 20, 2) Renda Fixa - Conservador = CDI | IRF-M 1 | IMA-B 5 | IMA Geral | IDkA | Outros, 3) Multimercados, 4) Fundos de Participação, 5) Renda Variável, 6) Fundos Imobiliários

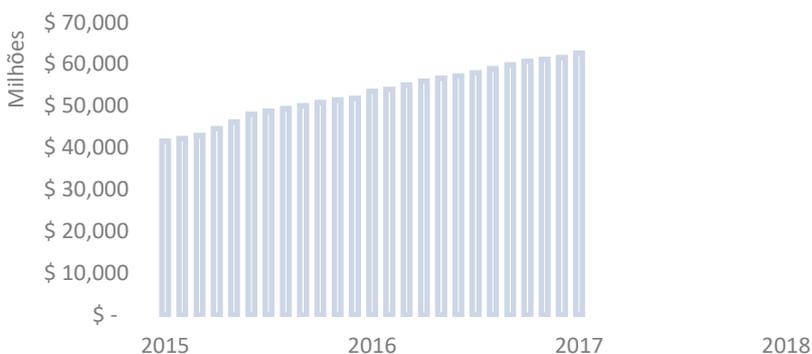
Relação Risco x Retorno da Carteira (em 3 meses)



Análise de Risco e Retorno

O gráfico acima mostra o retorno nos últimos 3 meses no eixo vertical e o risco (volatilidade anualizada calculada nos últimos 3 meses) no eixo horizontal. Carteiras de investimento devem apresentar a melhor relação de risco e retorno, comparativamente aos índices de referência, conforme pode ser observado.

Evolução do Patrimônio (em R\$ milhões)





Instituto de Previdência Matinhos

ENQUADRAMENTO DA CARTEIRA POR APLICAÇÕES

| Segmento de Renda Fixa | | | | | | | |
|----------------------------|---|--------------|--------------|--------------|----------------------|---------------|------------|
| Artigo | Tipo de Ativo / Condições de Enquadramento | Limite 3.922 | Limite 4.392 | Limite da PI | Total (R\$) | % da Carteira | Status |
| 7º | Renda Fixa e Títulos Públicos | 100% | 100% | 100% | 62.613.803,27 | 99,22% | Enquadrado |
| 7º, I | Fundos 100% Títulos Públicos ou 100% Títulos Públicos | 100% | 100% | 100% | 55.061.233,46 | 87,25% | Enquadrado |
| 7º, I, a | Títulos do Tesouro Nacional / Neg. plataforma eletrônica | 100% | 100% | 100% | - | 0,00% | Enquadrado |
| 7º, I, b | FI 100% TN / Condomínio aberto e Indexador IMA ou IDkA | 100% | 100% | 100% | 55.061.233,46 | 87,25% | Enquadrado |
| 7º, II | Operações Compromissadas Lastro 100% Títulos Públicos | 15% | 15% | 15% | - | 0,00% | Enquadrado |
| 7º, III | Fundos de Renda Fixa IMA ou IDkA | 80% | 80% | 80% | 4.438.155,50 | 7,03% | Enquadrado |
| 7º, III, a | FI Renda Fixa ou Referenciados / Cond. Abertos / Indexador IMA ou IDkA, com exceção do DI | 80% | 80% | 80% | 4.438.155,50 | 7,03% | Enquadrado |
| 7º, III, b | FI de Renda Fixa / Indexador IMA ou IDkA, exceção DI | 80% | 80% | 80% | - | 0,00% | Enquadrado |
| 7º, IV | Fundos Renda Fixa Geral | 30% | 30% | 30% | 3.114.414,31 | 4,94% | Enquadrado |
| 7º, IV, a | FI Renda Fixa ou Referenciados / Indexador de Renda Fixa | 30% | 30% | 30% | 3.114.414,31 | 4,94% | Enquadrado |
| 7º, IV, b | FI de Renda Fixa / Índices de Referência de Renda Fixa | 30% | 30% | 30% | - | 0,00% | Enquadrado |
| 7º, V | Depósito em Poupança / Letras Imobiliárias Garantidas | 20% | 20% | 20% | - | 0,00% | Enquadrado |
| 7º, V, a | Depósito em Poupança | 20% | 20% | 20% | - | 0,00% | Enquadrado |
| 7º, V, b | Letras Imobiliárias Garantidas | 20% | 20% | 20% | - | 0,00% | Enquadrado |
| 7º, VI e VII | FIDCs ou Fundos Renda Fixa Crédito Privado | 15% | 18,75% | 15% | - | 0,00% | Enquadrado |
| 7º, VI | FIDCs (Fundos de Inv. Em Direitos Creditórios) Abertos | 15% | 18,75% | 15% | - | 0,00% | Enquadrado |
| 7º, VII | FIDCs Fechados e Fundos Renda Fixa Crédito Privado | 5% | 6,25% | 5% | - | 0,00% | Enquadrado |
| 7º, VII, a | FIDC Fechado / Condomínio fechado | 5% | 5% | 5% | - | 0,00% | Enquadrado |
| 7º, VII, b | FI Renda Fixa ou Referenciados / Crédito privado no Nome | 5% | 5% | 5% | - | 0,00% | Enquadrado |
| Segmento de Renda Variável | | | | | | | |
| Artigo | Tipo de Ativo | Limite 3.922 | Limite 4.392 | Limite da PI | Total (R\$) | % da Carteira | Status |
| 8º | Renda Variável | 30% | 30% | 30% | - | 0,00% | Enquadrado |
| 8º, I | FI Referenciados / Index. Ibovespa, IBrX ou IBrX-50, exclusiv. | 30% | 30,00% | 30% | - | 0,00% | Enquadrado |
| 8º, II | FI Índices Ref. Ações / Index Ibov, IBrX ou IBrX-50, exclusiv. | 20% | 20,00% | 20% | - | 0,00% | Enquadrado |
| 8º, III | FI em Ações / Condomínio aberto | 15% | 15,00% | 15% | - | 0,00% | Enquadrado |
| 8º, IV | FI Multimercado / Condomínio aberto e sem alavancagem | 5% | 6,25% | 5% | - | 0,00% | Enquadrado |
| 8º, V | FI em Participações / Condomínio fechado | 5% | 6,25% | 5% | - | 0,00% | Enquadrado |
| 8º, VI | FI Imobiliário / Cotas negociadas em bolsa de valores | 5% | 6,25% | 5% | - | 0,00% | Enquadrado |
| 9º | Imóveis Vinculados por LEI ao RPPS | 100% | 100% | 100% | - | 0 | Enquadrado |
| - | Disponibilidade de Caixa - Conta Corrente | 100% | 100% | 100% | 494.849,43 | 0 | |
| TOTAL DA CARTEIRA | | | | | 63.108.652,70 | 99,2% | |

Comentários:

A Carteira de investimentos encontra-se enquadrada de acordo com a Resolução 3.922/4.392 do CMN.



Instituto de Previdência Matinhos

ENQUADRAMENTO DA CARTEIRA POR FUNDOS

| FUNDOS DE INVESTIMENTO (FI) | Art | Enquadramento por PL | | | v | 25% |
|---|------------|----------------------|-------------------|-------|-----|-----|
| | | PL dez/17 | PL Fundo | % | | |
| FI de Renda Fixa | | | | | | |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LP | 7°, I, b | 3.451.667,46 | 4.324.047.951,59 | 0,08% | Sim | |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RENDA FIXA | 7°, I, b | 36.405.139,68 | 17.173.437.880,47 | 0,21% | Sim | |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LP | 7°, I, b | 2.805.307,72 | 1.369.000.972,62 | 0,20% | Sim | |
| FIC-FI CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP | 7°, III, a | 4.438.155,50 | 2.480.853.390,51 | 0,18% | Sim | |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RENDA FIXA LP | 7°, I, b | 2.679.787,87 | 4.084.421.859,82 | 0,07% | Sim | |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TP FI | 7°, I, b | 583.628,22 | 4.707.912.251,54 | 0,01% | Sim | |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TP FI | 7°, I, b | 799.586,42 | 4.560.051.410,85 | 0,02% | Sim | |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP FIC FI | 7°, I, b | 7.833.087,13 | 12.272.521.315,53 | 0,06% | Sim | |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC-FI | 7°, IV, a | 1.580.212,47 | 1.263.019.749,86 | 0,13% | Sim | |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC-FI | 7°, IV, a | 355.152,14 | 4.205.421.961,32 | 0,01% | Sim | |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 20 TP FI | 7°, I, b | 241.329,49 | 22.865.988,15 | 1,06% | Sim | |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP IPCA FI | 7°, IV, a | 1.179.049,70 | 284.370.739,51 | 0,41% | Sim | |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TP FI | 7°, I, b | 261.699,47 | 5.436.556.596,64 | 0,00% | Sim | |

LEGENDA:



Resgates Efetuados em 2017



Aplicações Novos Fundos em 2017



Instituto de Previdência Matinhos

DAIR - INFORMAÇÕES DE FUNDOS

FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LP

| CNPJ Fundo | Segmento | Tipo de Ativo | Data Início | Resgate | Em Enquad. | Categoria Investidor |
|--|-------------------|--------------------|-------------|-------------------------|------------|----------------------|
| 14.386.926/0001-71 | Renda Fixa | 7°, I, b | 16/08/2012 | 0 | Não | Geral |
| Administrador | | CNPJ Administrador | | Gestor | | CNPJ Gestor |
| Caixa Econômica Federal | | 00.360.305/0001-04 | | Caixa Econômica Federal | | 00.360.305/0001-04 |
| Características dos Ativos | | | | | | |
| Aplicação 100% em Títulos Públicos Indexados à Inflação de curta maturidade | | | | | | |
| Descrição da Operação | | | | | | |
| O objetivo do FUNDO é proporcionar ao Cotista a valorização de suas cotas por meio da aplicação em carteira composta por títulos públicos federais, buscando acompanhar o Índice de Duração Constante ANBIMA – segmento IPCA 2A (IDKa IPCA 2A), não constituindo, em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da ADMINISTRADORA. | | | | | | |
| FI Cotas | Fundos Investidos | | | | | |
| Não | Não aplica | | | | | |

FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RENDA FIXA

| CNPJ Fundo | Segmento | Tipo de Ativo | Data Início | Resgate | Em Enquad. | Categoria Investidor |
|--|-------------------|--------------------|-------------|-------------------------|------------|----------------------|
| 10.740.670/0001-06 | Renda Fixa | 7°, I, b | 28/05/2010 | 0 | Não | Geral |
| Administrador | | CNPJ Administrador | | Gestor | | CNPJ Gestor |
| Caixa Econômica Federal | | 00.360.305/0001-04 | | Caixa Econômica Federal | | 00.360.305/0001-04 |
| Características dos Ativos | | | | | | |
| Aplicação 100% em Títulos Públicos Pré-fixados de curta maturidade | | | | | | |
| Descrição da Operação | | | | | | |
| O objetivo do FUNDO é proporcionar ao Cotista a valorização de suas cotas por meio da aplicação dos recursos em carteira composta por títulos públicos federais, buscando acompanhar o Índice de Renda Fixa de Mercado 1 - IRF-M 1, não constituindo, em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da ADMINISTRADORA. O prazo médio da carteira do FUNDO será de até 365 (trezentos e sessenta e cinco) dias. | | | | | | |
| FI Cotas | Fundos Investidos | | | | | |
| Não | Não aplica | | | | | |

FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LP

| CNPJ Fundo | Segmento | Tipo de Ativo | Data Início | Resgate | Em Enquad. | Categoria Investidor |
|---|-------------------|--------------------|-------------|-------------------------|------------|----------------------|
| 10.577.519/0001-90 | Renda Fixa | 7°, I, b | 11/05/2012 | 0 | Não | Geral |
| Administrador | | CNPJ Administrador | | Gestor | | CNPJ Gestor |
| Caixa Econômica Federal | | 00.360.305/0001-04 | | Caixa Econômica Federal | | 00.360.305/0001-04 |
| Características dos Ativos | | | | | | |
| Aplicação 100% em Títulos Públicos Pré-fixados de curta maturidade | | | | | | |
| Descrição da Operação | | | | | | |
| O objetivo do FUNDO é proporcionar ao Cotista a valorização de suas cotas por meio da aplicação dos recursos em carteira composta por títulos públicos federais, buscando acompanhar o Índice de Renda Fixa de Mercado 1+ (IRF-M 1+), não constituindo, em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da ADMINISTRADORA | | | | | | |
| FI Cotas | Fundos Investidos | | | | | |
| Não | Não aplica | | | | | |

FIC-FI CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP

| CNPJ Fundo | Segmento | Tipo de Ativo | Data Início | Resgate | Em Enquad. | Categoria Investidor |
|--|--|--------------------|-------------|-------------------------|------------|----------------------|
| 10.646.895/0001-90 | Renda Fixa | 7°, III, a | 27/10/2009 | 0 | Não | Geral |
| Administrador | | CNPJ Administrador | | Gestor | | CNPJ Gestor |
| Caixa Econômica Federal | | 00.360.305/0001-04 | | Caixa Econômica Federal | | 00.360.305/0001-04 |
| Características dos Ativos | | | | | | |
| Aplicação Mín 51% em Títulos Públicos Indexados à Inflação | | | | | | |
| Descrição da Operação | | | | | | |
| O objetivo do FUNDO é proporcionar ao Cotista a valorização de suas cotas por meio da aplicação dos recursos em cotas de fundos de investimento que apliquem em ativos financeiros de renda fixa, com prazo médio superior a 365 (trezentos e sessenta e cinco) dias, buscando acompanhar o subíndice Índice IMA-B, não constituindo em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da ADMINISTRADORA | | | | | | |
| FI Cotas | Fundos Investidos | | | | | |
| Sim | 100% 10.740.739/0001-93 CAIXA MASTER BRASIL IMA-B FI RENDA FIXA LP | | | | | |



Instituto de Previdência Matinhos

DAIR - INFORMAÇÕES DE FUNDOS

FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RENDA FIXA LP

| CNPJ Fundo | Segmento | Tipo de Ativo | Data Início | Resgate | Em Enquad. | Categoria Investidor |
|---|-------------------|--------------------|-------------|-------------------------|------------|----------------------|
| 10.740.658/0001-93 | Renda Fixa | 7°, I, b | 08/03/2010 | 0 | Não | Geral |
| Administrador | | CNPJ Administrador | | Gestor | | CNPJ Gestor |
| Caixa Econômica Federal | | 00.360.305/0001-04 | | Caixa Econômica Federal | | 00.360.305/0001-04 |
| Características dos Ativos | | | | | | |
| Aplicação 100% em Títulos Públicos Indexados à Inflação de curta maturidade | | | | | | |
| Descrição da Operação | | | | | | |
| O objetivo do FUNDO é proporcionar ao Cotista a valorização de suas cotas por meio da aplicação em carteira composta por títulos públicos federais, buscando acompanhar o subíndice Índice de Mercado ANBIMA série B - IMA-B, não constituindo, em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da ADMINISTRADORA | | | | | | |
| FI Cotas | Fundos Investidos | | | | | |
| Não | Não aplica | | | | | |

BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TP FI

| CNPJ Fundo | Segmento | Tipo de Ativo | Data Início | Resgate | Em Enquad. | Categoria Investidor |
|---|-------------------|--------------------|-------------|--------------------------------|------------|----------------------|
| 07.111.384/0001-69 | Renda Fixa | 7°, I, b | 08/12/2004 | 1 | Não | Geral |
| Administrador | | CNPJ Administrador | | Gestor | | CNPJ Gestor |
| BB Gestão de Recursos DTVM S/A | | 30.822.936/0001-69 | | BB Gestão de Recursos DTVM S/A | | 30.822.936/0001-69 |
| Características dos Ativos | | | | | | |
| Aplicação 100% em Títulos Públicos Pré-fixados de média maturidade | | | | | | |
| Descrição da Operação | | | | | | |
| O FUNDO tem como objetivo proporcionar a rentabilidade de suas cotas, através da diversificação dos ativos financeiros que compõem sua carteira, de forma a acompanhar as variações diárias da taxa de juros doméstica e/ou de índices de preços. | | | | | | |
| FI Cotas | Fundos Investidos | | | | | |
| Não | Não aplica | | | | | |

BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TP FI

| CNPJ Fundo | Segmento | Tipo de Ativo | Data Início | Resgate | Em Enquad. | Categoria Investidor |
|--|-------------------|--------------------|-------------|--------------------------------|------------|----------------------|
| 07.442.078/0001-05 | Renda Fixa | 7°, I, b | 24/07/2005 | 1 | Não | Geral |
| Administrador | | CNPJ Administrador | | Gestor | | CNPJ Gestor |
| BB Gestão de Recursos DTVM S/A | | 30.822.936/0001-69 | | BB Gestão de Recursos DTVM S/A | | 30.822.936/0001-69 |
| Características dos Ativos | | | | | | |
| Aplicação 100% em Títulos Públicos Indexados à inflação de média maturidade | | | | | | |
| Descrição da Operação | | | | | | |
| O FUNDO tem como objetivo proporcionar a rentabilidade de suas cotas, mediante aplicação de seus recursos em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais disponíveis no âmbito do mercado financeiro. | | | | | | |
| FI Cotas | Fundos Investidos | | | | | |
| Não | Não aplica | | | | | |

BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP FIC FI

| CNPJ Fundo | Segmento | Tipo de Ativo | Data Início | Resgate | Em Enquad. | Categoria Investidor |
|---|---|--------------------|-------------|--------------------------------|------------|----------------------|
| 11.328.882/0001-35 | Renda Fixa | 7°, I, b | 08/12/2009 | 0 | Não | Geral |
| Administrador | | CNPJ Administrador | | Gestor | | CNPJ Gestor |
| BB Gestão de Recursos DTVM S/A | | 30.822.936/0001-69 | | BB Gestão de Recursos DTVM S/A | | 30.822.936/0001-69 |
| Características dos Ativos | | | | | | |
| Aplicação 100% em Títulos Públicos Pré-fixados de curta maturidade | | | | | | |
| Descrição da Operação | | | | | | |
| O FUNDO tem como objetivo proporcionar a rentabilidade de suas cotas, mediante aplicação de seus recursos em cotas de fundos de investimento que têm em sua composição 100% em Títulos Públicos Federais, e atendam aos limites e garantias exigidas pela Resolução 3.922/10 do CMN, doravante denominados FIs. | | | | | | |
| FI Cotas | Fundos Investidos | | | | | |
| Sim | 100 % BB IRF-M 1 FI RENDA FIXA CNPJ: 11.839.250/0001-36 | | | | | |



Instituto de Previdência Matinhos

DAIR - INFORMAÇÕES DE FUNDOS

BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC-FI

| CNPJ Fundo | Segmento | Tipo de Ativo | Data Início | Resgate | Em Enquad. | Categoria Investidor |
|---|---|--------------------|-------------|--------------------------------|------------|----------------------|
| 13.077.415/0001-05 | Renda Fixa | 7°, IV, a | 28/04/2011 | 0 | Não | Geral |
| Administrador | | CNPJ Administrador | | Gestor | | CNPJ Gestor |
| BB Gestão de Recursos DTVM S/A | | 30.822.936/0001-69 | | BB Gestão de Recursos DTVM S/A | | 30.822.936/0001-69 |
| Características dos Ativos | | | | | | |
| Aplicação Pós Fixada ou Ativa com Mínimo 51% títulos públicos | | | | | | |
| Descrição da Operação | | | | | | |
| O FUNDO tem como objetivo proporcionar a rentabilidade de suas cotas, mediante aplicação de seus recursos em cotas de fundos de investimento que atendam aos limites e garantias exigidas pela Resolução 3922/10 do CMN, doravante denominados Fls. | | | | | | |
| FI Cotas | Fundos Investidos | | | | | |
| Sim | 100% BB TOP TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS FI RENDA FIXA | | | | | |

BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FIC-FI

| CNPJ Fundo | Segmento | Tipo de Ativo | Data Início | Resgate | Em Enquad. | Categoria Investidor |
|---|--|--------------------|-------------|--------------------------------|------------|----------------------|
| 13.077.418/0001-49 | Renda Fixa | 7°, IV, a | 28/04/2011 | 0 | Não | Geral |
| Administrador | | CNPJ Administrador | | Gestor | | CNPJ Gestor |
| BB Gestão de Recursos DTVM S/A | | 30.822.936/0001-69 | | BB Gestão de Recursos DTVM S/A | | 30.822.936/0001-69 |
| Características dos Ativos | | | | | | |
| Aplicação Pós Fixada ou Ativa com Mínimo 51% títulos públicos | | | | | | |
| Descrição da Operação | | | | | | |
| O FUNDO tem como objetivo proporcionar a rentabilidade de suas cotas, através da diversificação dos ativos financeiros que compõem sua carteira, mediante aplicação de seus recursos em cotas de fundos de investimento, doravante denominados Fls. | | | | | | |
| FI Cotas | Fundos Investidos | | | | | |
| Sim | 50% BB TOP RF ARROJADO FI RENDA FIXA LP 03.389.374/0001-39 50% BB TOP RF MODERADO FI RENDA FIXA LP 01.608.572/0001-10 | | | | | |

BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 20 TP FI

| CNPJ Fundo | Segmento | Tipo de Ativo | Data Início | Resgate | Em Enquad. | Categoria Investidor |
|--|-------------------|--------------------|-------------|--------------------------------|------------|----------------------|
| 15.775.748/0001-33 | Renda Fixa | 7°, I, b | 08/08/2012 | 2 | Não | Geral |
| Administrador | | CNPJ Administrador | | Gestor | | CNPJ Gestor |
| BB Gestão de Recursos DTVM S/A | | 30.822.936/0001-69 | | BB Gestão de Recursos DTVM S/A | | 30.822.936/0001-69 |
| Características dos Ativos | | | | | | |
| Aplicação 100% em Títulos Públicos Pré-fixados de curta maturidade | | | | | | |
| Descrição da Operação | | | | | | |
| O FUNDO tem como objetivo proporcionar a rentabilidade de suas cotas, mediante aplicação de seus recursos em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais disponíveis no âmbito do mercado financeiro. | | | | | | |
| FI Cotas | Fundos Investidos | | | | | |
| Não | Não aplica | | | | | |

BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP IPCA FI

| CNPJ Fundo | Segmento | Tipo de Ativo | Data Início | Resgate | Em Enquad. | Categoria Investidor |
|---|-------------------|--------------------|-------------|--------------------------------|------------|----------------------|
| 15.486.093/0001-83 | Renda Fixa | 7°, IV, a | 23/01/2014 | 0 | Não | Geral |
| Administrador | | CNPJ Administrador | | Gestor | | CNPJ Gestor |
| BB Gestão de Recursos DTVM S/A | | 30.822.936/0001-69 | | BB Gestão de Recursos DTVM S/A | | 30.822.936/0001-69 |
| Características dos Ativos | | | | | | |
| Aplica seus recursos exclusivamente em títulos públicos federais | | | | | | |
| Descrição da Operação | | | | | | |
| O FUNDO tem como objetivo proporcionar a rentabilidade de suas cotas, mediante aplicação de seus recursos em carteira diversificada de ativos financeiros de renda fixa, obtendo níveis de rentabilidade compatíveis com o Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo – IPCA + 6,0% a.a., não constituindo em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da ADMINISTRADORA.. | | | | | | |
| FI Cotas | Fundos Investidos | | | | | |
| Não | Não aplica | | | | | |



Instituto de Previdência Matinhos

DAIR - INFORMAÇÕES DE FUNDOS

| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TP FI | | | | | | |
|--|-------------------|--------------------|-------------|--------------------------------|------------|----------------------|
| CNPJ Fundo | Segmento | Tipo de Ativo | Data Início | Resgate | Em Enquad. | Categoria Investidor |
| 13.322.205/0001-35 | Renda Fixa | 7°, I, b | 28/04/2011 | 1 | Não | Geral |
| Administrador | | CNPJ Administrador | | Gestor | | CNPJ Gestor |
| BB Gestão de Recursos DTVM S/A | | 30.822.936/0001-69 | | BB Gestão de Recursos DTVM S/A | | 30.822.936/0001-69 |
| Características dos Ativos | | | | | | |
| Aplicação 100% em Títulos Públicos Pré-fixados de curta maturidade | | | | | | |
| Descrição da Operação | | | | | | |
| O FUNDO tem como objetivo proporcionar a rentabilidade de suas cotas, mediante aplicação de seus recursos em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais disponíveis no âmbito do mercado financeiro. | | | | | | |
| FI Cotas | Fundos Investidos | | | | | |
| Não | Não aplica | | | | | |



Instituto de Previdência Matinhos

DAIR - APR Movimentações

| | Quantidade Cotas | Movimentação (R\$) | Valor Cota | PL Fundo |
|--|------------------|--------------------|--------------|-----------------------|
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RENDA FIXA | | | | |
| 10.740.670/0001-06 | | | | |
| Resgates | | | | |
| 07/12/2017 | 46.397,65700000 | -R\$ 102.367,80 | 2,2063140000 | R\$ 16.507.970.394,43 |
| 13/12/2017 | 33.719,26680700 | -R\$ 74.489,30 | 2,2091020000 | R\$ 16.926.900.581,96 |
| 20/12/2017 | 43.844,53273800 | -R\$ 96.987,57 | 2,2120790000 | R\$ 16.582.760.918,67 |
| Aplicações | | | | |
| 01/12/2017 | 111.800,24150000 | R\$ 246.376,54 | 2,2037210000 | R\$ 16.335.620.105,63 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC-FI | | | | |
| 13.077.415/0001-05 | | | | |
| Resgates | | | | |
| 11/12/2017 | 106.944,87278100 | -R\$ 200.994,69 | 1,8794233400 | R\$ 1.269.307.970,83 |
| 18/12/2017 | 173.671,91223000 | -R\$ 326.764,26 | 1,8815032100 | R\$ 1.629.130.088,86 |
| Aplicações | | | | |
| 05/12/2017 | 127.653,70388700 | R\$ 239.702,85 | 1,8777586800 | R\$ 1.123.353.976,29 |
| 07/12/2017 | 54.490,07703200 | R\$ 102.367,80 | 1,8786503100 | R\$ 1.202.369.667,05 |
| 08/12/2017 | 100.443,96925600 | R\$ 188.738,17 | 1,8790393400 | R\$ 1.272.262.860,25 |
| 13/12/2017 | 39.616,78911000 | R\$ 74.489,30 | 1,8802491000 | R\$ 1.398.663.503,84 |
| 28/12/2017 | 305.352,64460940 | R\$ 575.393,50 | 1,8843573400 | R\$ 1.259.786.423,65 |



Instituto de Previdência Matinhos

DAIR - Carteira

Data-Base: 29/12/2017

| Segmento | Enquad. | CNPJ FUNDO | Cotas | | PL Investido | PL Fundo | |
|-------------------------------------|------------|--------------------|-------------------|--------------|-------------------|-----------------------|--|
| | | | Qtde | Valor | | | |
| | | | (Conferir) | (Alterar) | (Conferir) | (Alterar) | |
| Renda Fixa | 7°, I, b | 14.386.926/0001-71 | 1.890.482,460576 | 1,8258130038 | R\$ 3.451.667,46 | R\$ 4.324.047.951,59 | |
| Renda Fixa | 7°, I, b | 10.740.670/0001-06 | 16.431.018,502970 | 2,2156349999 | R\$ 36.405.139,68 | R\$ 17.173.437.880,47 | |
| Renda Fixa | 7°, I, b | 10.577.519/0001-90 | 1.499.607,203938 | 1,8706950144 | R\$ 2.805.307,72 | R\$ 1.369.000.972,62 | |
| Renda Fixa | 7°, III, a | 10.646.895/0001-90 | 1.654.843,232946 | 2,6819189949 | R\$ 4.438.155,50 | R\$ 2.480.853.390,51 | |
| Renda Fixa | 7°, I, b | 10.740.658/0001-93 | 1.064.296,483580 | 2,5178960105 | R\$ 2.679.787,87 | R\$ 4.084.421.859,82 | |
| Renda Fixa | 7°, I, b | 07.111.384/0001-69 | 124.803,793686 | 4,6763660203 | R\$ 583.628,22 | R\$ 4.707.912.251,54 | |
| Renda Fixa | 7°, I, b | 07.442.078/0001-05 | 179.420,558056 | 4,4564927713 | R\$ 799.586,42 | R\$ 4.560.051.410,85 | |
| Renda Fixa | 7°, I, b | 11.328.882/0001-35 | 3.381.152,332249 | 2,3166915774 | R\$ 7.833.087,13 | R\$ 12.272.521.315,53 | |
| Renda Fixa | 7°, IV, a | 13.077.415/0001-05 | 838.392,706937 | 1,8848118035 | R\$ 1.580.212,47 | R\$ 1.263.019.749,86 | |
| Renda Fixa | 7°, IV, a | 13.077.418/0001-49 | 177.652,400001 | 1,9991406815 | R\$ 355.152,14 | R\$ 4.205.421.961,32 | |
| Renda Fixa | 7°, I, b | 15.775.748/0001-33 | 153.235,968546 | 1,5748880128 | R\$ 241.329,49 | R\$ 22.865.988,15 | |
| Renda Fixa | 7°, IV, a | 15.486.093/0001-83 | 667.146,850931 | 1,7673016044 | R\$ 1.179.049,70 | R\$ 284.370.739,51 | |
| Renda Fixa | 7°, I, b | 13.322.205/0001-35 | 118.638,249575 | 2,2058608496 | R\$ 261.699,47 | R\$ 5.436.556.596,64 | |
| Disponibilidades Financeiras | | | | | | 494.849,43 | |
| Total | | | | | R\$ | 63.108.652,70 | |

Informações:

A AMX CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS LTDA (“AMX Capital – Consultoria de Investimentos”) é uma consultoria de valores mobiliários com funcionamento autorizado pela Comissão de Valores Mobiliário (CVM), com especialidade no segmento previdenciário e institucional. Através do Ato Declaratório de nº 14.576, de 20 de outubro de 2015, o Superintendente de Relações com Investidores Institucionais da Comissão de Valores Mobiliários, no uso da competência que lhe foi delegada pela Deliberação CVM nº 158, de 21/07/93, autoriza a AMX CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS LTDA, C.N.P.J. nº 22.863.573/0001-81, a prestar os serviços de Consultor de Valores Mobiliários, previstos no artigo 27 da lei nº 6.385/76, de 07 de dezembro de 1976.

**Fale Conosco**

Av. Rio Branco, 333, Sala 1208
Florianópolis – SC – Centro
CEP: 88.015-201
Fone: (48) 3232-2290
contato@amxcapital.com.br