Instituto de Previdência Matinhos - PR

[RELATÓRIO MENSAL DE GESTÃO]

Novembro - 2018

VERSÃO 4.0

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

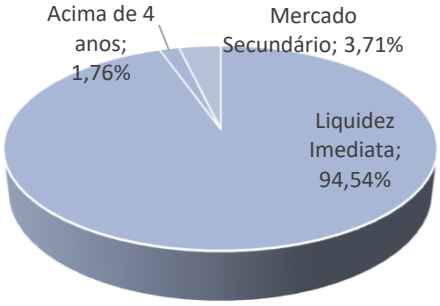
Carteira de Investimentos - Composição 1
Carteira de Investimentos – Riscos 2
Carteira de Investimentos – Evolução Mensal 3
Rentabilidade dos Fundos de Investimento 4
Rentabilidade da Carteira Consolidada 5
Participação dos Fundos na Rentabilidade da Carteira 6
Distribuição da Carteira por Índices e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

Instituto de Previdência Matinhos

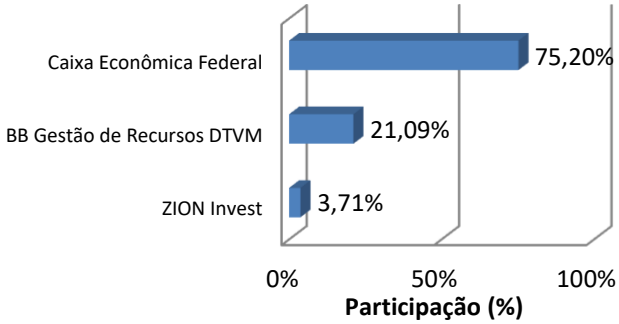
CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - COMPOSIÇÃO

FUNDOS DE INVESTIMENTO (FI)	outubro-18		novembro-18	%
FI de Renda Fixa	**66.403.140,04**		**66.923.610,03**	**0,78%**
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LP	4.154.982,03		4.160.484,15	0,13%
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RENDA FIXA	35.620.632,75	↑	35.827.976,79	0,58%
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LP	4.082.967,07		4.131.322,01	1,18%
FIC-FI CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	4.887.134,34		4.932.101,40	0,92%
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RENDA FIXA LP	2.948.835,62		2.975.306,81	0,90%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TP FI	629.331,93		635.499,64	0,98%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TP FI	879.310,61		887.297,77	0,91%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP FIC FI	8.274.663,24		8.317.732,80	0,52%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC-FI	2.514.256,97	↑	2.664.707,96	5,98%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	374.062,67		375.889,99	0,49%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 20 TP FI	269.708,25		275.764,06	2,25%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP IPCA FI	1.251.976,83	↓	1.220.476,42	-2,52%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TP FI	282.075,59		282.381,83	0,11%
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TITULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LP	233.202,14		236.668,40	1,49%
FIDC / FIP / FII	**2.450.000,00**		**2.576.000,00**	**5,14%**
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FI IMOBILIÁRIO - FI	2.450.000,00	⊗	-	-100,00%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FI IMOBILIÁRIO - FI	-	•	2.576.000,00	
Disponibilidades Financeiras	**12.179,91**		**298.887,31**	**2353,94%**
TOTAL DA CARTEIRA	**68.865.319,95**		**69.798.497,34**	**1,36%**

Liquidez da Carteira (%)



Composição da Carteira por Gestor (%)



LEGENDA:

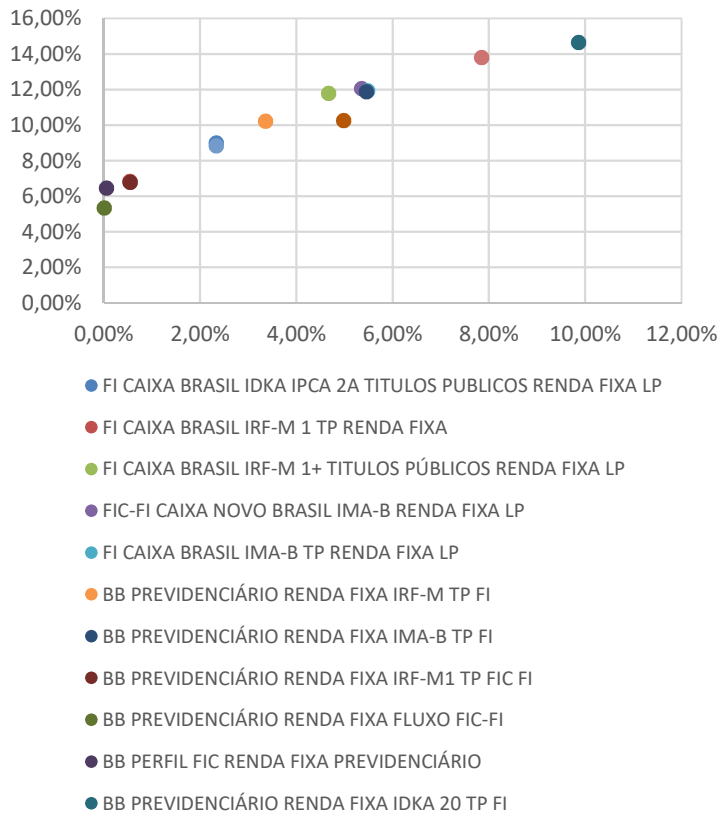
- ↓ Resgate de Recursos
- ↑ Entrada de Recursos
- ⊗ Resgate Total Efetuado
- • Nova Aplicação Efetuada

Instituto de Previdência Matinhos

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - RISCOS

		Volatilidade (12m)			Risco	
FUNDOS DE INVESTIMENTO (FI)	**Index**	**Fundo**	**Index**	**Status**	**VaR**	**%**
Fundos ICVM nº 555						
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LP	IDkA 2	2,34%	-	-	R$ 14.278	0,3%
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RENDA FIXA	IRF-M 1	0,54%	0,54%	↑	R$ 28.550	0,1%
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LP	IRF-M 1+	4,68%	4,50%	↑	R$ 28.304	0,7%
FIC-FI CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	IMA-B	5,36%	5,47%	↓	R$ 38.737	0,8%
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RENDA FIXA LP	IMA-B	5,48%	5,47%	↑	R$ 23.908	0,8%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TP FI	IRF-M	3,37%	3,35%	↑	R$ 3.134	0,5%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TP FI	IMA-B	5,46%	5,47%	↓	R$ 7.095	0,8%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP FIC FI	IRF-M 1	0,55%	0,54%	↑	R$ 6.697	0,1%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC-FI	CDI	0,02%	0,01%	↑	R$ 61	0,0%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	CDI	0,06%	0,01%	↑	R$ 33	0,0%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 20 TP FI	IDKA 20	9,86%	-	-	R$ 3.986	1,4%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP IPCA FI	IPCA	4,99%	-	-	R$ 8.922	0,7%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TP FI	IDkA 2	2,34%	-	-	R$ 968	0,3%
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TITULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LP	IMA-B 5+	7,85%	7,94%	↓	R$ 2.722	1,2%

Risco x Retorno (diariamente últimos 12 meses)



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.
Status - Indica se o fundo possui um risco maior que o seu indexador.
↑ = Risco fundo maior que o risco do indexador
↓ = Risco fundo menor que o risco do indexador

Instituto de Previdência Matinhos

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - MENSAL

FUNDOS DE INVESTIMENTO (FI)	janeiro-18	fevereiro-18	março-18
FI de Renda Fixa	**63.684.171,99**	**64.256.002,99**	**64.845.128,33**
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LP	3.484.582,64	3.504.319,28	3.557.443,72
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RENDA FIXA	36.533.176,96	36.708.260,65	36.955.223,57
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LP	3.349.335,44	3.627.409,75	3.683.240,62
FIC-FI CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	4.584.741,52	4.611.960,38	4.653.915,62
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RENDA FIXA LP	2.770.207,29	2.785.208,56	2.810.732,52
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TP FI	591.139,72	597.659,95	605.436,66
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TP FI	826.647,61	831.024,97	838.481,51
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP FIC FI	7.878.929,17	7.920.269,02	7.970.467,67
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC-FI	1.583.011,85	1.576.139,35	1.647.462,68
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	357.180,21	358.850,81	360.787,06
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 20 TP FI	256.261,23	257.638,30	256.359,47
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP IPCA FI	1.204.739,86	1.211.562,58	1.235.939,57
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TP FI	264.218,49	265.699,39	269.637,66
Disponibidades Financeiras	**2.038,67**	**270.637,20**	**62.652,83**
TOTAL DA CARTEIRA	**63.686.210,66**	**64.526.640,19**	**64.907.781,16**

FUNDOS DE INVESTIMENTO (FI)	abril-18	maio-18	junho-18
FI de Renda Fixa	**65.313.222,23**	**65.378.352,79**	**63.322.116,66**
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LP	3.585.313,22	3.718.895,66	3.726.629,72
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RENDA FIXA	37.004.242,36	36.980.648,37	24.815.428,47
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LP	3.934.082,60	3.827.496,20	3.821.797,87
FIC-FI CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	4.647.706,66	4.505.029,38	4.488.883,08
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RENDA FIXA LP	2.806.224,15	2.717.091,46	2.707.312,69
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TP FI	608.025,79	596.735,71	596.822,86
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TP FI	837.220,68	810.714,24	807.866,96
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP FIC FI	8.008.722,94	8.023.258,32	8.063.357,88
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC-FI	1.758.047,15	2.159.805,45	2.141.994,39
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	362.654,47	364.495,42	366.321,74
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 20 TP FI	253.921,65	239.592,52	235.520,58
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP IPCA FI	1.235.560,37	1.165.382,28	1.168.504,27
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TP FI	271.500,19	269.207,78	269.982,21
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TITULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LP	-	-	10.111.693,94
Disponibidades Financeiras	**241.538,87**	**71.416,69**	**2.481.821,89**
TOTAL DA CARTEIRA	**65.554.761,10**	**65.449.769,48**	**65.803.938,55**

Instituto de Previdência Matinhos

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - MENSAL

FUNDOS DE INVESTIMENTO (FI)	julho-18	agosto-18	setembro-18
FI de Renda Fixa	**64.013.640,20**	**64.361.910,94**	**64.839.247,66**
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LP	3.770.950,83	3.771.148,47	3.814.603,88
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RENDA FIXA	34.990.043,14	35.294.197,40	35.507.214,22
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LP	3.896.080,87	3.831.626,26	3.886.104,23
FIC-FI CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	4.591.859,00	4.571.170,16	4.565.419,58
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RENDA FIXA LP	2.769.641,09	2.756.773,74	2.751.794,97
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TP FI	605.674,47	599.885,57	607.569,17
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TP FI	826.396,00	822.577,45	821.248,17
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP FIC FI	8.117.834,35	8.149.927,57	8.198.025,41
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC-FI	2.152.205,00	2.277.992,74	2.397.254,26
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	368.229,11	370.267,60	372.087,70
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 20 TP FI	243.949,62	241.693,75	238.074,07
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP IPCA FI	1.193.073,30	1.188.306,45	1.192.517,03
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TP FI	273.312,86	273.102,91	276.301,64
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TITULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LP	214.390,56	213.240,87	211.033,33
FIDC / FIP / FII	**2.450.000,00**	**2.450.000,00**	**2.450.000,00**
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FI IMOBILIÁRIO - FII (Ofert	2.450.000,00	2.450.000,00	2.450.000,00
Disponibidades Financeiras	**40.858,81**	**9.792,37**	**30.155,97**
TOTAL DA CARTEIRA	**66.504.499,01**	**66.821.703,31**	**67.319.403,63**

FUNDOS DE INVESTIMENTO (FI)	outubro-18	novembro-18	dezembro-18
FI de Renda Fixa	**66.403.140,04**	**66.923.610,03**	**-**
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LP	4.154.982,03	4.160.484,15	-
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RENDA FIXA	35.620.632,75	35.827.976,79	-
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LP	4.082.967,07	4.131.322,01	-
FIC-FI CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	4.887.134,34	4.932.101,40	-
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RENDA FIXA LP	2.948.835,62	2.975.306,81	-
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TP FI	629.331,93	635.499,64	-
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TP FI	879.310,61	887.297,77	-
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP FIC FI	8.274.663,24	8.317.732,80	-
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC-FI	2.514.256,97	2.664.707,96	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	374.062,67	375.889,99	-
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 20 TP FI	269.708,25	275.764,06	-
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP IPCA FI	1.251.976,83	1.220.476,42	-
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TP FI	282.075,59	282.381,83	-
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TITULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LP	233.202,14	236.668,40	-
FIDC / FIP / FII	**2.450.000,00**	**2.576.000,00**	**-**
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FI IMOBILIÁRIO - FII (Ofert	2.450.000,00	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FI IMOBILIÁRIO - FII	-	2.576.000,00	-
Disponibidades Financeiras	**12.179,91**	**298.887,31**	**-**
TOTAL DA CARTEIRA	**68.865.319,95**	**69.798.497,34**	**-**

Instituto de Previdência Matinhos

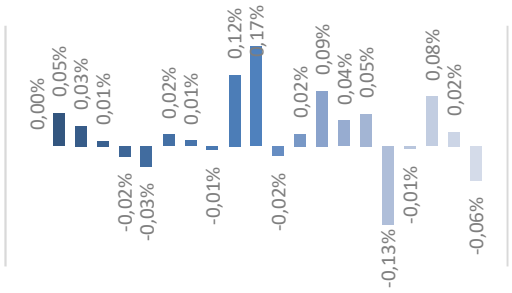
RENTABILIDADE DOS FUNDOS DE INVESTIMENTO

FUNDOS DE INVESTIMENTO (FI)	Index	Rentabilidade			% do Indexador		
		nov	2018	12 m	nov	2018	12 m
FI de Renda Fixa							
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LP	IDkA 2	0,13%	8,05%	8,99%	-	-	-
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RENDA FIXA	IRF-M 1	0,53%	6,23%	6,83%	↓	↓	↓
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LP	IRF-M 1+	1,18%	10,26%	11,79%	↑	↑	↑
FIC-FI CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	IMA-B	0,92%	11,13%	12,04%	↑	↓	↓
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RENDA FIXA LP	IMA-B	0,90%	11,03%	11,92%	↓	↓	↓
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TP FI	IRF-M	0,98%	8,89%	10,22%	↓	↓	↓
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TP FI	IMA-B	0,91%	10,97%	11,87%	↑	↓	↓
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP FIC FI	IRF-M 1	0,52%	6,19%	6,78%	↓	↓	↓
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC-FI	CDI	0,41%	4,86%	5,33%	↓	↓	↓
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	CDI	0,49%	5,84%	6,46%	↓	↓	↓
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 20 TP FI	IDKA 20	2,25%	14,27%	14,65%	-	-	-
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP IPCA FI	IPCA	0,13%	9,19%	10,26%	-	-	-
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TP FI	IDkA 2	0,11%	7,90%	8,83%	-	-	-
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TITULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LP	IMA-B 5+	1,49%	12,94%	13,79%	↓	↓	↓

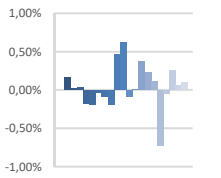
PRINCIPAIS INDICADORES	Index	Rentabilidade			% da Meta		
		nov	2018	12 m	nov	2018	12 m
CDI (CERTIFICADO DE DEPÓSITO INTERFINANCEIRO)	CDI	0,49%	5,90%	6,47%	210%	89%	92%
IMA - GERAL (ÍNDICE DE MERCADO ANBIMA - GERAL)	IMA - Geral	0,76%	8,76%	9,72%	322%	132%	138%
IMA-B (ÍNDICE DE MERCADO ANBIMA - B)	IMA-B	0,90%	11,22%	12,15%	384%	169%	172%
IMA-B 5 (ÍNDICE DE MERCADO ANBIMA - B 5)	IMA-B 5	0,14%	8,39%	9,35%	61%	126%	132%
IMA-B 5+ (ÍNDICE DE MERCADO ANBIMA - B 5+)	IMA-B 5+	1,52%	13,28%	14,17%	647%	200%	201%
IRF-M (ÍNDICE DE RENDA FIXA DO MERCADO)	IRF-M	0,99%	9,06%	10,42%	420%	137%	147%
IRF-M 1 (ÍNDICE DE RENDA FIXA DO MERCADO - 1)	IRF-M 1	0,54%	6,38%	6,98%	231%	96%	99%
IRF-M 1+ (ÍNDICE DE RENDA FIXA DO MERCADO - 1+)	IRF-M 1+	1,17%	10,15%	11,75%	496%	153%	166%
IBOVESPA (ÍNDICE DA BOLSA DE SÃO PAULO)	Ibovespa	2,38%	17,15%	24,36%	1011%	258%	345%
BRL / USD (COTAÇÃO DÓLAR AMERICANO)	Dólar	3,92%	16,72%	18,51%	1663%	252%	262%

RENTABILIDADE DIÁRIA CARTEIRA x INDICES NO MÊS

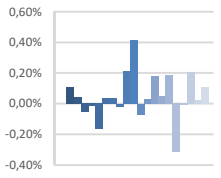
CARTEIRA



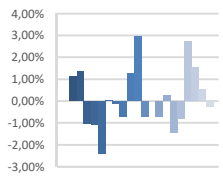
IMA-B



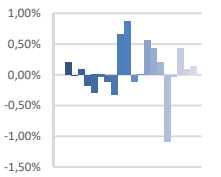
IRF-M



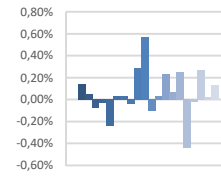
IBOVESPA



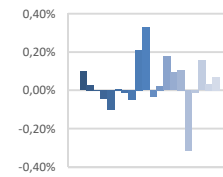
IMA-B 5+



IRF-M +1



IMA Geral

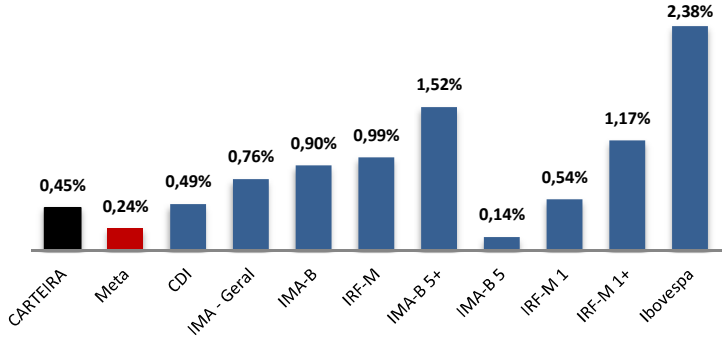


Instituto de Previdência Matinhos

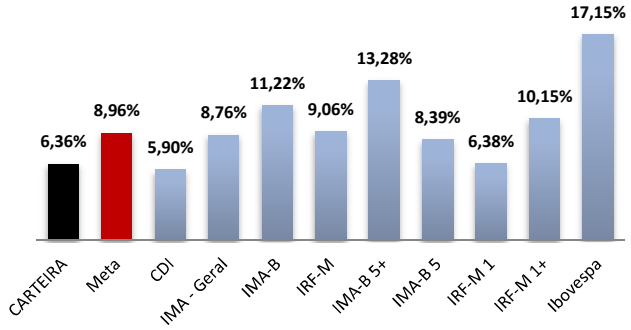
RENTABILIDADE DA CARTEIRA CONSOLIDADA

PERÍODO	Carteira	Meta	CDI	IMA-B	IMA Geral	p.p Meta	% Meta	% CDI	% IMA-B	% IMA Geral
janeiro-18	**1,19%**	**0,72%**	0,58%	3,40%	1,76%	**0,47p.p.**	166,1%	204,4%	35,1%	67,9%
fevereiro-18	**-0,23%**	**0,67%**	0,46%	0,55%	0,72%	**-0,9p.p.**	-34,7%	-49,8%	-42,2%	-32,3%
março-18	**1,74%**	**0,56%**	0,53%	0,94%	0,96%	**1,19p.p.**	313,2%	328,3%	186,5%	181,3%
abril-18	**0,07%**	**0,70%**	0,52%	-0,14%	0,32%	**-0,63p.p.**	10,0%	13,4%	-48,3%	21,8%
maio-18	**-1,09%**	**0,92%**	0,52%	-3,16%	-1,43%	**-2,01p.p.**	-119,1%	-211,5%	34,7%	76,7%
junho-18	**1,50%**	**1,92%**	0,52%	-0,32%	0,12%	**-0,43p.p.**	77,83%	289,30%	-467,76%	1248,29%
julho-18	**0,17%**	**0,74%**	0,54%	2,32%	1,41%	**-0,56p.p.**	23,63%	32,16%	7,53%	12,33%
agosto-18	**-0,12%**	**0,49%**	0,57%	-0,45%	-0,21%	**-0,6p.p.**	-24,19%	-20,77%	26,30%	54,78%
setembro-18	**0,52%**	**0,79%**	0,47%	-0,15%	0,64%	**-0,27p.p.**	65,85%	110,88%	-347,40%	81,37%
outubro-18	**2,02%**	**0,89%**	0,54%	7,14%	3,47%	**1,13p.p.**	227,25%	371,89%	28,29%	58,26%
novembro-18	**0,45%**	**0,24%**	0,49%	0,90%	0,76%	**0,22p.p.**	192,28%	91,76%	50,07%	59,73%
dezembro-18										
2018 (acumulado)	**6,36%**	**8,96%**	5,90%	11,22%	8,76%	**-2,6p.p.**	71,0%	107,8%	56,6%	72,5%

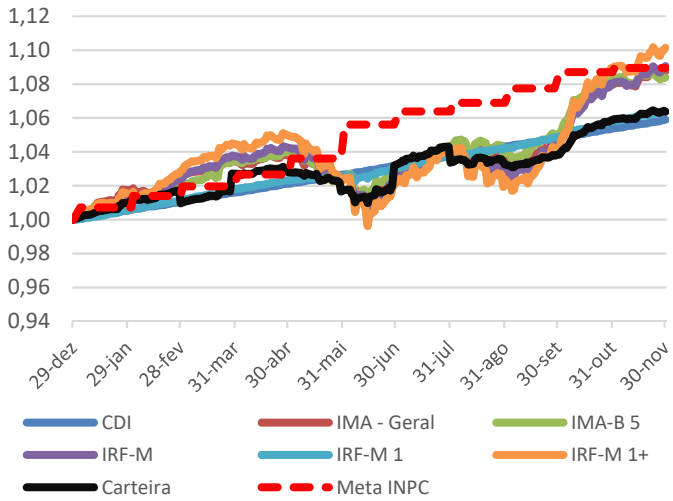
Carteira x Indicadores (nov/18)



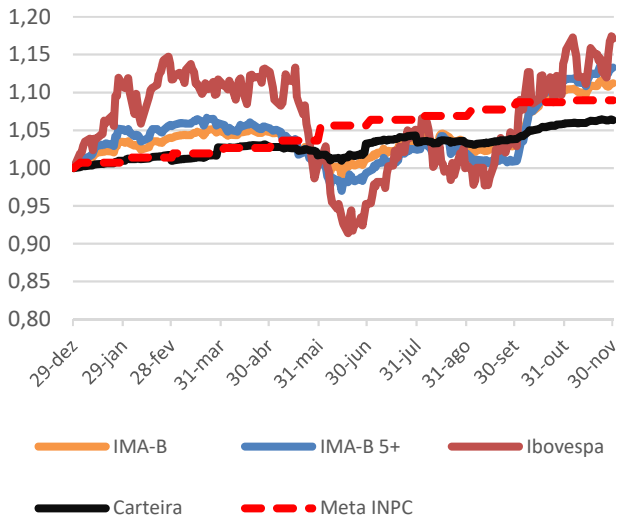
Carteira x Indicadores (2018)



Rentabilidade Diária no Ano (%) - Séries Menor Vol



Rentabilidade Diária no Ano (%) - Séries Maior Vol



Instituto de Previdência Matinhos

Instituto de Previdência dos Serv. Públicos Mun. de Matinhos - PR

PARTICIPAÇÃO DOS FUNDOS NA RENTABILIDADE DA CARTEIRA

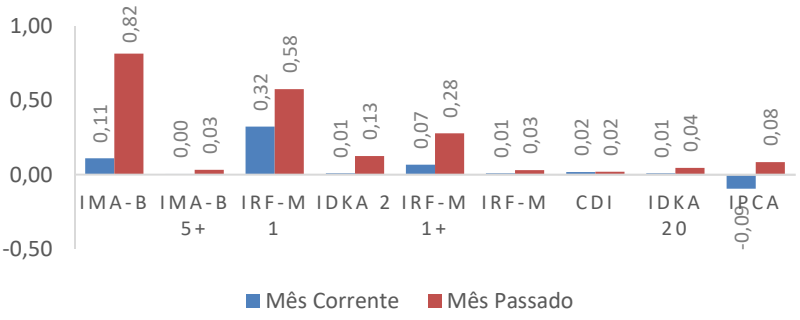
Últimos 6 meses

FUNDOS DE INVESTIMENTO (FI)	Indexador	Rentabilidade Diária x Peso Diário					
		nov	out	set	ago	jul	jun
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LP	IDkA 2	0,01	0,12	0,06	0,00	0,06	0,02
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RENDA FIXA	IRF-M 1	0,26	0,47	0,30	0,21	0,33	0,19
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LP	IRF-M 1+	0,07	0,28	0,08	-0,09	0,11	0,00
FIC-FI CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	IMA-B	0,06	0,45	-0,01	-0,03	0,15	-0,01
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RENDA FIXA LP	IMA-B	0,04	0,28	-0,01	-0,02	0,09	-0,01
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TP FI	IRF-M	0,01	0,03	0,01	-0,01	0,01	0,00
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TP FI	IMA-B	0,01	0,08	-0,00	-0,01	0,03	-0,00
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP FIC FI	IRF-M 1	0,06	0,11	0,07	0,05	0,08	0,06
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC-FI	CDI	0,02	0,02	0,01	0,02	0,01	0,01
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	CDI	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 20 TP FI	IDKA 20	0,01	0,04	-0,01	-0,00	0,01	-0,01
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP IPCA FI	IPCA	0,00	0,08	0,01	-0,01	0,04	0,01
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TP FI	IDkA 2	0,00	0,01	0,00	-0,00	0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TITULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LP	IMA-B 5+	0,00	0,03	-0,00	-0,00	0,15	0,17
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FI IMOBILIÁRIO - FI	IPCA						
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FI IMOBILIÁRIO - FI	IPCA	-0,10			-0,22	-0,90	1,06

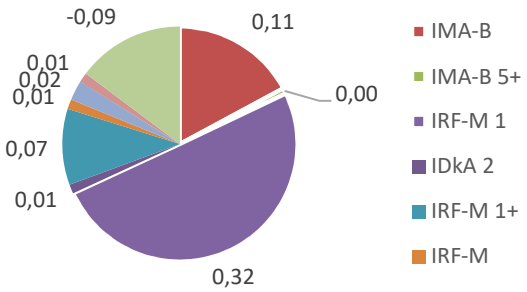
Últimos 6 meses

FUNDOS DE INVESTIMENTO (FI)		Peso Fechamento Carteira					
		nov	out	set	ago	jul	jun
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LP	IDkA 2	6,78%	6,80%	6,39%	6,40%	6,43%	6,47%
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RENDA FIXA	IRF-M 1	48,97%	49,04%	49,49%	49,58%	49,56%	35,60%
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LP	IRF-M 1+	6,44%	6,46%	6,48%	6,49%	6,52%	6,55%
FIC-FI CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	IMA-B	5,32%	5,33%	5,35%	5,36%	5,38%	5,42%
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RENDA FIXA LP	IMA-B	3,42%	3,43%	3,44%	3,45%	3,46%	3,48%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TP FI	IRF-M	0,40%	0,40%	0,40%	0,40%	0,41%	0,41%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TP FI	IMA-B	0,58%	0,58%	0,58%	0,58%	0,58%	0,59%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP FIC FI	IRF-M 1	10,88%	10,90%	10,93%	10,95%	11,00%	11,07%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC-FI	CDI	4,34%	4,12%	3,96%	3,78%	3,60%	3,62%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	CDI	0,57%	0,57%	0,57%	0,58%	0,58%	0,58%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 20 TP FI	IDKA 20	0,49%	0,49%	0,50%	0,50%	0,50%	0,50%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP IPCA FI	IPCA	2,03%	2,09%	2,10%	2,10%	2,11%	2,13%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TP FI	IDkA 2	0,38%	0,38%	0,38%	0,38%	0,39%	0,39%
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TITULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LP	IMA-B 5+	0,38%	0,38%	0,38%	0,38%	0,38%	18,61%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FI IMOBILIÁRIO - FI	IPCA	4,50%	4,51%	4,53%	4,53%	4,55%	0,00%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FI IMOBILIÁRIO - FI	IPCA	4,50%	4,51%	4,53%	4,53%	4,55%	4,58%

Contribuição por Indexador - nov/18 contra out/18



Contribuição por Indexador - Global nov/18



Instituto de Previdência Matinhos

Instituto de Previdência dos Serv. Públicos Mun. de Matinhos - PR

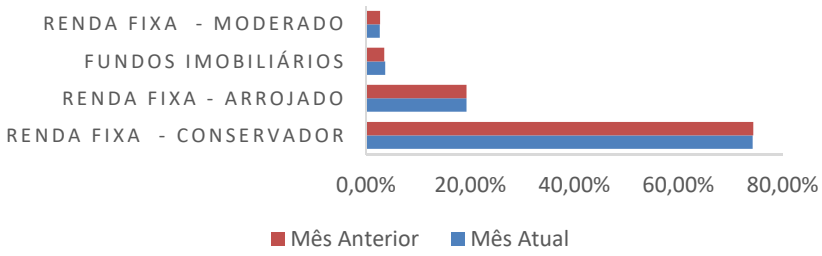
DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA POR ÍNDICES

ÍNDICES	out/18	nov/18
CDI	**4,19%**	**4,37%**
IRF-M	**70,60%**	**70,38%**
IRF-M	0,91%	0,91%
IRF-M 1	63,75%	63,52%
IRF-M 1+	5,93%	5,94%
IMA-B	**13,00%**	**12,99%**
IMA-B	12,66%	12,65%
IMA-B 5	0,00%	0,00%
IMA-B 5+	0,34%	0,34%
IMA - Geral	**0,00%**	**0,00%**
IDkA	**6,84%**	**6,79%**
IDkA 2	6,44%	6,39%
IDkA 20	0,39%	0,40%
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	**5,38%**	**5,46%**

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.

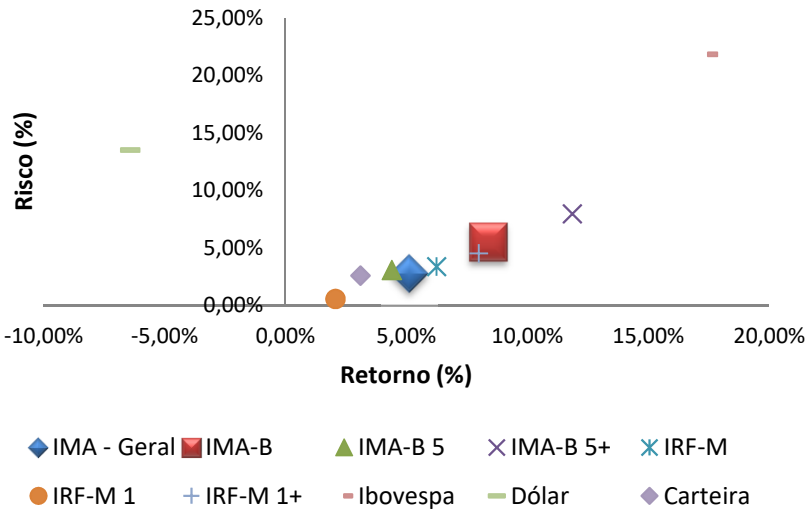
Distribuição da Carteira por Classes (mensalmente)



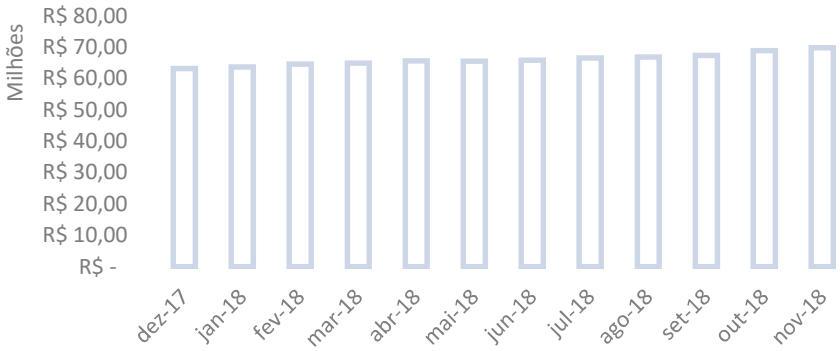
Classificação Classes de Fundos

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)



Evolução do Patrimônio (em R$ milhões)



Instituto de Previdência Matinhos

Instituto de Previdência dos Serv. Públicos Mun. de Matinhos - PR

ENQUADRAMENTO DA CARTEIRA POR APLICAÇÕES

Segmento de Renda Fixa

Artigo	Tipo de Ativo / Condições de Enquadramento	Limite 4.604	Lim. Máx.	Limite da PI	Total (R$)	% da Carteira	Status
7°	**Renda Fixa e Títulos Públicos**	**100%**	**100%**	**100%**	**66.923.610,03**	**95,88%**	**Enquadrado**
7°, I	**Fundos 100% Títulos Públicos ou 100% Títulos Públicos**	**100%**	**100%**	**100%**	**58.950.910,68**	**84,46%**	**Enquadrado**
7°, I, a	Títulos Públicos	100%	100%	100%	-	0,00%	Enquadrado
7°, I, b	Cotas de FI em Renda Fixa com Sufixo "Referenciado" com Aplicação em 100% Títulos Públicos	100%	100%	100%	58.950.910,68	84,46%	Enquadrado
7°, I, c	Cotas de FI em índices de Mercado com Carteira Composta Exclusivamente por Títulos Públicos Federais	100%	100%	100%	-	0,00%	Enquadrado
7°, II	**Operações Compromissadas Lastro 100% Títulos Públicos**	**5%**	**5%**	**5%**	-	**0,00%**	**Enquadrado**
7°, III	**Fundos de Renda Fixa**	**60%**	**60%**	**60%**	**4.932.101,40**	**7,07%**	**Enquadrado**
7°, III, a	Cotas de FI Renda Fixa com sufixo "Referenciado"	60%	60%	60%	4.932.101,40	7,07%	Enquadrado
7°, III, b	Cotas de FI em índices de Mercado de Renda Fixa	60%	60%	60%	-	0,00%	Enquadrado
7°, IV	**Fundos Renda Fixa Geral**	**40%**	**40%**	**40%**	**3.040.597,95**	**4,36%**	**Enquadrado**
7°, IV, a	Cotas de FI Classificados como Renda Fixa (Condomínio Aberto)	40%	40%	40%	3.040.597,95	4,36%	Enquadrado
7°, IV, b	Cotas de Fundos de Investimento em Índice de Mercado de Renda Fixa - Negociáveis em Bolsa de Valores	40%	40%	40%	-	0,00%	Enquadrado
7°, V	**Letras Imobiliárias Garantidas**	**20%**	**20%**	**20%**	**-**	**0,00%**	**Enquadrado**
7°, V, b	Letras Imobiliárias Garantidas (LIG)	**20%**	**20%**	**20%**	-	0,00%	Enquadrado
7°, VI	**Certificado Depósito Bancário / Depósito em Poupança**	**15%**	**15%**	**15%**	**-**	**0,00%**	**Enquadrado**
7°, VI, a	Certificado Depósito Bancário (CDB)	**15%**	**15%**	**15%**	-	0,00%	Enquadrado
7°, VI, b	Depósito em Poupança	**15%**	**15%**	**15%**	-	0,00%	Enquadrado
7°, VII	**FIDCs/Renda Fixa - Crédito Privado/ Debêntures de Infraestrutura**	**15%**	**18,75%**	**15%**	**-**	**0,00%**	**Enquadrado**
7°, VII, a	Fundos Investimentos Direitos Creditórios	5%	6,25%	5%	-	0,00%	Enquadrado
7°, VII, b	Fundo de Investimentos Renda Fixa (Crédito Privado)	5%	6,25%	5%	-	0,00%	Enquadrado
7°, VII, c	Debêntures de Infraestrutura	5%	6,25%	5%	-	0,00%	Enquadrado

Segmento de Renda Variável

Artigo	Tipo de Ativo	Limite 4.604	Lim. Máx.	Limite da PI	Total (R$)	% da Carteira	Status
8°	**Renda Variável e Estruturados**	**30%**	**30%**	**30%**	**2.576.000,00**	**3,69%**	**Enquadrado**
8°, I	**FI Referenciados / Index. Ibovespa, IBrX ou IBrX-50, exclusiv.**	**30%**	**30%**	**30%**	**-**	**0,00%**	**Enquadrado**
8°, I, a	Cotas de FI em Renda Variável Referenciados em índices de Renda Variável	30%	30%	30%	-	0,00%	Enquadrado
8°, I, b	Cotas de FI em Índices de Merc. Renda Variável	30%	30%	30%	-	0,00%	Enquadrado
8°, II	**FI Índices Ref. Ações / Index Ibov, IBrX ou IBrX-50, exclusiv.**	**20%**	**20%**	**20%**	**-**	**0,00%**	**Enquadrado**
8°, II, a	Cotas de FI Classificados como Ações	20%	20%	20%	-	0,00%	Enquadrado
8°, II, b	Cotas de FI em Índice de Mercado Variável	20%	20%	20%	-	0,00%	Enquadrado
8°, III	**FI Multimercado**	**10%**	**10,0%**	**10%**	**-**	**0,00%**	**Enquadrado**
8°, IV	**Fundos de Investimentos Estruturados**	**10%**	**12,50%**	**10%**	**2.576.000,00**	**3,69%**	**Enquadrado**
8°, IV, a	Cotas de FI em Participações (Condomínio Fechado)	5%	6,25%	5%	-	0,00%	Enquadrado
8°, IV, b	Cotas de FI Imobiliários (Negociados em Bolsa)	5%	6,25%	5%	2.576.000,00	3,69%	Enquadrado
-	**Disponibilidade de Caixa - Conta Corrente**	**100%**	**100%**	**100%**	**298.887,31**	**0,43%**	
TOTAL DA CARTEIRA					**69.798.497,34**	100,0%	

Comentários:

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

Instituto de Previdência Matinhos

Instituto de Previdência dos Serv. Públicos Mun. de Matinhos - PR

ENQUADRAMENTO DA CARTEIRA POR FUNDOS

FUNDOS DE INVESTIMENTO (FI)	Art	Enquadramento por PL			PL
		PL nov/18	PL Fundo	%	
FI enquadrados dentro da restrição de 15% do PL					**< 15%**
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LP	7°, I, b	4.160.484,15	7.304.520.055,18	0,06%	Sim
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RENDA FIXA	7°, I, b	35.827.976,79	18.654.905.875,42	0,19%	Sim
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LP	7°, I, b	4.131.322,01	1.680.783.407,92	0,25%	Sim
FIC-FI CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	7°, III, a	4.932.101,40	1.930.855.970,46	0,26%	Sim
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RENDA FIXA LP	7°, I, b	2.975.306,81	3.321.105.855,74	0,09%	Sim
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M TP FI	7°, I, b	635.499,64	5.191.662.977,24	0,01%	Sim
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TP FI	7°, I, b	887.297,77	3.733.451.663,62	0,02%	Sim
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TP FIC FI	7°, I, b	8.317.732,80	12.831.650.129,37	0,06%	Sim
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC-FI	7°, IV, a	2.664.707,96	1.226.386.944,30	0,22%	Sim
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7°, IV, a	375.889,99	5.039.302.378,97	0,01%	Sim
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 20 TP FI	7°, I, b	275.764,06	6.712.510,52	4,11%	Sim
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP IPCA FI	7°, I, b	1.220.476,42	303.395.274,74	0,40%	Sim
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TP FI	7°, I, b	282.381,83	6.923.281.999,25	0,00%	Sim
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TITULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LP	7°, I, b	236.668,40	812.961.028,89	0,03%	Sim
FI enquadrados dentro da restrição de 5% do PL					**< 5%**
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FI IMOBILIÁRIO - FII	8°, IV, b	2.576.000,00	206.337.016,72	1,25%	Sim

LEGENDA:

⊗ Resgates Efetuados em 2018

• Aplicações Novos Fundos em 2018

Instituto de Previdência Matinhos

Instituto de Previdência dos Serv. Públicos Mun. de Matinhos - PR

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 constituind

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 qualqu

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 qual

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)

FI Cotas	Fundos Investidos
Sim	100% 10.740.739/0001-93 CAIXA MASTER BRASIL IMA-B FI RENDA FIXA LP

Instituto de Previdência Matinhos

Instituto de Previdência dos Serv. Públicos Mun. de Matinhos - PR

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 hip

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	30.822.936/0001-69	BB Gestão de Recursos DTVM	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	30.822.936/0001-69	BB Gestão de Recursos DTVM	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	30.822.936/0001-69	BB Gestão de Recursos DTVM	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 Resol

FI Cotas	Fundos Investidos
Sim	100 % BB IRF-M 1 FI RENDA FIXA CNPJ: 11.839.250/0001-36

Instituto de Previdência Matinhos

Instituto de Previdência dos Serv. Públicos Mun. de Matinhos - PR

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	30.822.936/0001-69	BB Gestão de Recursos DTVM	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 FIs.

FI Cotas	Fundos Investidos
Sim	100% BB TOP TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS FI RENDA FIXA

BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO

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	30.822.936/0001-69	BB Gestão de Recursos DTVM	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 FIs.

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	30.822.936/0001-69	BB Gestão de Recursos DTVM	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°, I, b	23/01/2014	0	Não	Geral

Administrador	CNPJ Administrador	Gestor	CNPJ Gestor
BB Gestão de Recursos DTVM	30.822.936/0001-69	BB Gestão de Recursos DTVM	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 Consumi

FI Cotas	Fundos Investidos
Não	Não aplica

Instituto de Previdência Matinhos

Instituto de Previdência dos Serv. Públicos Mun. de Matinhos - PR

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	30.822.936/0001-69	BB Gestão de Recursos DTVM	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

FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TITULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LP

CNPJ Fundo	Segmento	Tipo de Ativo	Data Início	Resgate	Em Enquad.	Categoria Investidor
10.577.503/0001-88	Renda Fixa	7°, I, b	18/04/2012	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 em carteira composta por títulos públicos federais, buscando acompanhar o subíndice do Índice de Mercado da ANBIMA B 5+ (IMA B 5+), não constituindo, em qualqu

FI Cotas	Fundos Investidos
Não	Não aplica

BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FI IMOBILIÁRIO - FII

CNPJ Fundo	Segmento	Tipo de Ativo	Data Início	Resgate	Em Enquad.	Categoria Investidor
13.584.584/0001-31	Renda Variável	8°, IV, b	12/12/2011	9999	Não	Qualificado

Administrador	CNPJ Administrador	Gestor	CNPJ Gestor
Planner Corretora	00.806.535/0001-54	ZION Invest	97.543.940/0001-69

Características dos Ativos

O Fundo aplicará seus recursos preponderantemente em Ativos Imobiliários

Descrição da Operação

O Fundo tem por objeto a aquisição de ativos previstos no art. 45 da Instrução CVM 472.

FI Cotas	Fundos Investidos
Não	Não aplica

Instituto de Previdência Matinhos

Instituto de Previdência dos Serv. Públicos Mun. de Matinhos - PR

DAIR - APR Movimentações

	Quantidade Cotas	Movimentação (R$)	Valor Cota	PL Fundo
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RENDA FIXA				
10.740.670/0001-06				
Resgates				
21/11/2018	59.160,23821800	-R$ 139.011,00	2,3497370000	R$ 19.066.582.593,04
28/11/2018	36.094,90969300	-R$ 84.917,21	2,3526090000	R$ 18.468.132.938,10
Aplicações				
09/11/2018	103.376,43857000	R$ 242.421,47	2,3450360000	R$ 19.073.920.523,20
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FIC-FI				
13.077.415/0001-05				
Resgates				
23/11/2018	36.051,86593600	-R$ 71.181,51	1,9744190000	R$ 1.296.507.856,75
26/11/2018	291,63130100	-R$ 575,92	1,9748220000	R$ 1.174.917.033,76
Aplicações				
06/11/2018	90.495,75287800	R$ 178.241,72	1,9696140000	R$ 1.093.533.942,91
16/11/2018	16.788,85316400	R$ 33.114,68	1,9724200000	R$ 1.285.489.372,46
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TP IPCA FI				
15.486.093/0001-83				
Resgates				
16/11/2018	17.135,55199100	-R$ 33.114,68	1,9325131760	R$ 303.831.182,21

Instituto de Previdência Matinhos

DAIR - Carteira **Data-Base: 30/11/2018**

Segmento	Enquad.	CNPJ FUNDO	Cotas Qtde	Cotas Valor	PL Investido	PL Fundo
			(Conferir)	(Alterar)	(Conferir)	(Alterar)
Renda Fixa	7°, I, b	14.386.926/0001-71	2.108.902,062036	1,9728199924	R$ 4.160.484,15	7.304.520.055,18
Renda Fixa	7°, I, b	10.740.670/0001-06	15.222.288,132954	2,3536525177	R$ 35.827.976,79	18.654.905.875,42
Renda Fixa	7°, I, b	10.577.519/0001-90	2.002.938,989473	2,0626299811	R$ 4.131.322,01	1.680.783.407,92
Renda Fixa	7°, III, a	10.646.895/0001-90	1.654.843,229792	2,9804040112	R$ 4.932.101,40	1.930.855.970,46
Renda Fixa	7°, I, b	10.740.658/0001-93	1.064.296,488020	2,7955619919	R$ 2.975.306,81	3.321.105.855,74
Renda Fixa	7°, I, b	07.111.384/0001-69	124.803,793321	5,0919897792	R$ 635.499,64	5.191.662.977,24
Renda Fixa	7°, I, b	07.442.078/0001-05	179.420,557183	4,9453517698	R$ 887.297,77	3.733.451.663,62
Renda Fixa	7°, I, b	11.328.882/0001-35	3.381.153,174938	2,4600283896	R$ 8.317.732,80	12.831.650.129,37
Renda Fixa	7°, IV, a	13.077.415/0001-05	1.348.310,313016	1,9763313640	R$ 2.664.707,96	1.226.386.944,30
Renda Fixa	7°, IV, a	13.077.418/0001-49	177.652,460558	2,1158726922	R$ 375.889,99	5.039.302.378,97
Renda Fixa	7°, I, b	15.775.748/0001-33	153.235,968239	1,7996039909	R$ 275.764,06	6.712.510,52
Renda Fixa	7°, I, b	15.486.093/0001-83	632.456,205150	1,9297406051	R$ 1.220.476,42	303.395.274,74
Renda Fixa	7°, I, b	13.322.205/0001-35	118.638,250036	2,3801921380	R$ 282.381,83	6.923.281.999,25
Renda Fixa	7°, I, b	10.577.503/0001-88	116.980,908692	2,0231369601	R$ 236.668,40	812.961.028,89
Renda Variável	8°, IV, b	13.584.584/0001-31	1.400.000,000000	1,8400000000	R$ 2.576.000,00	206.337.016,72
		Disponibilidades			R$ 298.887,31	
TOTAL DE RECURSOS DO RPPS PARA CÔMPUTO DOS LIMITES:					**R$ 69.499.610,03**	
TOTAL DE RECURSOS DO RPPS:					**R$ 69.798.497,34**	

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
Rua Nereu Ramos, 942, Sala 301
Jardim Blumenau - Blumenau - SC
CEP: 89010-401
Fone: (47) 3232-2290
contato@amxcapital.com.br