



IPOJUCAPREV

A PREVIDÊNCIA DA GENTE

AUTARQUIA PREVIDENCIÁRIA DO IPOJUCA

AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO RESGATE - APR

ART. 3º-B DA PORTARIA MPS Nº 519/2011, INCLUÍDO PELO ART. 2º DA PORTARIA MPS Nº 170, DE 25/04/2012

AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR

Unidade gestora do RPPS: AUTARQUIA PREVIDENCIARIA DO

IPOJUCA - IPOJUCAPREV

CNPJ: 22.236.946/0001-94

Nº / ANO: 246/2019

DATA: 25/11/2019

VALOR (R\$): 52.340,78

TIPO DE OPERAÇÃO: Aplicação

Dispositivos de resolução do CMN:
3.922/2010, Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "

HISTÓRICO / DESCRIÇÃO DA OPERAÇÃO:

APLICAÇÃO EM FUNDO COM BOM HISTÓRICO DE RENTABILIDADE E DE ACORDO COM A POLÍTICA DE INVESTIMENTOS APROVADA.

CARACTERÍSTICAS DO ATIVO:

: :BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO

CNPJ: 25.078.994/0001-90

Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM

CNPJ Administrador: 30.822.936/0001-69

Gestão: BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM

CNPJ Gestão: 30.822.936/0001-69

Disponibilidade recursos resgatados: D+3

Data de inicio do fundo: 31/08/2016

Taxa de administração: 0,30%

Benchmark: IMA-GERAL EX-C

Taxa de performance: Não possui

Retorno: 1,80% no mês 10/2019

Patrimônio líquido: 8.931.824.899,36 em 31/10/2019

Valor da cota: 1,453681639 em 31/10/2019

Proponente:

MARCELO VILAS BOAS
MARINHEIRO DA SILVA

CPF: 055.431.764-81

Gestor/Autorizador:

MARCELO VILAS BOAS
MARINHEIRO DA SILVA

CPF: 055.431.764-81

Certificação: ANBIMA


Validade: 28/01/2022


Responsável pela liquidação da operação:

MAURISON DA COSTA GOMES

CPF: 186.648.304-87


MARCELO VILAS BOAS M. DA SILVA
DIRETOR DE INVESTIMENTOS
IPOJUCAPREV
MATRÍCULA - 66614


MARCELO VILAS BOAS M. DA SILVA
DIRETOR DE INVESTIMENTOS
IPOJUCAPREV
MATRÍCULA - 66614


MAURISON DA COSTA GOMES
PRESIDENTE EXECUTIVO IPOJUCA PREV.
MAT. 2950-3

BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO

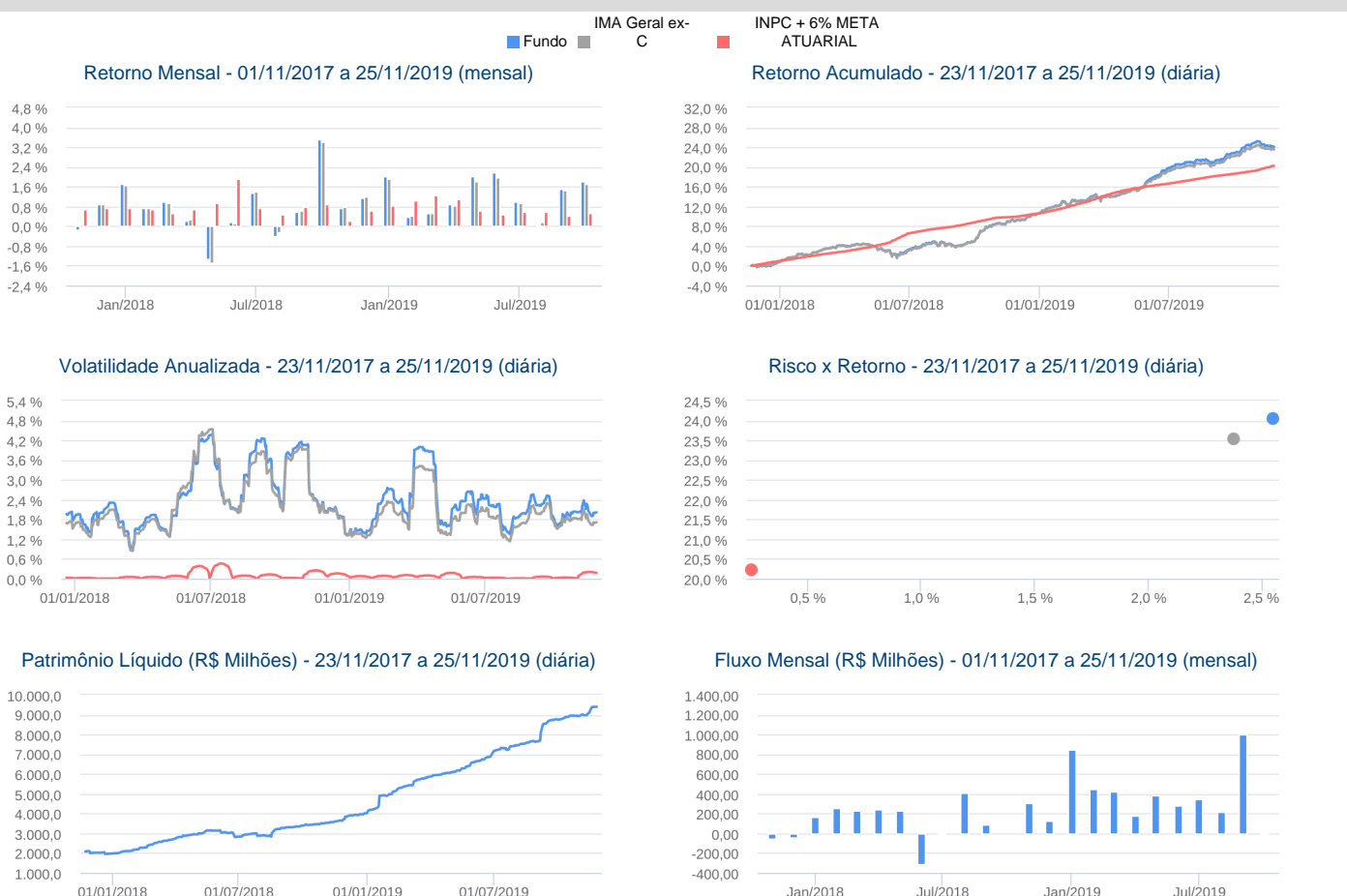
25/11/2019

Características	Informações Operacionais
CNPJ: 25.078.994/0001-90	Aplicação Mínima: R\$ 1.000.000,00
Gestão: BB Gestão de Recursos DTVM	Aplicação Adicional: R\$ 0,00
Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM	Saldo Mínimo: R\$ 300.000,00
Taxa de Administração: 0,30%	Resgate Mínimo: R\$ 1.000.000,00
Taxa de Administração (Máxima): 0,50%	Conversão da Cota para Aplicação: D+0
Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Livre Soberano	Conversão da Cota para Resgate: D+3 du
Código de Referência: 423041	Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+3 du
Início do Fundo: 31/08/2016	

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	mar/19	fev/19	jan/19	dez/18	nov/18
Fundo	44,27	12,20	13,80	24,05	41,62	1,80	1,50	0,08	1,02	2,17	2,02	0,87	0,52	0,39	2,01	1,17	0,76
% do IMA Geral ex-C	98,51	103,79	103,22	102,25	99,69	106,25	102,93	49,86	107,63	111,45	110,28	103,46	95,80	87,62	105,15	99,12	96,62
INPC + 6% META ATUARIAL	31,88	8,69	9,40	20,21	29,86	0,57	0,44	0,63	0,63	0,45	0,66	1,09	1,21	1,01	0,87	0,60	0,21
IMA Geral ex-C	44,94	11,76	13,36	23,52	41,75	1,69	1,46	0,17	0,95	1,95	1,83	0,84	0,54	0,44	1,91	1,18	0,78

Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	1,442711053	9.398.156,15	6.590.506,88	2,28%	-1,22%	1,08%	1,15	0,32%	2,17%	0,08%	7
IMA Geral ex-C	-	-	-	1,97%	-1,01%	0,94%	1,00	0,00%	1,95%	0,17%	0

Gráficos



Composição da Carteira

out/2019

Performance dos Fundos em Carteira

Retorno (%) / % do Benchmark - IMA Geral ex-C

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias. Fonte: Quantum Axis.

:: BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO

25/11/2019

FUNDO	% do PL	Mês		Ano		12 meses		Desde o início		06 meses	12 meses
		Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio
BB TOP RF AGRESSIVO PRÉ FI RENDA FIXA LP	37,02	-0,57	100,35	11,01	93,67	13,06	97,70	607,96	-	2,01	R\$ 6.344.379.688,8
BB TOP IRF-M 1 FI RENDA FIXA	31,05	0,26	-44,99	-	-	-	-	5,11	54,76	0,30	
BB TOP RF ÍNDICE DE PREÇO FI RENDA FIXA LP	19,19	-1,81	316,35	21,33	181,39	23,76	177,76	381,74	126,27	4,48	R\$ 3.967.625.679,5
BB TOP IMA-B 5+ FI RENDA FIXA	7,32	-2,99	523,80	-	-	-	-	11,25	191,35	-	
BB TOP IMA-B 5 ALOCAÇÃO FI RENDA FIXA	5,43	-0,15	25,70	-	-	-	-	6,03	102,58	-	

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)

Tipo de Aplicação	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	mar/19
Cotas de Fundos	100,00%	99,96%	99,98%	99,99%	99,79%	99,93%	99,93%	99,99%
Valores a receber	0,00%	0,04%	0,02%	0,01%	0,21%	0,06%	0,08%	0,01%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,01%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	8.931.824,90	8.760.808,47	7.645.235,51	7.419.279,08	7.006.317,80	6.585.019,92	6.078.255,74	5.854.681,52
Data da Divulgação	05/11/2019	03/10/2019	04/09/2019	08/08/2019	05/07/2019	06/06/2019	06/05/2019	05/04/2019

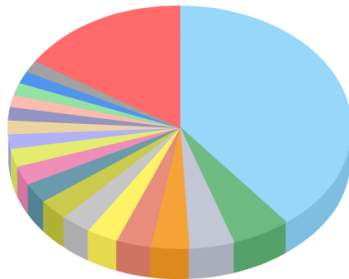
As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.
Fonte: Quantum Axis.

:: BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO

25/11/2019

Composição da Carteira Consolidada - Ativos (%)

out/2019



Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2022	39,41 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2050	5,55 %
LTN - Venc.: 01/07/2020	4,26 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2022	3,60 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2045	3,26 %
NTN-F - Venc.: 01/01/2021	2,96 %
NTN-F - Venc.: 01/01/2023	2,88 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2035	2,82 %
LTN - Venc.: 01/10/2020	2,65 %
LTN - Venc.: 01/04/2020	2,52 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	2,43 %
NTN-F - Venc.: 01/01/2025	1,94 %
LTN - Venc.: 01/07/2021	1,85 %
LTN - Venc.: 01/01/2022	1,76 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2055	1,65 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2040	1,62 %
LTN - Venc.: 01/01/2020	1,61 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2021	1,61 %
Lançamentos positivos menores que 1,61%	15,77 %