



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		Nº / ANO: 022/2020
Unidade gestora do RPPS: AUTARQUIA PREVIDENCIARIA DO IPOJUCA - IPOJUCAPREV		DATA: 05/02/2020
CNPJ: 22.236.946/0001-94		
VALOR (R\$): 2.000.000,00	TIPO DE OPERAÇÃO: Aplicação	Dispositivos de resolução do CMN: 3.922/2010, Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
HISTÓRICO / DESCRIÇÃO DA OPERAÇÃO: APLICAÇÃO EM FUNDO COM BOM HISTÓRICO DE RENTABILIDADE E DE ACORDO COM A POLÍTICA DE INVESTIMENTOS APROVADA.		
CARACTERÍSTICAS DO ATIVO: : BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES CNPJ: 06.988.623/0001-09		
Administrador: BEM DTVM CNPJ Administrador: 00.066.670/0001-00 Gestão: BRADESCO ASSET MANAGEMENT CNPJ Gestão: 62.375.134/0001-44 Disponibilidade recursos resgatados: D+4 Data de início do fundo: 24/09/2004	Taxa de administração: 1,50% Benchmark: NÃO DEFINIDO Taxa de performance: Não possui Retorno Mês Anterior: 1,61% Patrimônio líquido no dia de Movimento: 2.345.124.956,33 Valor da no dia de Movimento: 12,3029016 Qtde de Cotas: 162.563,276942734	
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



Ofício Nº 53/2020

Ipojuca-PE, 04 de Fevereiro de 2020.

Ao Banco Bradesco
Wellington Nascimento

Ref. Alocação de Recursos

Buscando o ajuste da carteira às necessidades do mercado, solicito que sejam feitas as seguintes movimentações:

Aplicação

FUNDO: BRADESCO MID SMALL CAPS FIAÇÕES
CNPJ: 06.988.623/0001-09
VALOR: R\$ 2.000.000,00 (Dois Milhões de Reais)

Origem:

Banco Bradesco
Agência 0785
C/C 58058-9


Transferência

VALOR: R\$ 3.000.000,00 (Três Milhões de Reais)

Destino:

Banco Bradesco
Agência 2856
C/C 29.924-3
CNPJ 11.182.064/0001-77
FAVORECIDO: CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIAÇÕES

Wellington Vinicius P. do Nascimento
135508
04/02/2020
11:26

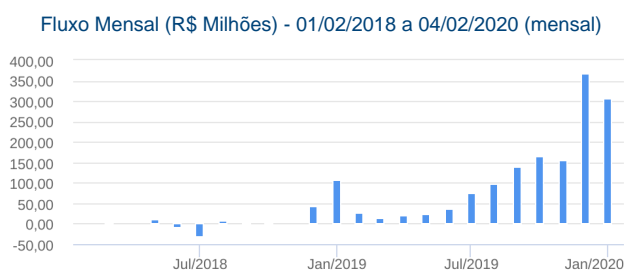
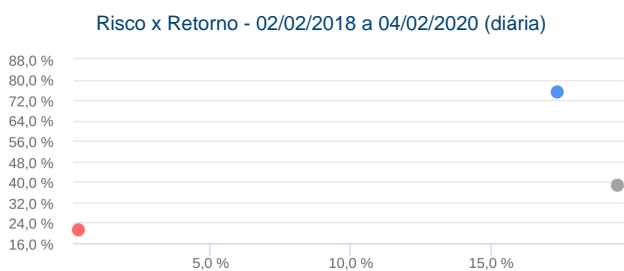
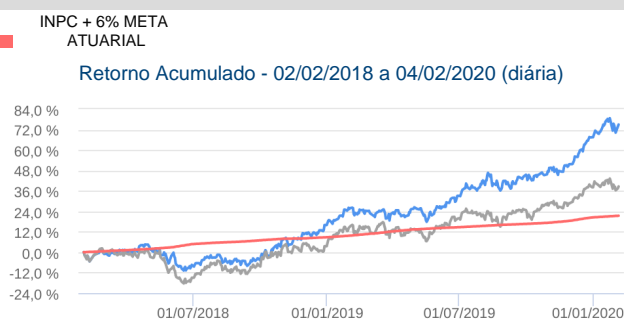

Marcelo Vilas-Boas Marinheiro da Silva
Diretor de investimentos


Maurison da Costa Gomes
Presidente Executivo.

:: BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES

04/02/2020

Características		Informações Operacionais															
CNPJ: 06.988.623/0001-09		Aplicação Mínima: R\$ 20.000.000,00															
Gestão: Bradesco Asset Management		Aplicação Adicional: R\$ 1.000,00															
Administrador: BEM DTVM		Saldo Mínimo: R\$ 20.000,00															
Taxa de Administração: 1,50%		Resgate Mínimo: R\$ 1.000,00															
Taxa de Administração (Máxima): 1,50%		Conversão da Cota para Aplicação: D+1 du															
Classificação Anbima: Ações Small Caps		Conversão da Cota para Resgate: D+1 du															
Código de Referência: 131679		Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+3 du															
Início do Fundo: 24/09/2004																	
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	mar/19	fev/19
Fundo	1.127,47	4,44	38,92	74,94	139,21	1,61	10,43	2,99	1,25	2,56	1,42	5,08	4,84	0,46	3,18	-0,56	-1,78
% do IBX	179,77	1.183,19	196,68	194,25	173,61	-128,74	143,44	308,93	56,56	79,61	-867,39	435,35	118,14	40,47	301,06	486,82	100,92
INPC + 6% META ATUARIAL	449,05	0,77	10,49	21,39	31,15	0,70	1,71	1,01	0,57	0,44	0,63	0,63	0,45	0,66	1,09	1,21	1,01
IBX	627,17	0,38	19,79	38,58	80,18	-1,25	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10	1,14	1,06	-0,11	-1,76
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	12,2746799	2.329.419,47	972.773,82	16,09%	-7,05%	7,64%	0,77	9,56%	10,43%	-0,56%	7						
IBX	-	-	-	17,54%	-9,49%	8,33%	1,00	0,00%	7,27%	-1,25%	0						

Gráficos

Composição da Carteira

jan/2020

Performance dos Fundos em Carteira

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.

:: BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES

04/02/2020

Fundo	% do PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio
-------	---------	---------	----------	---------	----------	---------	----------	---------	----------	--------------	----------

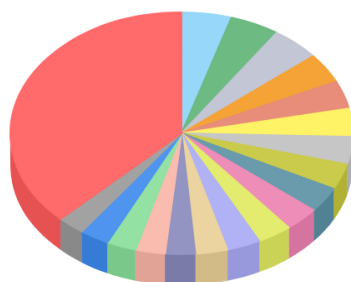
Não há fundos(FI) na carteira

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

Tipo de Aplicação	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19
Ações	89,73%	86,18%	87,69%	86,60%	84,36%	85,28%	83,83%	83,61%
Certificado ou recibo de depósito de valores mobiliários	7,75%	9,48%	8,98%	11,13%	12,09%	11,75%	11,22%	10,33%
Operações Compromissadas	4,22%	6,35%	4,30%	4,84%	3,84%	4,02%	7,43%	7,06%
Valores a receber	0,23%	0,32%	0,23%	0,23%	0,23%	0,29%	0,30%	0,48%
Outros valores mobiliários registrados na CVM objeto de oferta pública	0,02%	0,01%	-	-	-	-	-	-
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-1,94%	-2,34%	-1,20%	-2,80%	-0,52%	-1,35%	-2,79%	-1,49%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	2.245.635,95	1.909.529,33	1.395.974,29	1.205.755,54	1.028.798,52	866.040,10	758.078,49	648.364,18
Data da Divulgação	05/02/2020	07/01/2020	04/12/2019	05/11/2019	06/10/2019	06/09/2019	05/08/2019	02/07/2019

Composição da Carteira Consolidada - Ativos (%)

jan/2020



BRADSPAR PN N1 - BRAP4	4,79 %
Certificado ou recibo de depósito de valores mobiliários - SULA11	4,75 %
ALPARGATAS PN N1 - ALPA4	4,69 %
MAGAZ LUIZA ON NM - MGLU3	4,07 %
CYRELA REALT ON NM - CYRE3	3,84 %
ALIANSCSONAEON NM - ALSO3	3,82 %
ENEVA ON NM - ENEV3	3,73 %
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/04/2021	3,52 %
VIVARA S.A. ON NM - VIVA3	3,43 %
CENTAURO ON NM - CNTO3	3,33 %
GERDAU MET PN N1 - GOAU4	3,33 %
HAPVIDA ON NM - HAPV3	3,24 %
CPFL ENERGIA ON NM - CPFE3	3,11 %
LOJAS AMERIC ON - LAME3	2,87 %
Certificado ou recibo de depósito de valores mobiliários - ENGI11	2,85 %
HELBOR ON NM - HBOR3	2,85 %
CESP PNB N1 - CESP6	2,82 %
LOCALIZA ON NM - RENT3	2,62 %
Lançamentos positivos menores que 2,62%	38,25 %