



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: 038/2020 |
| Unidade gestora do RPPS: AUTARQUIA PREVIDENCIARIA DO IPOJUCA - IPOJUCAPREV CNPJ: 22.236.946/0001-94 | | DATA: 27/02/2020 |
| VALOR (R\$): 2.400.000,00 | TIPO DE OPERAÇÃO: Aplicação | Dispositivos de resolução do CMN: 3.922/2010, Artigo 7º, Inciso I, Alinea ' 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: : CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA CNPJ: 23.215.097/0001-55 | | |
| Administrador: CAIXA ECONÔMICA FEDERAL CNPJ Administrador: 00.360.305/0001-04 Gestão: CAIXA ECONÔMICA FEDERAL CNPJ Gestão: 00.360.305/0001-04 Disponibilidade recursos resgatados: D+0 Data de início do fundo: 04/11/2016 | Taxa de administração: 0,002 Benchmark: IPCA Taxa de performance: Não possui Retorno Mês Anterior: 0,82% Patrimônio líquido no dia de Movimento: 10.603.320.790,39 Valor da no dia de Movimento: 1,439796 Qtde de Cotas: 1.666.902,811231591 | |
| 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 |



IPOJUCAPREV
A PREVIDÊNCIA DA GENTE
AUTARQUIA PREVIDENCIÁRIA DO IPOJUCA

Ofício Nº 100/2020

Ipojuca-PE, 27 de Fevereiro de 2020.

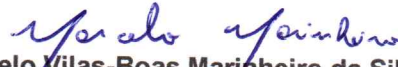
À Caixa Econômica Federal
Luciano Pereira de Lucena

Ref. Alocação de Recursos

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

Aplicação

Valor: 2.400.000,00 (Dois Milhões e Quatrocentos Mil reais)
Fundo: CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA
CNPJ 23.215.097/0001-55


Marcelo Vilas-Boas Marinheiro da Silva
Diretor de investimentos


Maurison da Costa Gomes
Presidente Executivo.

Recebido 24/02
LARISSA DA SA CONCERVA
Aux. de Atendimento
Mat. 135.174-7
Ag. Ipojuca
CAIXA ECONÔMICA

:: CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA

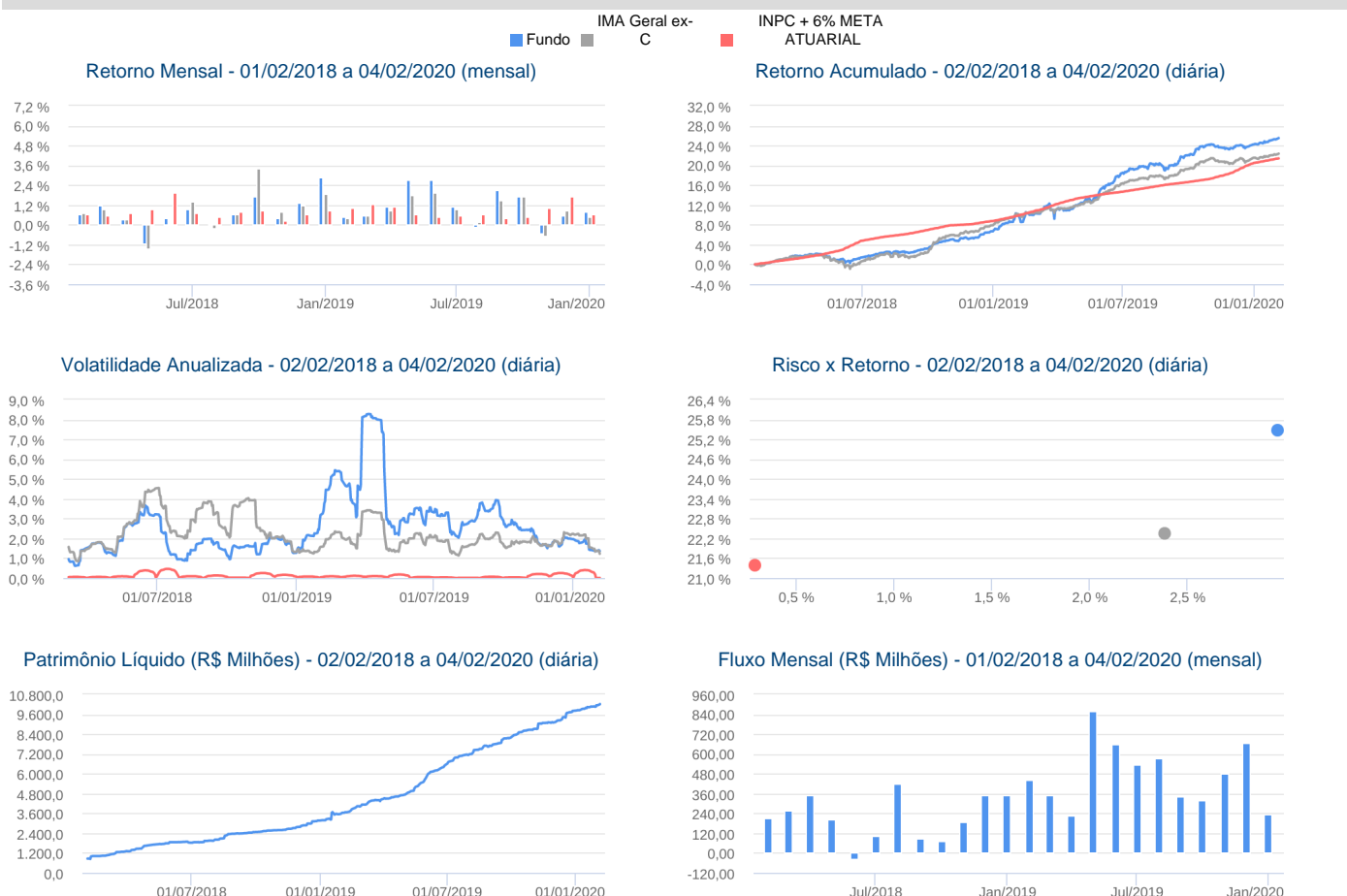
04/02/2020

| Características | Informações Operacionais |
|---|---|
| CNPJ: 23.215.097/0001-55 | Aplicação Mínima: R\$ 1.000,00 |
| Gestão: Caixa Econômica Federal | Aplicação Adicional: R\$ 0,00 |
| Administrador: Caixa Econômica Federal | Saldo Mínimo: R\$ 0,00 |
| Taxa de Administração: 0,20% | Resgate Mínimo: R\$ 0,00 |
| Taxa de Administração (Máxima): 0,40% | Conversão da Cota para Aplicação: D+0 |
| Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Livre Soberano | Conversão da Cota para Resgate: D+0 |
| Código de Referência: 427683 | Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0 |
| Início do Fundo: 04/11/2016 | |

| 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 | 43,44 | 1,03 | 14,18 | 25,49 | 39,31 | 0,82 | 0,59 | -0,51 | 1,71 | 2,12 | -0,13 | 1,11 | 2,73 | 2,72 | 1,11 | 0,54 | 0,50 |
| % do IMA Geral ex-C | 100,51 | 151,63 | 127,23 | 114,07 | 103,48 | 163,78 | 65,24 | 72,02 | 101,02 | 145,46 | -76,20 | 117,10 | 140,44 | 148,51 | 131,98 | 100,48 | 112,94 |
| INPC + 6% META ATUARIAL | 33,72 | 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 |
| IMA Geral ex-C | 43,22 | 0,68 | 11,14 | 22,35 | 37,99 | 0,50 | 0,91 | -0,70 | 1,69 | 1,46 | 0,17 | 0,95 | 1,95 | 1,83 | 0,84 | 0,54 | 0,44 |

| Risco x Retorno (12 meses) | Cota | PL (R\$ mil) | PL Médio (R\$ mil) | Volatilidade | Perda Máxima | VaR | Beta | Tracking Error | Retorno Máximo | Retorno Mínimo | Veze Acima do Benchmark |
|----------------------------|----------|---------------|--------------------|--------------|--------------|-------|------|----------------|----------------|----------------|-------------------------|
| Fundo | 1,434428 | 10.215.071,79 | 7.073.537,49 | 3,64% | -2,73% | 1,73% | 1,52 | 1,88% | 2,73% | -0,51% | 9 |
| IMA Geral ex-C | - | - | - | 2,02% | -1,01% | 0,96% | 1,00 | 0,00% | 1,95% | -0,70% | 0 |

Gráficos



Composição da Carteira

jan/2020

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.

:: CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA

04/02/2020

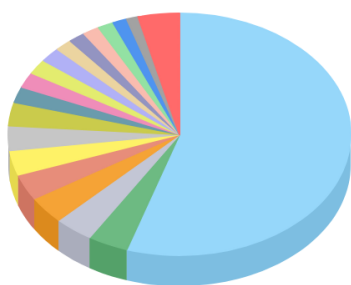
| FUNDO | % do PL | Mês | | Desde o início | | Desde o início | | Desde o início | | Desde o início | Desde o início |
|----------------------------|---------|---------|----------|----------------|----------|----------------|----------|----------------|----------|----------------|----------------|
| | | Nominal | Relativo | Nominal | Relativo | Nominal | Relativo | Nominal | Relativo | | |
| Cotas de Fundos (omitidas) | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |

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 |
|------------------------------|---------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| Cotas de Fundos | 99,91% | 99,89% | 99,87% | 99,85% | 99,96% | 99,95% | 99,95% | 99,95% |
| Operações Compromissadas | 0,09% | 0,11% | 0,14% | 0,16% | 0,05% | 0,05% | 0,05% | 0,05% |
| Valores a receber | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| Disponibilidades | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| Valores a pagar | -0,00% | -0,00% | -0,00% | -0,00% | -0,00% | -0,00% | -0,00% | -0,00% |
| Títulos Públicos | - | - | - | 0,00% | - | - | - | - |
| Patrimônio Líquido (R\$ mil) | 10.136.705,21 | 9.818.666,12 | 9.094.359,00 | 8.654.594,98 | 8.195.197,00 | 7.692.574,59 | 7.131.247,27 | 6.521.414,05 |
| Data da Divulgação | 07/02/2020 | 08/01/2020 | 04/12/2019 | 06/11/2019 | 07/10/2019 | 03/09/2019 | 05/08/2019 | 05/07/2019 |

Composição da Carteira Consolidada - Ativos (%)

dez/2019



| | |
|--|---------|
| Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2023 | 54,99 % |
| NTN-F - Venc.: 01/01/2027 | 3,80 % |
| NTN-F - Venc.: 01/01/2023 | 3,68 % |
| LTN - Venc.: 01/04/2020 | 3,63 % |
| LFT - Venc.: 01/03/2021 | 3,47 % |
| NTN-F - Venc.: 01/01/2025 | 3,31 % |
| NTN-F - Venc.: 01/01/2021 | 3,28 % |
| LTN - Venc.: 01/10/2020 | 3,13 % |
| LFT - Venc.: 01/03/2026 | 2,11 % |
| LFT - Venc.: 01/03/2020 | 2,04 % |
| LFT - Venc.: 01/09/2022 | 2,01 % |
| LFT - Venc.: 01/03/2023 | 1,95 % |
| LTN - Venc.: 01/07/2023 | 1,63 % |
| Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/04/2020 | 1,57 % |
| LTN - Venc.: 01/01/2020 | 1,57 % |
| LFT - Venc.: 01/03/2024 | 1,51 % |
| NTN-F - Venc.: 01/01/2029 | 1,35 % |
| LTN - Venc.: 01/07/2021 | 1,10 % |
| Lançamentos positivos menores que 1,10% | 3,87 % |

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.