

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: 042/2020 |
| Unidade gestora do RPPS: AUTARQUIA PREVIDENCIARIA DO IPOJUCA - IPOJUCAPREV | | DATA: 02/03/2020 |
| CNPJ: 22.236.946/0001-94 | | |
| VALOR (R\$): 36.524,64 | 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: : :BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES CNPJ: 11.977.794/0001-64 | | |
| Administrador: BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS CNPJ Administrador: 59.281.253/0001-23 Gestão: BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS CNPJ Gestão: 09.631.542/0001-37 Disponibilidade recursos resgatados: D+4 ou D 33 Data de inicio do fundo: 19/07/2010 | Taxa de administração: 3,00% Benchmark: IBOVESPA Taxa de performance: Não possui Retorno Mês Anterior: -7,13% Patrimônio líquido no dia de Movimento: 2.052.659.659,58 Valor da no dia de Movimento: 4,4456389 Qtde de Cotas: 8.215,835973543 | |
| 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 Marinheiro <mmarinheiro.ipojucaprev@gmail.com>

Amortização 2024 FI RF - IPOJUCA/BTG

Johas, Paulo <Paulo.Johas@btgpactual.com>

28 de fevereiro de 2020 14:37

Para: Marcelo Marinheiro <mmarinheiro.ipojucaprev@gmail.com>

Cc: "vanusasouza24@hotmail.com" <vanusasouza24@hotmail.com>, "eduardosilva.duda1@bol.com.br" <eduardosilva.duda1@bol.com.br>, "Watkins, Victor" <Victor.Watkins@btgpactual.com>, ol-middle-institucionais <ol-middle-institucionais@btgpactual.com>

Prezados, boa tarde

Aplicação realizada com sucesso.

Att,

Paulo Johas

Fund Services

Tel. +55 21 3262 9195

btgpactual.com  /BTGPactual  /BTGPactual

[Texto das mensagens anteriores oculto]

:: BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES

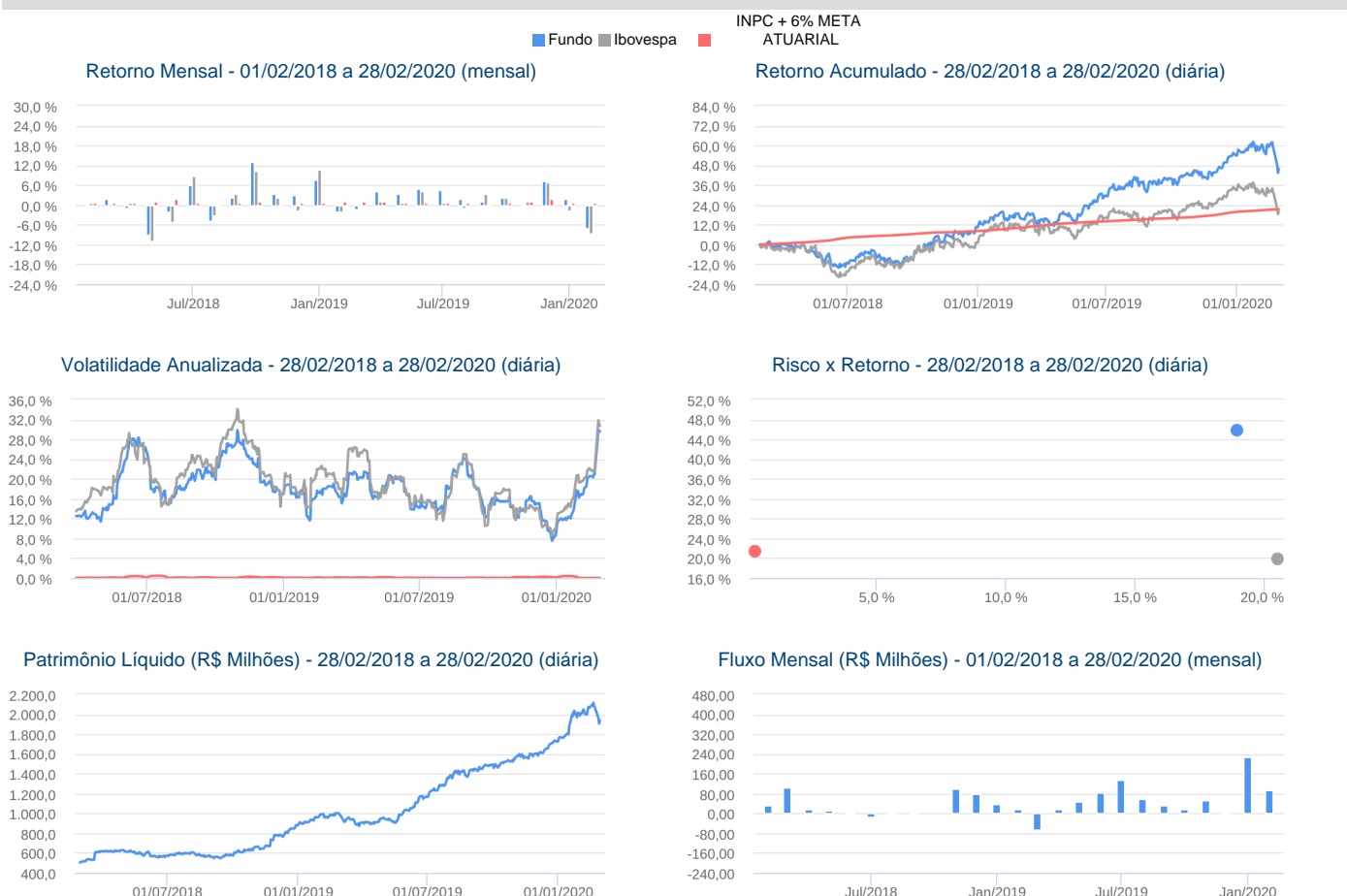
28/02/2020

| Características | Informações Operacionais |
|---|--|
| CNPJ: 11.977.794/0001-64 | Aplicação Mínima: R\$ 5.000,00 |
| Gestão: BTG Pactual Gestora de Recursos | Aplicação Adicional: R\$ 0,00 |
| Administrador: BTG Pactual Serviços Financeiros | Saldo Mínimo: R\$ 0,00 |
| Taxa de Administração: 3,00% | Resgate Mínimo: R\$ 0,00 |
| Taxa de Administração (Máxima): 3,00% | Conversão da Cota para Aplicação: D+1 du |
| Classificação Anbima: Ações Livre | Conversão da Cota para Resgate: D+1 du ou D+30 (isento de taxa de resgate) |
| Código de Referência: 252311 | Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+4 du ou D+32 (isento de taxa de resgate) |
| Início do Fundo: 19/07/2010 | |

| Retorno (%) | Início | Ano | 12 meses | 24 meses | 36 meses | fev/20 | jan/20 | dez/19 | nov/19 | out/19 | set/19 | ago/19 | jul/19 | jun/19 | mai/19 | abr/19 | mar/19 |
|-------------------------|--------|-------|----------|----------|----------|--------|---------|--------|--------|--------|--------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Fundo | 333,40 | -5,24 | 23,66 | 45,80 | 89,91 | -7,13 | 2,03 | 7,19 | 0,24 | 2,34 | 1,25 | 1,93 | 4,60 | 4,85 | 3,30 | 4,01 | -1,42 |
| % do Ibovespa | 516,30 | 52,84 | 335,40 | 231,00 | 172,88 | 84,58 | -124,67 | 105,00 | 25,91 | 99,07 | 35,06 | -289,47 | 549,42 | 119,44 | 469,28 | 407,51 | 800,30 |
| INPC + 6% META ATUARIAL | 198,73 | 1,29 | 10,19 | 21,38 | 31,05 | 0,59 | 0,70 | 1,71 | 1,01 | 0,57 | 0,44 | 0,63 | 0,63 | 0,45 | 0,66 | 1,09 | 1,21 |
| Ibovespa | 64,58 | -9,92 | 7,05 | 19,83 | 52,00 | -8,43 | -1,63 | 6,85 | 0,95 | 2,36 | 3,57 | -0,67 | 0,84 | 4,06 | 0,70 | 0,98 | -0,18 |

| 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 | 4,334026 | 1.938.091,27 | 1.387.481,22 | 18,21% | -11,61% | 8,65% | 0,83 | 7,19% | 7,19% | -7,13% | 8 |
| Ibovespa | - | - | - | 19,31% | -13,84% | 9,17% | 1,00 | 0,00% | 6,85% | -8,43% | 0 |

Gráficos



Composição da Carteira

fev/2020

Performance dos Fundos em Carteira

Retorno (%) / % do Benchmark - Ibovespa

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.

:: BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES

28/02/2020

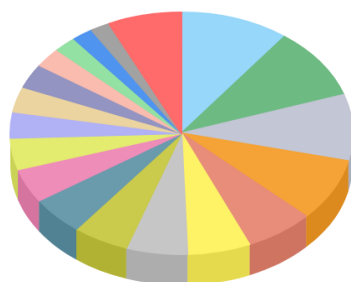
| FUNDO | % do PL | Mês | | Desde o início | | Desde o início | | Desde o início | | Desde o início | Desde o início |
|---|---------|---------|----------|----------------|----------|----------------|----------|----------------|----------|----------------|----------------|
| | | Nominal | Relativo | Nominal | Relativo | Nominal | Relativo | Nominal | Relativo | Volatilidade | PL Médio |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL MASTER FIC AÇÕES | 100,00 | -6,93 | 82,22 | 235,55 | 345,70 | 235,55 | 345,70 | 235,55 | 345,70 | - | |

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

| Tipo de Aplicação | fev/20 | jan/20 | dez/19 | nov/19 | out/19 | set/19 | ago/19 | jul/19 |
|------------------------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| Cotas de Fundos | 100,00% | 100,01% | 100,01% | 100,00% | 100,01% | 100,00% | 100,00% | 100,00% |
| Valores a receber | 3,34% | 0,01% | 0,11% | 0,12% | 0,08% | 0,36% | 0,45% | 0,02% |
| Operações Compromissadas | 0,29% | 0,27% | 0,28% | 0,24% | 0,30% | 0,28% | 0,24% | 0,26% |
| Valores a pagar | -3,63% | -0,29% | -0,40% | -0,36% | -0,39% | -0,64% | -0,69% | -0,28% |
| Patrimônio Líquido (R\$ mil) | 1.938.091,27 | 1.987.548,22 | 1.723.423,21 | 1.600.410,39 | 1.541.004,27 | 1.490.872,97 | 1.439.217,48 | 1.355.441,36 |
| Data da Divulgação | 09/03/2020 | 10/02/2020 | 09/01/2020 | 09/12/2019 | 11/11/2019 | 09/10/2019 | 09/09/2019 | 08/08/2019 |

Composição da Carteira Consolidada - Ativos (%)

jan/2020



| | |
|--|---------|
| Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/05/2023 | 10,32 % |
| B3 ON NM - B3SA3 | 9,63 % |
| MAGAZ LUIZA ON NM - MGLU3 | 8,92 % |
| LOCALIZA ON NM - RENT3 | 8,40 % |
| VALE ON N1 - VALE3 | 6,52 % |
| ULTRAPAR ON NM - UGPA3 | 5,97 % |
| EQUATORIAL ON NM - EQTL3 | 5,83 % |
| PETROBRAS PN - PETR4 | 5,32 % |
| LOJAS RENNER ON NM - LREN3 | 5,13 % |
| INTERMEDICA ON NM - GNDI3 | 4,58 % |
| BRF SA ON NM - BRFS3 | 4,25 % |
| M.DIASBRANCO ON NM - MDIA3 | 3,49 % |
| GRUPO NATURA ON NM - NTCO3 | 3,42 % |
| HAPVIDA ON NM - HAPV3 | 3,25 % |
| MRV ON NM - MRVE3 | 2,64 % |
| GERDAU PN N1 - GGBR4 | 2,14 % |
| LIGHT S/A ON NM - LIGT3 | 2,01 % |
| ITAUSA PN N1 - ITSA4 | 1,84 % |
| Lançamentos positivos menores que 1,84% | 6,99 % |

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.