



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: 086/2020 |
| Unidade gestora do RPPS: AUTARQUIA PREVIDENCIARIA DO IPOJUCA - IPOJUCAPREV CNPJ: 22.236.946/0001-94 | | DATA: 19/05/2020 |
| VALOR (R\$): 53.611,88 | TIPO DE OPERAÇÃO: Aplicação | Dispositivos de resolução do CMN: 3.922/2010, Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b |
| HISTÓRICO / DESCRIÇÃO DA OPERAÇÃO: APLICAÇÃO DE SALDO PROVENIENTE DO PAGAMENTO DE CUPOM DO FUNDO BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO PREVIAMENTE CREDENCIANDO, QUE CONTA COM UM BOM HISTÓRICO DE RENTABILIDADE E ESTÁ DE ACORDO COM A POLÍTICA DE INVESTIMENTOS VIGENTE. | | |
| 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 Mês Anterior: 0,91% Patrimônio líquido no dia de Movimento: 10.535.188.795,42 Valor da no dia de Movimento: 1,452433057 Qtde de Cotas: 36.911,773483547 | |
| 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: HELTON CARLOS DE ALBUQUERQUE FERREIRA CPF: 095.019.444-17 |

:: BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO

15/05/2020

| 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 | abr/20 | mar/20 | fev/20 | jan/20 | dez/19 | nov/19 | out/19 | set/19 | ago/19 | jul/19 | jun/19 | mai/19 |
| Fundo | 44,64 | -0,51 | 7,70 | 19,74 | 30,51 | 0,91 | -2,10 | 0,46 | 0,49 | 0,96 | -0,94 | 1,80 | 1,50 | 0,08 | 1,02 | 2,17 | 2,02 |
| % do IMA Geral ex-C | 98,00 | 144,85 | 102,25 | 101,62 | 98,87 | 108,38 | 108,67 | 102,51 | 97,12 | 105,42 | 133,75 | 106,25 | 102,93 | 49,86 | 107,63 | 111,45 | 110,28 |
| INPC + 6% META ATUARIAL | 37,55 | 2,34 | 8,39 | 20,59 | 30,08 | 0,23 | 0,69 | 0,59 | 0,70 | 1,71 | 1,01 | 0,57 | 0,44 | 0,63 | 0,63 | 0,45 | 0,66 |
| IMA Geral ex-C | 45,55 | -0,36 | 7,53 | 19,43 | 30,86 | 0,84 | -1,93 | 0,44 | 0,50 | 0,91 | -0,70 | 1,69 | 1,46 | 0,17 | 0,95 | 1,95 | 1,83 |
| 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 | 1,446371089 | 10.498.560,85 | 8.992.648,64 | 6,04% | -5,49% | 2,87% | 1,14 | 0,81% | 2,17% | -2,10% | 7 | | | | | | |
| IMA Geral ex-C | - | - | - | 5,24% | -4,93% | 2,49% | 1,00 | 0,00% | 1,95% | -1,93% | 0 | | | | | | |

Gráficos

Composição da Carteira

mai/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.

:: BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO

15/05/2020

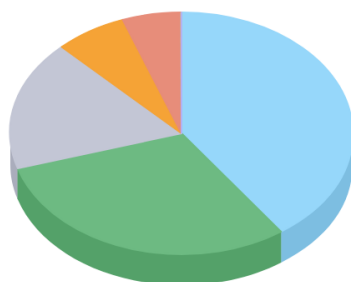
| FUNDO | % do PL | Mês | | Desde o início | | Desde o início | | Desde o início | | Desde o início | Desde o início |
|--|---------|---------|----------|----------------|----------|----------------|----------|----------------|----------|----------------|----------------|
| | | Nominal | Relativo | Nominal | Relativo | Nominal | Relativo | Nominal | Relativo | Volatilidade | PL Médio |
| BB TOP RF AGRESSIVO PRÉ FI RENDA FIXA LP | 40,12 | -0,03 | 17,74 | 630,17 | - | 630,17 | - | 630,17 | - | - | |
| BB TOP IRF-M 1 FI RENDA FIXA | 30,22 | 0,20 | -110,65 | 7,76 | 79,25 | 7,76 | 79,25 | 7,76 | 79,25 | - | |
| BB TOP RF ÍNDICE DE PREÇO FI RENDA FIXA LP | 17,34 | -0,87 | 473,25 | 358,56 | 117,94 | 358,56 | 117,94 | 358,56 | 117,94 | - | |
| BB TOP IMA-B 5 ALOCAÇÃO FI RENDA FIXA | 6,75 | 0,58 | -313,52 | 7,63 | 120,70 | 7,63 | 120,70 | 7,63 | 120,70 | - | |
| BB TOP IMA-B 5+ FI RENDA FIXA | 5,57 | -2,10 | 1.139,22 | 0,61 | 9,72 | 0,61 | 9,72 | 0,61 | 9,72 | - | |

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

| Tipo de Aplicação | mai/20 | abr/20 | mar/20 | fev/20 | jan/20 | dez/19 | nov/19 | out/19 |
|------------------------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|--------------|--------------|--------------|
| Cotas de Fundos | 100,00% | 99,95% | 99,99% | 99,93% | 99,99% | 100,00% | 100,00% | 100,00% |
| Valores a receber | 0,00% | 0,05% | 0,01% | 0,07% | 0,01% | 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% |
| Patrimônio Líquido (R\$ mil) | 10.653.642,52 | 10.512.346,44 | 10.536.452,77 | 10.908.803,62 | 10.446.730,36 | 9.800.245,40 | 9.385.285,18 | 8.931.824,90 |
| Data da Divulgação | 03/06/2020 | 07/05/2020 | 08/04/2020 | 06/03/2020 | 05/02/2020 | 06/01/2020 | 05/12/2019 | 05/11/2019 |

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

mai/2020



| | |
|---|---------|
| ■ Cotas de BB TOP RF AGRESSIVO PRÉ FI RENDA FIXA LP | 40,12 % |
| ■ Cotas de BB TOP IRF-M 1 FI RENDA FIXA | 30,22 % |
| ■ Cotas de BB TOP RF ÍNDICE DE PREÇO FI RENDA FIXA LP | 17,34 % |
| ■ Cotas de BB TOP IMA-B 5 ALOCAÇÃO FI RENDA FIXA | 6,75 % |
| ■ Cotas de BB TOP IMA-B 5+ FI RENDA FIXA | 5,57 % |
| ■ Outras Disponibilidades | 0,00 % |
| ■ Outros Valores a receber | 0,00 % |
| ■ Valores a pagar / Taxa de Administração | 0,00 % |
| ■ Valores a pagar / Controladoria | 0,00 % |
| ■ Valores a pagar / Taxa Cetip | 0,00 % |
| ■ Valores a pagar / Auditoria | 0,00 % |
| ■ Outros Valores a pagar | 0,00 % |