

**IPOJUCAPREV**

A PREVIDÊNCIA DA GENTE

AUTARQUIA PREVIDENCIÁRIA DO IPOJUCA

 <p><b>IPOJUCAPREV</b> A PREVIDÊNCIA DA GENTE AUTARQUIA PREVIDENCIÁRIA DO IPOJUCA</p>	<p><b>AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO RESGATE – APR</b></p> <p><b>ART. 3º-B DA PORTARIA MPS Nº 519/2011, INCLUÍDO PELO ART. 2º DA PORTARIA MPS Nº 170, DE 25/04/2012</b></p>	
<p><b>AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR</b></p> <p><b>Unidade gestora do RPPS: AUTARQUIA PREVIDENCIARIA DO IPOJUCA</b> - IPOJUCAPREV</p> <p>CNPJ: 22.236.946/0001-94</p>		<p>Nº / ANO: 233/2020</p> <hr/> <p>DATA: 17/11/2020</p>
<p><b>VALOR (R\$): 750.000,00</b></p> <p><b>TIPO DE OPERAÇÃO:</b> Aplicação</p>	<p><b>Dispositivos de resolução do CMN:</b> 3.922/2010, Artigo 9º - A, Inciso III</p>	
<p><b>HISTÓRICO / DESCRIÇÃO DA OPERAÇÃO:</b></p> <p>Movimentação realizada com base na análise feita pelo relatório de alocação apresentado aos conselhos e aprovado pelo Comitê de Investimentos na reunião do dia 28/10/2020. A aplicação visou aumentar a participação dos investimentos em ativos lastreados em empresas estrangeiras, que sofrem risco cambial.</p>		
<p><b>CARACTERÍSTICAS DO ATIVO:</b></p> <p>:: CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES <span style="float: right;">CNPJ: 17.502.937/0001-68</span></p>		
<p><b>Administrador:</b> CAIXA ECONÔMICA FEDERAL</p> <p><b>CNPJ Administrador:</b> 00.360.305/0001-04</p> <p><b>Gestão:</b> CAIXA ECONÔMICA FEDERAL</p> <p><b>CNPJ Gestão:</b> 00.360.305/0001-04</p> <p><b>Disponibilidade recursos resgatados:</b> D+4</p> <p><b>Data de inicio do fundo:</b> 24/06/2013</p>	<p><b>Taxa de administração:</b> 0,70%</p> <p><b>Benchmark:</b> Global BDRX</p> <p><b>Taxa de performance:</b> Não Possui</p> <p><b>Retorno Mês Anterior:</b> -1,77%</p> <p><b>Patrimônio líquido no dia de Movimento:</b> 1.792.754.845,44</p> <p><b>Valor da cota no dia de Movimento:</b> 5,123321</p> <p><b>Qtde de Cotas:</b> 146.389,422017477</p>	
<p><b>Proponente:</b> MARCELO VILAS BOAS MARINHEIRO DA SILVA</p> <p>CPF: 055.431.764-81</p> <p><i>Marcelo Vilas Boas M. da Silva</i> MARCELO VILAS-BOAS M. DA SILVA DIRETOR DE INVESTIMENTOS IPOJUCAPREV MATRÍCULA -66614</p>	<p><b>Gestor/Autorizador:</b> MARCELO VILAS BOAS MARINHEIRO DA SILVA</p> <p>CPF: 055.431.764-81</p> <p><b>Certificação:</b> ANBIMA</p> <p><b>Validade:</b> 28/01/2022</p> <p><i>Marcelo Vilas Boas M. da Silva</i> MARCELO VILAS-BOAS M. DA SILVA DIRETOR DE INVESTIMENTOS IPOJUCAPREV MATRÍCULA -66614</p>	<p><b>Responsável pela liquidação da operação:</b> HELTON CARLOS DE ALBUQUERQUE FERREIRA</p> <p>CPF: 095.019.444-17</p> <p><i>Helton Carlos de Albuquerque Ferreira</i> Helton Carlos de Albuquerque Ferreira Presidente Executivo - IPOJUCAPREV Matrícula: 71917</p>

Rua do Comércio, nº152 - Centro, Ipojuca - PE - CEP 55590 - 000

Fone: (81) 3551-2523; 3551-0981 - CNPJ. 22.236.946/0001-94

www.funprei.ipojuca.pe.gov.br



Ofício Nº 745/2020

Ipojuca-PE, 16 de Novembro de 2020

**À Caixa Econômica Federal**  
**Luciano Pereira de Lucena**

**Ref. Alocação de Recursos**

Considerando o cenário macroeconômico e visando o ajuste da carteira, de acordo com a estratégia que foi estabelecida e aprovada pelo Comitê de Investimentos, solicitamos que sejam feitas as seguintes movimentações:

**Resgate**

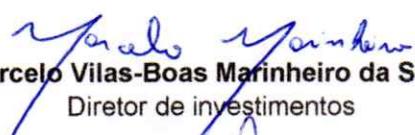
Fundo: CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA  
CNPJ 14.508.643/0001-55  
Conta vinculada: 20-9  
Valor: R\$ 750.000,00 (Setecentos e Cinquenta Mil Reais)

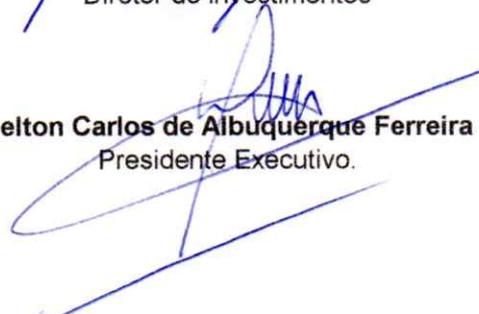
**Transferência**

Origem: Conta 20-9  
Destino: Conta 22-5  
Valor: R\$ 750.000,00 (Setecentos e Cinquenta Mil Reais)

**Aplicação**

Fundo: CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I  
CNPJ 17.502.937/0001-68  
Conta vinculada: 22-5  
Valor: R\$ 750.000,00 (Setecentos e Cinquenta Mil Reais)

  
**Marcelo Vilas-Boas Marinheiro da Silva**  
Diretor de investimentos

  
**Helton Carlos de Albuquerque Ferreira**  
Presidente Executivo.

*Recebido*  
*56/11/2020*  
Larissa de Sá Zoncer  
Assistente de Parejo  
Mat. 135.174  
Adm. Ipojuca  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

**:: CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I**

17/11/2020

Características	Informações Operacionais
CNPJ: 17.502.937/0001-68	Aplicação Mínima: R\$ 10.000,00
Gestão: Caixa Econômica Federal	Aplicação Adicional: R\$ 500,00
Administrador: Caixa Econômica Federal	Saldo Mínimo: R\$ 5.000,00
Taxa de Administração: 0,70%	Resgate Mínimo: R\$ 500,00
Taxa de Administração (Máxima): 0,70%	Conversão da Cota para Aplicação: D+1 du
Classificação Anbima: Ações Livre	Conversão da Cota para Resgate: D+1 du
Código de Referência: 339075	Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+3 du
Início do Fundo: 24/06/2013	

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	out/20	set/20	ago/20	jul/20	jun/20	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19
Fundo	412,33	51,06	51,66	94,01	135,95	-1,77	-1,99	15,16	1,88	4,37	2,78	15,96	6,30	-5,69	6,52	-1,76	8,92
% do Global BDRX	80,43	102,38	101,39	99,69	96,44	101,45	101,01	103,73	105,98	97,15	95,75	97,85	115,25	99,68	100,82	115,59	98,76
INPC + 6% META ATUARIAL	125,97	8,89	11,37	21,49	33,71	1,38	1,36	0,85	0,98	0,79	0,21	0,23	0,69	0,59	0,70	1,71	1,01
Global BDRX	512,66	49,87	50,95	94,30	140,96	-1,75	-1,97	14,62	1,77	4,50	2,90	16,32	5,47	-5,70	6,47	-1,52	9,03

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	5,123321	1.792.754,85	1.129.771,60	29,40%	-19,77%	13,96%	0,99	2,26%	15,96%	-5,69%	5
Global BDRX	-	-	-	29,55%	-20,61%	14,03%	1,00	0,00%	16,32%	-5,70%	0

**Gráficos**

**Composição da Carteira**

nov/2020

**Performance dos Fundos em Carteira**
**Retorno (%) / % do Benchmark - Global BDRX**

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 INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I**

17/11/2020

FUNDO	% do PL	Mês		Ano		12 meses		24 meses		06 meses	12 meses
		Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio
CAIXA MASTER CONSERVADOR FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2,02	0,04	6,12	2,18	4,36	2,76	5,42	8,97	9,51	0,33	R\$ 8.625.376.507,3

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

Tipo de Aplicação	nov/20	out/20	set/20	ago/20	jul/20	jun/20	mai/20	abr/20
Brazilian Depository Receipt - BDR	92,63%	98,46%	98,49%	98,82%	98,03%	98,94%	98,62%	98,64%
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo	6,51%	0,31%	0,73%	0,21%	1,10%	-	0,07%	0,11%
Cotas de Fundos	2,02%	1,70%	2,10%	2,73%	1,16%	1,78%	1,73%	1,80%
Valores a receber	0,11%	0,06%	0,04%	0,10%	0,08%	0,09%	0,65%	0,19%
Outras Aplicações	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	-1,18%	-0,66%	-1,30%	-1,68%	-0,35%	-0,74%	-0,94%	-0,83%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	1.959.218,77	1.678.449,78	1.671.279,12	1.583.297,84	1.279.266,33	1.181.944,57	1.133.955,74	1.075.121,85
Data da Divulgação	03/12/2020	06/11/2020	05/10/2020	08/09/2020	07/08/2020	17/07/2020	10/06/2020	07/05/2020

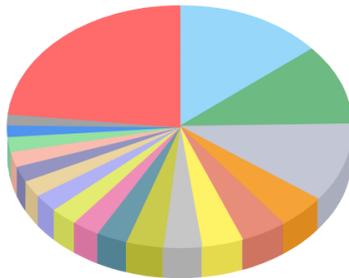
As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas 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 INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I**

17/11/2020

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

nov/2020



APPLE DRN - AAPL34	14,10 %
MICROSOFT DRN - MSFT34	10,88 %
AMAZON DRN - AMZO34	10,71 %
ALIBABAGR DRN - BABA34	4,59 %
FACEBOOK DRN - FBOK34	4,38 %
ALPHABET DRN - GOGL35	3,93 %
TESLA MOTORS DRN - TSLA34	3,63 %
ALPHABET DRN - GOGL34	3,54 %
WAL MART DRN - WALM34	2,92 %
VISA INC DRN - VISA34	2,61 %
JOHNSON DRN - JNJB34	2,57 %
JPMORGAN DRN - JPMC34	2,41 %
NVIDIA CORP DRN - NVDC34	2,23 %
UNITEDHEALTH DRN - UNHH34	2,11 %
BERKSHIRE DRN - BERK34	2,05 %
Cotas de CAIXA MASTER CONSERVADOR FI RENDA FIXA	2,02 %
REFERENCIADO DI L...	
WALT DISNEY DRN - DISB34	1,55 %
COCA COLA DRN - COCA34	1,47 %
Lançamentos positivos menores que 1,47%	23,58 %