PREFEITURA DO IPOJUCA
UM NOVO TEMPO

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 **Unidade gestora do RPPS:** AUTARQUIA PREVIDENCIARIA DO IPOJUCA - IPOJUCAPREV **CNPJ:** 22.236.946/0001-94	**Nº / ANO:** 138/2020 **DATA:** 23/07/2020
VALOR (R$): 2.500.000,00 **TIPO DE OPERAÇÃO:** Aplicação	**Dispositivos de resolução do CMN:** 3.922/2010, Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '

HISTÓRICO / DESCRIÇÃO DA OPERAÇÃO:

Movimentação realizada com base na análise feita pelo relatório de alocação apresentado aos conselhos e aprovado pelo Comitê de Investimentos. Aplicação em fundo de renda fixa, que adota uma gestão ativa dos recursos, buscando superar o seu benchmark IMA-B5.

CARACTERÍSTICAS DO ATIVO:

: :SULAMÉRICA JURO REAL CURTO FI RENDA FIXA LP CNPJ: 16.892.116/0001-12

Administrador: BEM DTVM

CNPJ Administrador: 00.066.670/0001-00

Gestão: SUL AMERICA INVESTIMENTOS GESTORA DE RECURSOS S.A.

CNPJ Gestão: 21.813.291/0001-07

Disponibilidade recursos resgatados: D+2 du

Data de inicio do fundo: 27/02/2013

Taxa de administração: 0,25%

Benchmark: IMA-B 5

Taxa de performance: 20,00

Retorno Mês Anterior: 1,35%

Patrimônio líquido no dia de Movimento: 192.526.013,43

Valor da cota no dia de Movimento: 20,3783987

Qtde de Cotas: 122.678,922755594

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

IPOJUCAPREV
A PREVIDÊNCIA DA GENTE
AUTARQUIA PREVIDENCIÁRIA DO IPOJUCA

Ofício Nº 369/2020

Ipojuca-PE, 01 de Julho de 2020

À Performe
Kirlisson Santos

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: SULAMÉRICA EVOLUTION FI MULTIMERCADO
CNPJ: 12.839.769/0001-87
Valor: Resgate Total

FUNDO: SULAMÉRICA ATIVO FI RENDA FIXA LP
CNPJ: 07.381.653/0001-07
Valor: R$ 3.000.000,00 (Três Mihões de Reais)

Aplicação

FUNDO: SULAMÉRICA JURO REAL CURTO FI RENDA FIXA LP
CNPJ: 16.892.116/0001-12
Valor: R$ 5.500.000,00 (Cinco Milhões e Quinhentos Mil Reais)

Transferência

Destino
Banco Caixa Econômica Federal
Agência 3014
C/C 20-9
CNPJ: 05.364.629/0001-34
Fundo Previdenciário dos Servidores do Município do Ipojuca
Valor: **Saldo restante proveniente do resgate**

Marcelo Vilas-Boas Marinheiro da Silva
Diretor de investimentos

Helton Carlos de Albuquerque Ferreira
Presidente Executivo.

IPOJUCAPREV
A PREVIDÊNCIA DA GENTE
AUTARQUIA PREVIDENCIÁRIA DO IPOJUCA

:: SULAMÉRICA JURO REAL CURTO FI RENDA FIXA LP

23/07/2020

Características

CNPJ: 16.892.116/0001-12
Gestão: SulAmérica Investimentos
Administrador: BEM DTVM
Taxa de Administração: 0,25%
Taxa de Administração (Máxima): 0,25%
Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Livre Soberano
Código de Referência: 329355
Início do Fundo: 27/02/2013

Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R$ 5.000,00
Aplicação Adicional: R$ 2.500,00
Saldo Mínimo: R$ 2.500,00
Resgate Mínimo: R$ 2.500,00
Conversão da Cota para Aplicação: D+0
Conversão da Cota para Resgate: D+1 du
Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+2 du

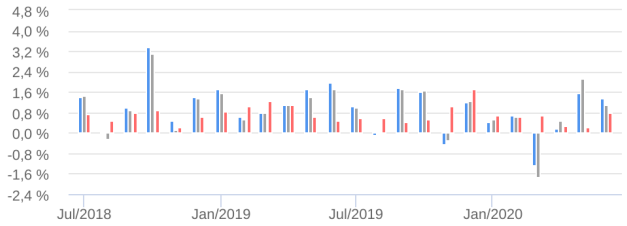
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	jun/20	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19
Fundo	103,78	3,53	7,57	25,80	36,66	1,35	1,55	0,16	-1,28	0,67	0,43	1,21	-0,46	1,64	1,75	-0,06	1,03
% do IMA-B 5	84,12	87,74	89,80	105,84	100,30	121,09	73,06	33,20	73,01	103,91	78,12	97,87	161,37	99,09	100,38	-122,61	105,36
INPC + 6% META ATUARIAL	123,90	4,00	8,75	18,99	30,68	0,79	0,21	0,23	0,69	0,59	0,70	1,71	1,01	0,57	0,44	0,63	0,63
IMA-B 5	123,38	4,02	8,43	24,37	36,55	1,12	2,12	0,49	-1,75	0,64	0,56	1,24	-0,28	1,65	1,74	0,05	0,97

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	20,3783987	192.526,01	163.252,08	5,76%	-4,80%	2,74%	1,01	3,07%	1,75%	-1,28%	4
IMA-B 5	-	-	-	4,93%	-5,38%	2,34%	1,00	0,00%	2,12%	-1,75%	0

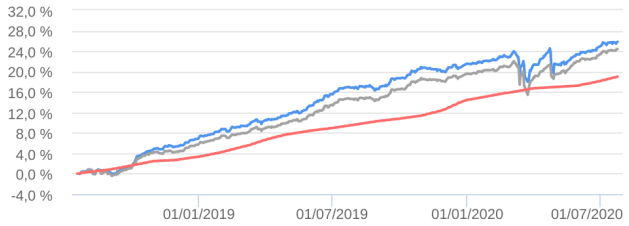
Gráficos

Fundo IMA-B 5 INPC + 6% META ATUARIAL

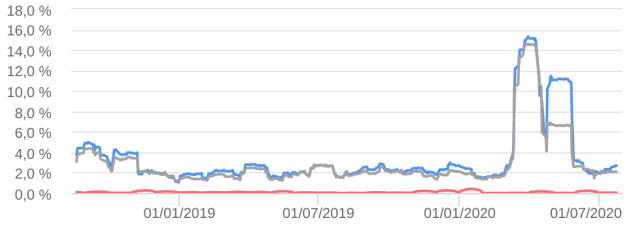
Retorno Mensal - 01/07/2018 a 23/07/2020 (mensal)



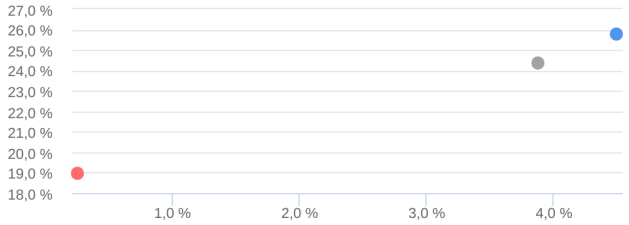
Retorno Acumulado - 23/07/2018 a 23/07/2020 (diária)



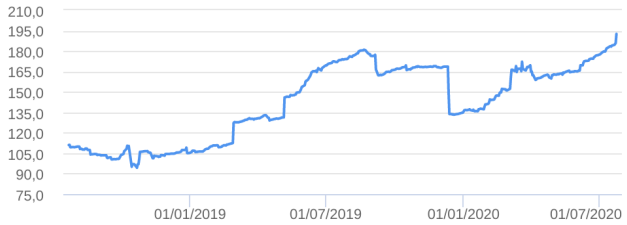
Volatilidade Anualizada - 23/07/2018 a 23/07/2020 (diária)



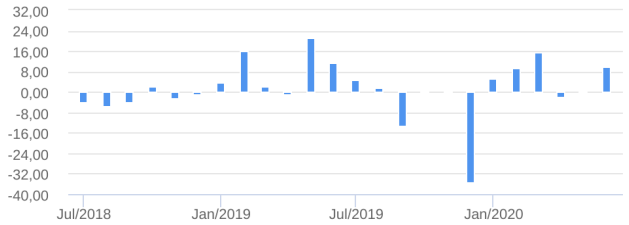
Risco x Retorno - 23/07/2018 a 23/07/2020 (diária)



Patrimônio Líquido (R$ Milhões) - 23/07/2018 a 23/07/2020 (diária)



Fluxo Mensal (R$ Milhões) - 01/07/2018 a 23/07/2020 (mensal)



Composição da Carteira

jul/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.

:: SULAMÉRICA JURO REAL CURTO FI RENDA FIXA LP

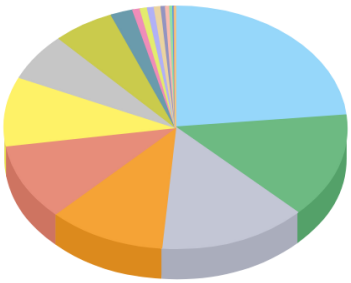
23/07/2020

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	jul/20	jun/20	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19
Títulos Públicos	95,03%	97,12%	-	93,35%	92,38%	87,55%	94,95%	98,76%
Operações Compromissadas	4,93%	2,81%	-	6,57%	10,86%	12,58%	5,06%	1,28%
Mercado Futuro - Posições vendidas	0,17%	-0,55%	-	-1,13%	-2,48%	-0,96%	0,12%	-0,52%
Valores a pagar	0,04%	0,06%	-	-0,04%	-3,10%	-0,06%	-0,07%	-0,06%
Valores a receber	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%
Mercado Futuro - Posições compradas	-0,09%	0,68%	-	1,25%	2,34%	0,89%	-0,07%	0,54%
Patrimônio Líquido (R$ mil)	198.586,39	177.349,42	-	162.811,78	164.735,21	151.093,15	140.823,37	134.725,28
Data da Divulgação	10/08/2020	09/07/2020	-	11/05/2020	10/04/2020	04/03/2020	10/02/2020	22/01/2020

Composição da Carteira Individual - Ativos (%) abr/2020



LFT - Venc.: 01/09/2023	23,97 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2021	14,32 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	14,24 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2020	11,29 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2023	10,50 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2022	9,42 %
LFT - Venc.: 01/09/2024	6,51 %
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/2025	5,91 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2050	2,16 %
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTV21	0,71 %
Mercado Futuro - Posições vendidas - DI1FUTF22	-0,70 %
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/2021	0,66 %
LFT - Venc.: 01/09/2025	0,65 %
Mercado Futuro - Posições vendidas - DI1FUTN21	-0,42 %
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTN22	0,41 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2045	0,30 %
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTJ21	0,09 %
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF21	0,04 %
Lançamentos positivos menores que 0,04%	0,02 %
Lançamentos negativos maiores que -0,42%	-0,07 %

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.