

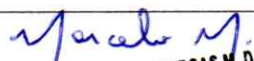


AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO RESGATE – APR

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		Nº / ANO: 154/2020
CNPJ: 22.236.946/0001-94		DATA: 13/08/2020
VALOR (R\$): 1.310.000,00	TIPO DE OPERAÇÃO: Aplicação	Dispositivos de resolução do CMN: 3.922/2010, Artigo 8º, Inciso III
HISTÓRICO / DESCRIÇÃO DA OPERAÇÃO: Movimentação realizada com base na análise feita pelo relatório de alocação apresentado aos conselhos e aprovado pelo Comitê de Investimentos. . O referido fundo é um multimercado, que pode investir em diferentes tipos de investimentos, como títulos públicos, privados, ações, entre outros.		
CARACTERÍSTICAS DO ATIVO: : :CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP CNPJ: 03.737.188/0001-43		
Administrador: Caixa Econômica Federal		Taxa de administração: 1,00%
CNPJ Administrador: 00.360.305/0001-04		Benchmark: CDI
Gestão: CAIXA ECONÔMICA FEDERAL		Taxa de performance: 20,00
CNPJ Gestão: 00.360.305/0001-04		Retorno Mês Anterior: 2,44%
Disponibilidade recursos resgatados: D+4		Patrimônio líquido no dia de Movimento: 2.428.324.193,63
Data de inicio do fundo: 20/06/2000		Valor da cota no dia de Movimento: 7,6433742
		Qtde de Cotas: 171.390,274206384
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  Helton Carlos de Albuquerque Ferreira Presidente Executivo - IPOJUCAPREV Matrícula : 71917


MARCELO VILAS-BOAS M. DA SILVA
DIRETOR DE INVESTIMENTOS
IPOJUCAPREV
MATRICULA -66614


MARCELO VILAS-BOAS M. DA SILVA
DIRETOR DE INVESTIMENTOS
IPOJUCAPREV
MATRICULA -66614
do Comércio, nº15 - CEP 55590 - 000
Fone: (81) 3551-2525; 3551-2526
CNPJ: 22.236.946/0001-94
IpojucaPrev..ipojuca.pe.gov.br



CÓPIA

Ofício Nº 462/2020

Ipojuca-PE, 11 de Agosto 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:20-5
Valor: R\$ 4.910.000,00 (Quatro Milhões Novecentos e Dez Mil Reais)

Transferência

Conta Origem: Conta 20-9
Conta Destino: Conta 22-5
Valor: R\$ 4.910.000,00 (Quatro Milhões Novecentos e Dez Mil Reais)

Aplicação

Fundo: CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP
CNPJ 03.737.188/0001-43
Conta vinculada:22-5
Valor: R\$ 1.310.000,00 (Hum Milhão Trezentos e Dez Mil Reais)

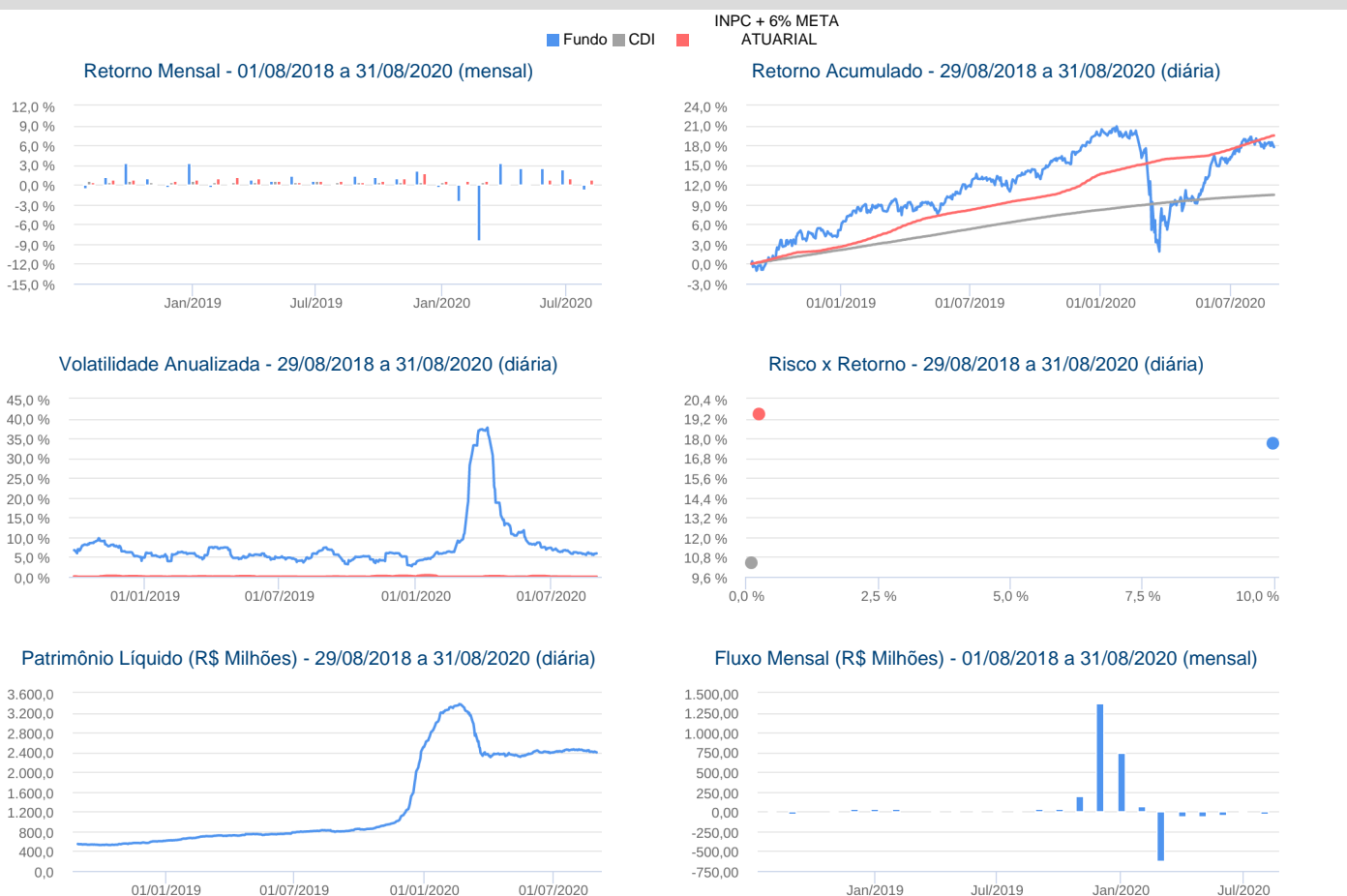
Fundo: CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA
CNPJ 10.740.670/0001-06
Conta vinculada:22-5
Valor: R\$ 3.600.000,00 (Três Milhões e Seiscentos Mil Reais)


Marcelo Vilas-Boas Marinheiro da Silva
Diretor de investimentos


Helton Carlos de Albuquerque Ferreira
Presidente Executivo.


Larissa de Sá Concerva
Assistente de Varejo
Mat. 135.174-7
Ag. Ipojuca
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Características		Informações Operacionais															
CNPJ: 03.737.188/0001-43		Aplicação Mínima: R\$ 500,00															
Gestão: Caixa Econômica Federal		Aplicação Adicional: R\$ 100,00															
Administrador: Caixa Econômica Federal		Saldo Mínimo: R\$ 100,00															
Taxa de Administração: 1,00%		Resgate Mínimo: R\$ 100,00															
Taxa de Administração (Máxima): 1,00%		Conversão da Cota para Aplicação: D+0															
Classificação Anbima: Multimercados Balanceados		Conversão da Cota para Resgate: D+1 du															
Código de Referência: 94552		Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+3 du															
Início do Fundo: 20/06/2000																	
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	ago/20	jul/20	jun/20	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19	set/19
Fundo	649,36	-1,51	4,36	17,70	26,12	-0,78	2,44	2,60	2,49	3,40	-8,45	-2,41	-0,25	2,22	1,10	1,19	1,32
% do CDI	74,75	-71,48	112,88	169,22	144,13	-484,90	1.253,80	1.224,51	1.054,35	1.191,73	-2.496,14	-820,54	-66,35	592,74	289,30	248,51	285,07
INPC + 6% META ATUARIAL	919,30	5,15	9,12	19,46	31,23	0,85	0,98	0,79	0,21	0,23	0,69	0,59	0,70	1,71	1,01	0,57	0,44
CDI	868,75	2,12	3,86	10,46	18,13	0,16	0,19	0,21	0,24	0,28	0,34	0,29	0,38	0,37	0,38	0,48	0,46
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	7,6379679	2.397.521,16	2.093.462,36	12,71%	-15,71%	6,04%	-2,91	12,71%	3,40%	-8,45%	8						
CDI	-	-	-	0,07%	-	0,03%	1,00	0,00%	0,48%	0,16%	0						

Gráficos

Composição da Carteira

ago/2020

Performance dos Fundos em Carteira

Retorno (%) / % do Benchmark - CDI

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 RV 30 FI MULTIMERCADO LP

31/08/2020

FUNDO	% do PL	Mês		Ano		12 meses		Desde o início		06 meses	12 meses
		Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio
Cotas de Fundos (omitidas)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Tipo de Aplicação	ago/20	jul/20	jun/20	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20
Títulos Públicos	75,41%	76,69%	76,01%	75,52%	75,53%	66,64%	43,64%	46,21%
Operações Compromissadas	24,00%	22,59%	23,01%	23,40%	24,39%	33,31%	56,91%	54,79%
Ações	0,76%	0,73%	0,69%	0,64%	0,60%	0,54%	0,57%	-
Cotas de Fundos	0,66%	0,66%	0,61%	0,54%	0,52%	0,46%	0,53%	0,10%
Valores a pagar	0,25%	0,23%	0,28%	-0,22%	-0,26%	-0,54%	-1,89%	-0,68%
Opções - Posições titulares	0,08%	0,10%	0,13%	0,10%	0,15%	0,60%	0,10%	0,05%
DIFERENCIAL DE SWAP A RECEBER	0,05%	0,06%	0,03%	0,01%	-	-	-	-
DIFERENCIAL DE SWAP A PAGAR	0,02%	0,03%	0,02%	-0,00%	-	-	-	-
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%
Mercado Futuro - Posições vendidas	0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,02%	-0,01%	-0,03%	-0,01%	0,00%
Opções - Posições lançadas	-0,07%	-0,07%	-0,06%	-0,04%	-0,02%	-0,39%	-0,07%	-0,03%
Mercado Futuro - Posições compradas	-0,62%	-0,50%	-0,12%	0,08%	-0,90%	-0,59%	0,23%	-0,44%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	2.397.521,16	2.446.474,41	2.392.681,00	2.366.607,65	2.360.480,28	2.344.032,16	3.237.870,63	3.249.056,14
Data da Divulgação	08/09/2020	06/08/2020	06/07/2020	10/06/2020	08/05/2020	09/04/2020	04/03/2020	07/02/2020

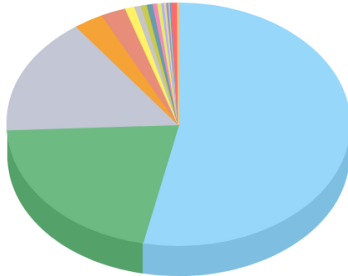
As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas 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 RV 30 FI MULTIMERCADO LP

31/08/2020

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

mai/2020



LFT - Venc.: 01/03/2026 (BRSTNCLF1RE0)	53,68 %
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/05/2055	21,06 %
LFT - Venc.: 01/03/2024 (BRSTNCLF1RA8)	15,71 %
LFT - Venc.: 01/09/2020 (BRSTNCLF1R33)	2,81 %
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/01/2022	2,34 %
LFT - Venc.: 01/09/2022 (BRSTNCLF1R74)	0,90 %
LFT - Venc.: 01/09/2024 (BRSTNCLF0008)	0,64 %
LFT - Venc.: 01/03/2023 (BRSTNCLF1R82)	0,55 %
Cotas de ISHARES BM&FBOVESPA SMALL CAP FUNDO DE ÍNDICE - SMAL11	0,54 %
LFT - Venc.: 01/03/2022 (BRSTNCLF1R66)	0,43 %
LFT - Venc.: 01/03/2021 (BRSTNCLF1R41)	0,38 %
LFT - Venc.: 01/09/2023 (BRSTNCLF1R90)	0,25 %
Outros Valores a pagar	-0,22 %
LFT - Venc.: 01/09/2018 (BRSTNCLF1R58)	0,18 %
AMBEV S/A ON - ABEV3	0,08 %
Opções - Posições titulares - IBOVX89	0,07 %
MAGAZ LUIZA ON NM - MGLU3	0,06 %
Mercado Futuro - Posições compradas - INDFUTM20	0,05 %
Lançamentos positivos menores que 0,05%	0,56 %
Lançamentos negativos maiores que -0,22%	-0,06 %