



# 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: 204/2020

DATA: 06/10/2020

VALOR (R\$): 1.000.000,00 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 na reunião do dia 29/09/2020. 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: -2,05%

Disponibilidade recursos resgatados: D+4

Patrimônio líquido no dia de Movimento:  
2.275.583.615,40

Data de início do fundo: 20/06/2000

Valor da cota no dia de Movimento:  
7,4559799

Qtde de Cotas: 134.120,533238025

### 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

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

Rua do Comércio, nº 152 - PE - CEP 55590 - 00  
Fone: (81) 3551-2523; 3551-66614  
CNPJ: 22.236.946/0001-94

ipojucaprev.ipojuca.pe.gov.br

Helton Carlos de Albuquerque Ferreira  
Presidente Executivo - IPOJUCAPREV  
Matrícula : 71917



Ofício Nº 643/2020

Ipojuca-PE, 06 de Outubro 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:

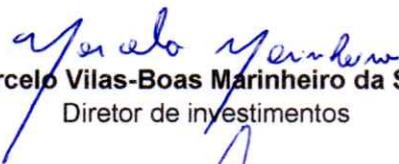
**Resgate**

Fundo: CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA  
CNPJ 10.740.670/0001-06  
Conta vinculada: 22-5  
Valor: R\$ 3.000.000,00 (Três Milhões de Reais)

**Aplicação**

Fundo: CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP  
CNPJ 03.737.188/0001-43  
Conta vinculada: 22-5  
Valor: R\$ 1.000.000,00 (Hum Milhão de Reais)

Fundo: CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP  
CNPJ 14.508.605/0001-00  
Conta vinculada: 22-5  
Valor: R\$ 2.000.000,00 (Dois Milhões de Reais)

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

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

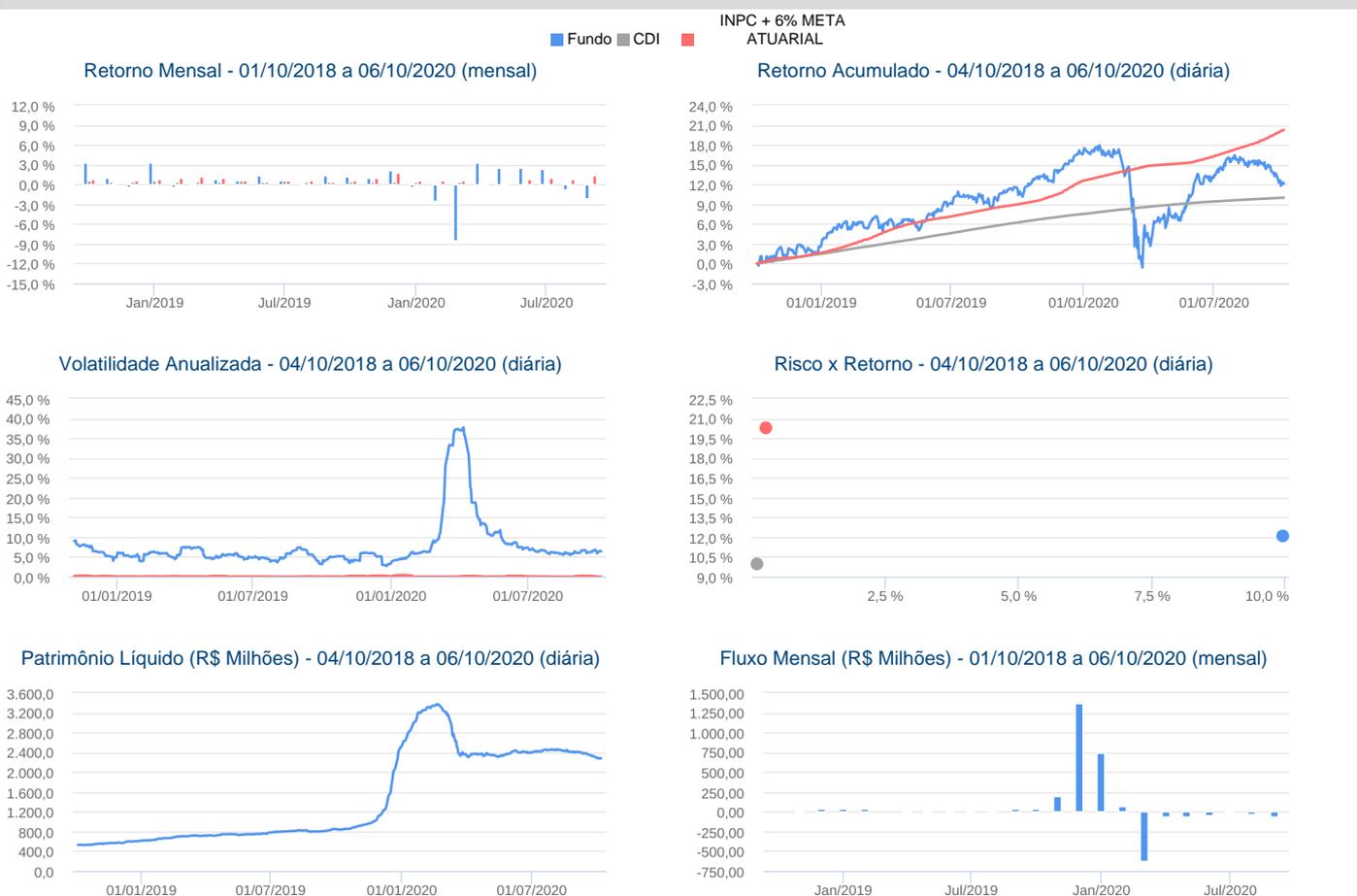
*Recebido em*  
*06/10/2020*

  
**TIAGO VEIRAS AMBRÍGUES**  
Gerente de Relacionamento PJ PUBIPRIV  
Matr. 138.8659-6  
Ag. Ipojuca/PE  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

**:: CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP**

06/10/2020

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	set/20	ago/20	jul/20	jun/20	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19	nov/19	out/19
Fundo	631,51	-3,86	1,09	12,12	20,54	-2,05	-0,78	2,44	2,60	2,49	3,40	-8,45	-2,41	-0,25	2,22	1,10	1,19
% do CDI	72,54	-167,32	31,32	121,37	118,11	-1.308,64	-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
INPC + 6% META ATUARIAL	935,87	6,86	10,30	20,28	32,63	1,36	0,85	0,98	0,79	0,21	0,23	0,69	0,59	0,70	1,71	1,01	0,57
CDI	870,56	2,31	3,49	9,99	17,39	0,16	0,16	0,19	0,21	0,24	0,28	0,34	0,29	0,38	0,37	0,38	0,48
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	7,4559799	2.275.583,62	2.244.957,19	12,82%	-15,71%	6,09%	0,70	12,82%	3,40%	-8,45%	6						
CDI	-	-	-	0,07%	-	0,03%	1,00	0,00%	0,38%	0,16%	0						

**Gráficos**

**Composição da Carteira**

out/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**

06/10/2020

FUNDO	% do PL	Mês		Ano		12 meses		24 meses		06 meses		12 meses	
		Nominal	Relativo	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	out/20	set/20	ago/20	jul/20	jun/20	mai/20	abr/20	mar/20
Títulos Públicos	81,04%	75,85%	75,41%	76,69%	76,01%	75,52%	75,53%	66,64%
Operações Compromissadas	18,73%	22,78%	24,00%	22,59%	23,01%	23,40%	24,39%	33,31%
Ações	0,68%	0,69%	0,76%	0,73%	0,69%	0,64%	0,60%	0,54%
Cotas de Fundos	0,66%	0,66%	0,66%	0,66%	0,61%	0,54%	0,52%	0,46%
Valores a pagar	0,45%	0,34%	0,25%	-0,23%	-0,28%	-0,22%	-0,26%	-0,54%
Opções - Posições titulares	0,05%	0,06%	0,08%	0,10%	0,13%	0,10%	0,15%	0,60%
DIFERENCIAL DE SWAP A RECEBER	0,02%	0,04%	0,05%	0,06%	0,03%	0,01%	-	-
DIFERENCIAL DE SWAP A PAGAR	0,02%	0,02%	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%	-0,00%	-0,00%	-0,02%	-0,01%	-0,03%
Opções - Posições lançadas	-0,02%	-0,02%	-0,07%	-0,07%	-0,06%	-0,04%	-0,02%	-0,39%
Mercado Futuro - Posições compradas	-0,69%	0,30%	-0,62%	-0,50%	-0,12%	0,08%	-0,90%	-0,59%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	2.234.637,77	2.292.815,96	2.397.521,16	2.446.474,41	2.392.681,00	2.366.607,65	2.360.480,28	2.344.032,16
Data da Divulgação	06/11/2020	08/10/2020	08/09/2020	06/08/2020	06/07/2020	10/06/2020	08/05/2020	09/04/2020

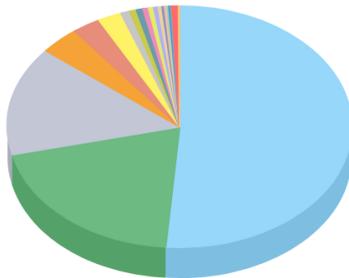
As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas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

06/10/2020

## Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

jul/2020



LFT - Venc.: 01/03/2026	52,14 %
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/08/2026	20,33 %
LFT - Venc.: 01/03/2024	14,82 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2022	3,76 %
LFT - Venc.: 01/09/2020	2,73 %
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/2021	2,26 %
LFT - Venc.: 01/09/2022	0,87 %
Cotas de ISHARES BM&FBOVESPA SMALL CAP FUNDO DE ÍNDICE - SMAL11	0,66 %
LFT - Venc.: 01/09/2024	0,62 %
LFT - Venc.: 01/03/2023	0,54 %
Mercado Futuro - Posições compradas - INDFUTQ20	-0,49 %
LFT - Venc.: 01/03/2022	0,42 %
LFT - Venc.: 01/03/2021	0,37 %
LFT - Venc.: 01/09/2023	0,24 %
Outros Valores a pagar	-0,23 %
LFT - Venc.: 01/09/2021	0,17 %
VIAVAREJO ON N2 - VVAR3	0,17 %
MAGAZ LUIZA ON NM - MGLU3	0,15 %
Lançamentos positivos menores que 0,15%	0,58 %
Lançamentos negativos maiores que -0,23%	-0,11 %