



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: 209/2020 DATA: 08/10/2020
VALOR (R\$): 1.165.878,92 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 CNPJ Administrador: 00.360.305/0001-04 Gestão: CAIXA ECONÔMICA FEDERAL CNPJ Gestão: 00.360.305/0001-04 Disponibilidade recursos resgatados: D+4 Data de início do fundo: 20/06/2000	Taxa de administração: 1,00% Benchmark: CDI Taxa de performance: 20,00 Retorno Mês Anterior: -2,05% Patrimônio líquido no dia de Movimento: 2.282.810.786,26 Valor da cota no dia de Movimento: 7,5112983 Qtde de Cotas: 155.216,698024095

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

Marcelo Vilas Boas
MARCELO VILAS BOAS M. DA SILVA
DIRETOR DE INVESTIMENTOS
IPOJUCAPREV
MATRÍCULA 66614

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



Ofício N° 642/2020

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 CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO
CNPJ 29.388.994/0001-47
Conta vinculada: 22-5
Valor: Resgate total


Aplicação

Fundo: CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP
CNPJ 03.737.188/0001-43
Conta vinculada: 22-5
Valor: Saldo total do resgate realizado


Marcelo Vilas-Boas Marinheiro da Silva
Diretor de investimentos


Helton Carlos de Albuquerque Ferreira
Presidente Executivo.

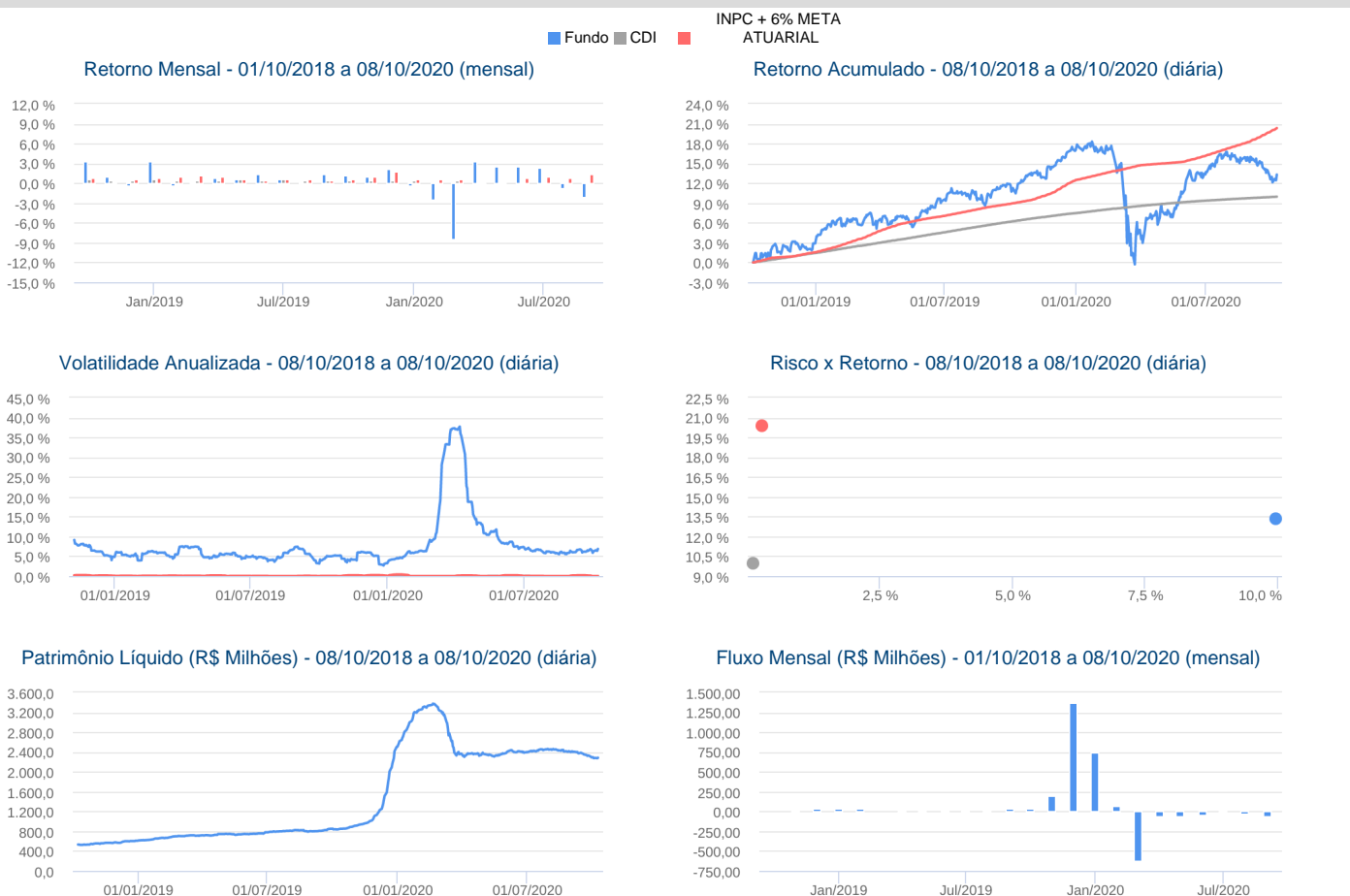
*Recb
06/10/2020*


TIAGO DE VAS RODRIGUES
Gerente de Relacionamento PJ PUBIPRIV
Matr. 138.953-6
Ag. Ipojuca/PE
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

:: CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP

08/10/2020

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	636,94	-3,15	2,56	13,29	20,34	-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	73,15	-135,49	74,05	133,59	117,30	-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	937,22	7,00	10,39	20,34	32,70	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	870,71	2,32	3,46	9,95	17,34	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	Veze Acima do Benchmark						
Fundo	7,5112983	2.282.810,79	2.256.402,17	12,83%	-15,71%	6,09%	-0,14	12,83%	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

08/10/2020

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

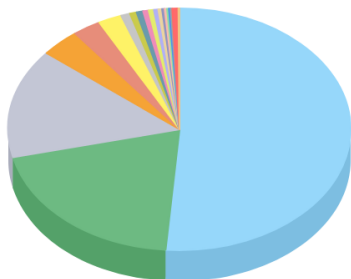
As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas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

08/10/2020

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 %