
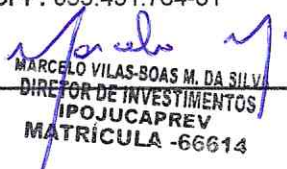






IPOJUCAPREV

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: 242/2020 DATA: 03/12/2020	
VALOR (R\$): 625.000,00	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 25/11/2020. 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 inicio do fundo: 20/06/2000		Taxa de administração: 1,00% Benchmark: CDI Taxa de performance: 20,00% Retorno Mês Anterior: 4,02% Patrimônio líquido no dia de Movimento: 2.258.614.044,03 Valor da cota no dia de Movimento: 7,8086089 Qtde de Cotas: 80.039,864719054	
Proponente: MARCELO VILAS BOAS MARINHEIRO DA SILVA CPF: 055.431.764-81  MARCELO VILAS BOAS M. DA SILVA DIRETOR DE INVESTIMENTOS IPOJUCAPREV MATRÍCULA -66614	Gestor/Autorizador: MARCELO VILAS BOAS MARINHEIRO DA SILVA CPF: 055.431.764-81 Certificação: ANBIMA Validade: 28/01/2022  MARCELO VILAS BOAS M. DA SILVA DIRETOR DE INVESTIMENTOS IPOJUCAPREV MATRÍCULA -66614	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	

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 768/2020

Ipojuca-PE, 01 de Dezembro 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\$ 1.250.000,00 (Um Milhão Duzentos e Cinquenta Mil Reais)

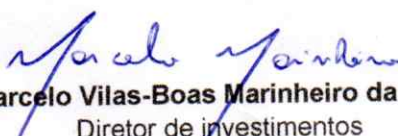
Transferência

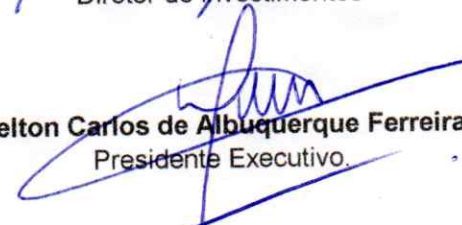
Origem: Conta 20-9
Destino: Conta 22-5
Valor: R\$ 1.250.000,00 (Um Milhão Duzentos e Cinquenta Mil Reais)

Aplicação

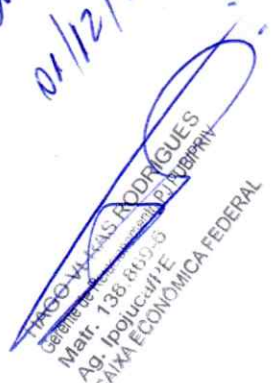
Fundo: CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I
CNPJ 17.502.937/0001-68
Conta vinculada: 22-5
Valor: R\$ 625.000,00 (Seiscentos e Vinte e Cinco Mil Reais)

Fundo: CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP
CNPJ 03.737.188/0001-43
Conta vinculada: 22-5
Valor: R\$ 625.000,00 (Seiscentos e Vinte e Cinco Mil Reais)

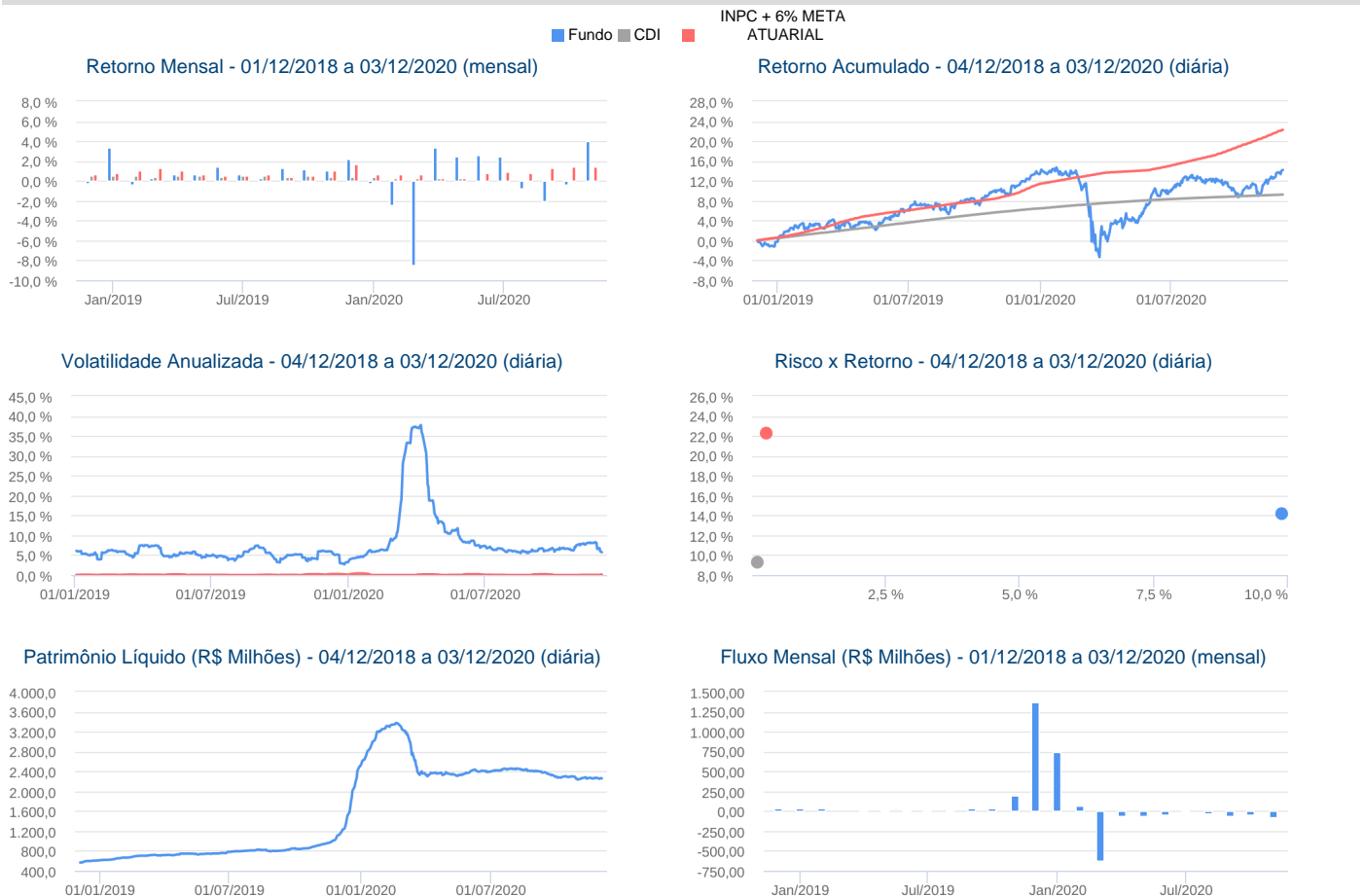

Marcelo Vilas-Boas Marinheiro da Silva
Diretor de investimentos


Helton Carlos de Albuquerque Ferreira
Presidente Executivo.

Recebi em
01/12/2020



Características		Informações Operacionais															
CNPJ: 03.737.188/0001-43		Aplicação Mínima: R\$ 100,00															
Gestão: Caixa Econômica Federal		Aplicação Adicional: R\$ 100,00															
Administrador: Caixa Econômica Federal		Saldo Mínimo: R\$ 50,00															
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	nov/20	out/20	set/20	ago/20	jul/20	jun/20	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19
Fundo	666,11	0,69	2,71	14,18	25,92	4,02	-0,38	-2,05	-0,78	2,44	2,60	2,49	3,40	-8,45	-2,41	-0,25	2,22
% do CDI	76,26	26,36	91,08	153,52	158,38	2.686,88	-239,51	-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
INPC + 6% META ATUARIAL	963,89	9,75	11,54	22,27	34,24	1,42	1,38	1,36	0,85	0,98	0,79	0,21	0,23	0,69	0,59	0,70	1,71
CDI	873,47	2,61	2,98	9,24	16,36	0,15	0,16	0,16	0,16	0,19	0,21	0,24	0,28	0,34	0,29	0,38	0,37
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	7,8086089	2.258.614,04	2.458.768,42	12,93%	-15,71%	6,14%	-13,00	12,94%	4,02%	-8,45%	5						
CDI	-	-	-	0,06%	-	0,03%	1,00	0,00%	0,38%	0,15%	0						

Gráficos

Composição da Carteira

dez/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

03/12/2020

FUNDO	% do PL	Mês		Ano		12 meses		24 meses		06 meses	12 meses
		Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio
Cotas de Fundos (omitidas)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Tipo de Aplicação	dez/20	nov/20	out/20	set/20	ago/20	jul/20	jun/20	mai/20
Títulos Públicos	80,05%	78,95%	81,04%	75,85%	75,41%	76,69%	76,01%	75,52%
Operações Compromissadas	19,06%	20,68%	18,73%	22,78%	24,00%	22,59%	23,01%	23,40%
Cotas de Fundos	0,83%	0,77%	0,66%	0,66%	0,66%	0,66%	0,61%	0,54%
Ações	0,71%	0,68%	0,68%	0,69%	0,76%	0,73%	0,69%	0,64%
Valores a pagar	0,57%	0,76%	0,45%	-0,34%	-0,25%	-0,23%	-0,28%	-0,22%
DIFERENCIAL DE SWAP A RECEBER	0,05%	0,02%	0,02%	0,04%	0,05%	0,06%	0,03%	0,01%
Opções - Posições titulares	0,04%	0,15%	0,05%	0,06%	0,08%	0,10%	0,13%	0,10%
DIFERENCIAL DE SWAP A PAGAR	0,02%	0,02%	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%	-0,00%	-0,00%	-0,02%
Opções - Posições lançadas	-0,06%	-0,15%	-0,02%	-0,02%	-0,07%	-0,07%	-0,06%	-0,04%
Mercado Futuro - Posições compradas	-0,09%	-0,32%	-0,69%	0,30%	-0,62%	-0,50%	-0,12%	0,08%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	2.230.099,21	2.249.784,11	2.234.637,77	2.292.815,96	2.397.521,16	2.446.474,41	2.392.681,00	2.366.607,65
Data da Divulgação	07/01/2021	04/12/2020	06/11/2020	08/10/2020	08/09/2020	06/08/2020	06/07/2020	10/06/2020

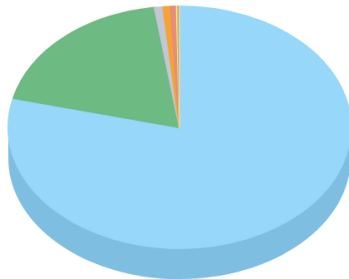
As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas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

03/12/2020

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

dez/2020



Títulos Públicos (omitidos)	80,05 %
Operações Compromissadas	19,06 %
Cotas de Fundos (omitidas)	0,83 %
Ações (omitidas)	0,71 %
Valores a pagar (omitidos)	0,57 %
Mercado Futuro - Posições compradas (omitidas)	-0,09 %
Opções - Posições lançadas (omitidas)	-0,06 %
DIFERENCIAL DE SWAP A RECEBER (omitidos)	0,05 %
Opções - Posições titulares (omitidas)	0,04 %
DIFERENCIAL DE SWAP A PAGAR (omitidos)	0,02 %
Valores a receber (omitidos)	0,00 %
Mercado Futuro - Posições vendidas (omitidas)	0,00 %
Disponibilidades	0,00 %