



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: 254/2020 | DATA: 21/12/2020 |
| VALOR (R\$): 615.000,00 | 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: 2.227.273.408,05 Valor da cota no dia de Movimento: 7,8793567 Qtde de Cotas: 78.052,057219341 | |
| 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

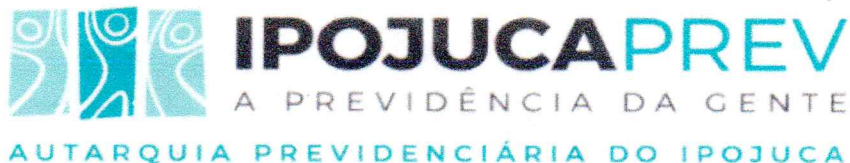
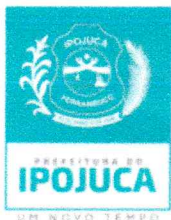
MARCELO VILAS-BOAS M. DA SILVA
DIRETOR DE INVESTIMENTOS
IPOJUCAPREV
MATRÍCULA 66614

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 816/2020

Ipojuca-PE, 18 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\$ 1.230.000,00 (Um Milhão, Duzentos e Trinta Mil Reais)

Transferência


Origem: Conta 20-9
Destino: Conta 22-5
Valor: R\$ 1.230.000,00 (Um Milhão, Duzentos e Trinta Mil Reais)


Aplicação

Fundo: CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I
CNPJ 17.502.937/0001-68
Conta vinculada: 22-5
Valor: R\$ 615.000,00 (Seiscentos e Quinze Mil Reais)

Fundo: CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP
CNPJ 03.737.188/0001-43
Conta vinculada: 22-5
Valor: R\$ 615.000,00 (Seiscentos e Quinze Mil Reais)

*Recebido
18.12.2020*
Emory Carmila Medeiros Chaves
Assistente de Varejo
FONE: 128.122-5
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL


Marcelo Vilas-Boas Marinheiro da Silva
Diretor de investimentos

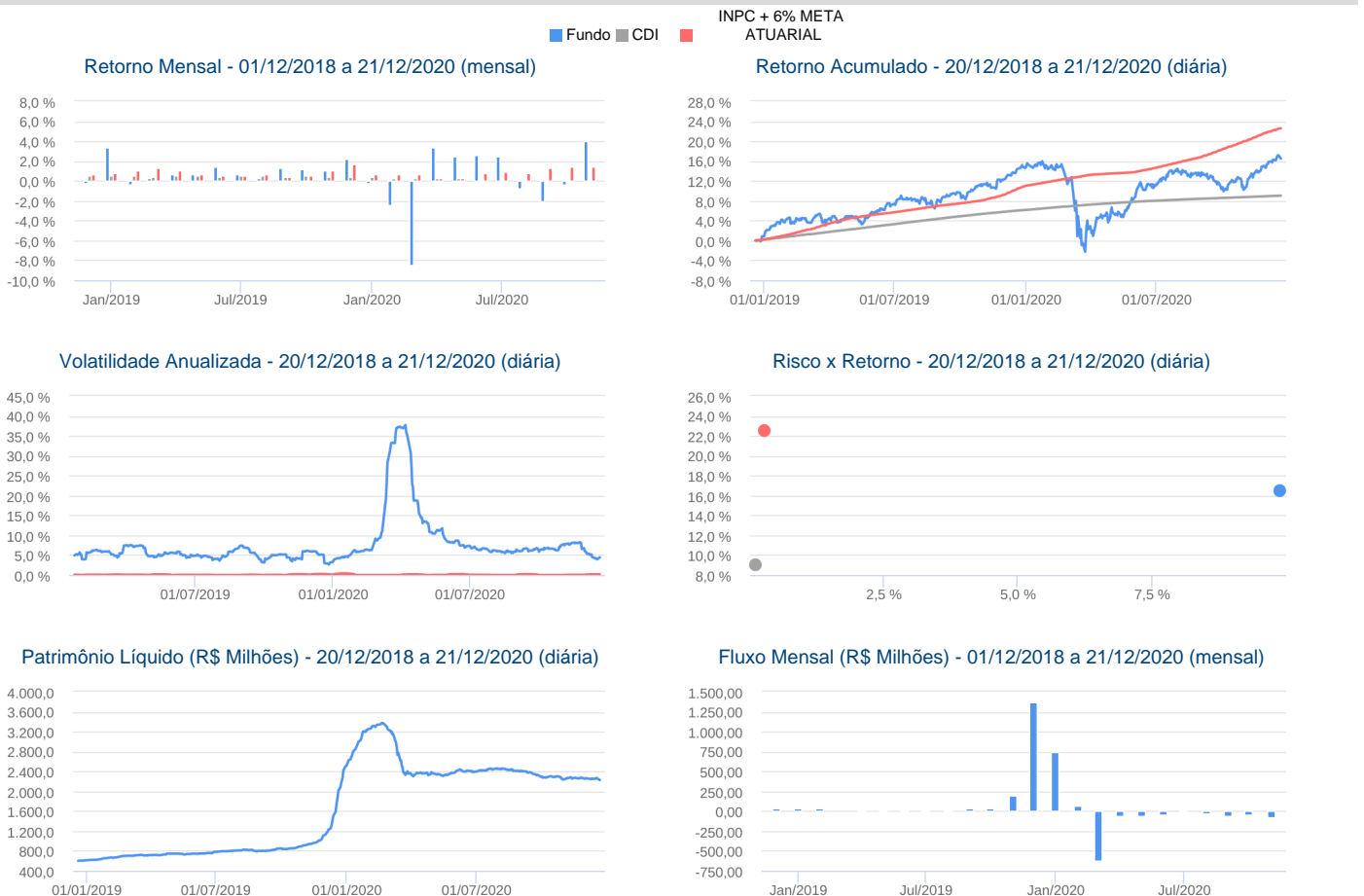

Helton Carlos de Albuquerque Ferreira
Presidente Executivo

| 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 | 673,05 | 1,60 | 2,07 | 16,49 | 26,85 | 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 | 76,98 | 59,20 | 72,65 | 182,99 | 166,87 | 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 | 970,34 | 10,41 | 11,13 | 22,57 | 34,47 | 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 | 874,34 | 2,70 | 2,84 | 9,01 | 16,09 | 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 | Vezes Acima do Benchmark |
|----------------------------|-----------|--------------|--------------------|--------------|--------------|-------|--------|----------------|----------------|----------------|--------------------------|
| Fundo | 7,8793567 | 2.227.273,41 | 2.499.951,36 | 12,95% | -15,71% | 6,15% | -17,69 | 12,95% | 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

21/12/2020

| 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 |

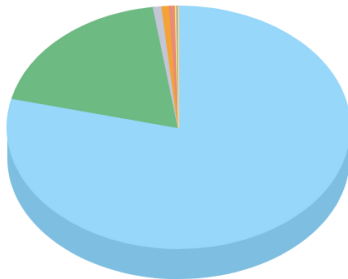
As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas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

21/12/2020

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 % |