



IPOJUCAPREV

A PREVIDÊNCIA DA GENTE

AUTARQUIA PREVIDENCIÁRIA DO IPOJUCA

 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: 001/2021	DATA: 08/01/2021
VALOR (R\$): 5.537.500,00	TIPO DE OPERAÇÃO: Aplicação	Dispositivos de resolução do CMN: 3.922/2010, Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
HISTÓRICO / DESCRIÇÃO DA OPERAÇÃO: Características do Fundo: O fundo aplica seus recursos, principalmente, em cotas do CAIXA MASTER SOBERANO ATIVA FI RENDA FIXA, CNPJ: 10.948.555/0001-13 - Fundo que Aplica seus recursos em carteira composta por títulos públicos federais, expostos diretamente via derivativos, aos riscos de taxas de juros pré e pós-fixadas e/ou índices de preços. Alçada de Deliberação: Autorizada a partir de apresentação de estudo de alocação, realizada na reunião CI Nº 12/2020, no dia 29/12/2020. Justificativa: Aplicação em fundo de gestão ativa em Renda Fixa, no qual o gestor do fundo pode movimentar com muito mais agilidade a carteira de acordo com a sua percepção do cenário.		
CARACTERÍSTICAS DO ATIVO: : : CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA CNPJ: 23.215.097/0001-55		
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+0 Data de inicio do fundo: 04/11/2016	Taxa de administração: 0,20% Benchmark: IPCA Taxa de performance: Não possui Retorno Mês Anterior: 1,32% Patrimônio líquido no dia de Movimento: 14.735.962.672,51 Valor da cota no dia de Movimento: 1,512269 Qtde de Cotas: 3.661.716,268732613	
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 M.
MARCELO VILAS-BOAS M. DA SILVA
DIRETOR DE INVESTIMENTOS
IPOJUCAPREV
MATRICULA - 66614

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

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

Comércio, nº 152 - CEP 55590 - 000
3551-2523; 3551-0981 - CNPJ: 22.236.946/0001-94

<https://ipojucaprev.ipojuca.pe.gov.br/>



Ofício Nº 008/2021

Ipojuca-PE, 08 de Janeiro de 2021

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\$ 11.075.000,00 (Onze Milhões e Setenta e Cinco Mil Reais)

Transferência

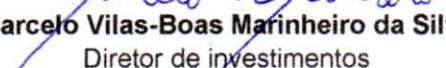
Origem: Conta 20-9
Destino: Conta 22-5
Valor: R\$ 11.075.000,00 (Onze Milhões e Setenta e Cinco Mil Reais)

Aplicação

Fundo: CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA
CNPJ 23.215.097/0001-55
Conta vinculada: 22-5
Valor: R\$ 5.537.500,00 (Cinco Milhões Quinhentos e Trinta e Sete Mil e Quinhentos Reais)

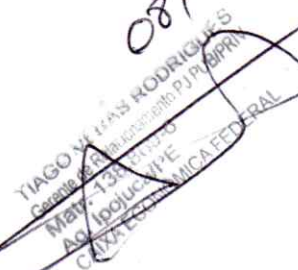
Fundo: CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP
CNPJ 14.508.605/0001-00
Conta vinculada: 22-5
Valor: R\$ 2.768.750,00 (Dois Milhões Setecentos e Sessenta e Oito Mil Setecentos e Cinquenta Reais)

Fundo: CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP
CNPJ 03.737.188/0001-43
Conta vinculada: 22-5
Valor: R\$ 2.768.750,00 (Dois Milhões Setecentos e Sessenta e Oito Mil Setecentos e Cinquenta Reais)

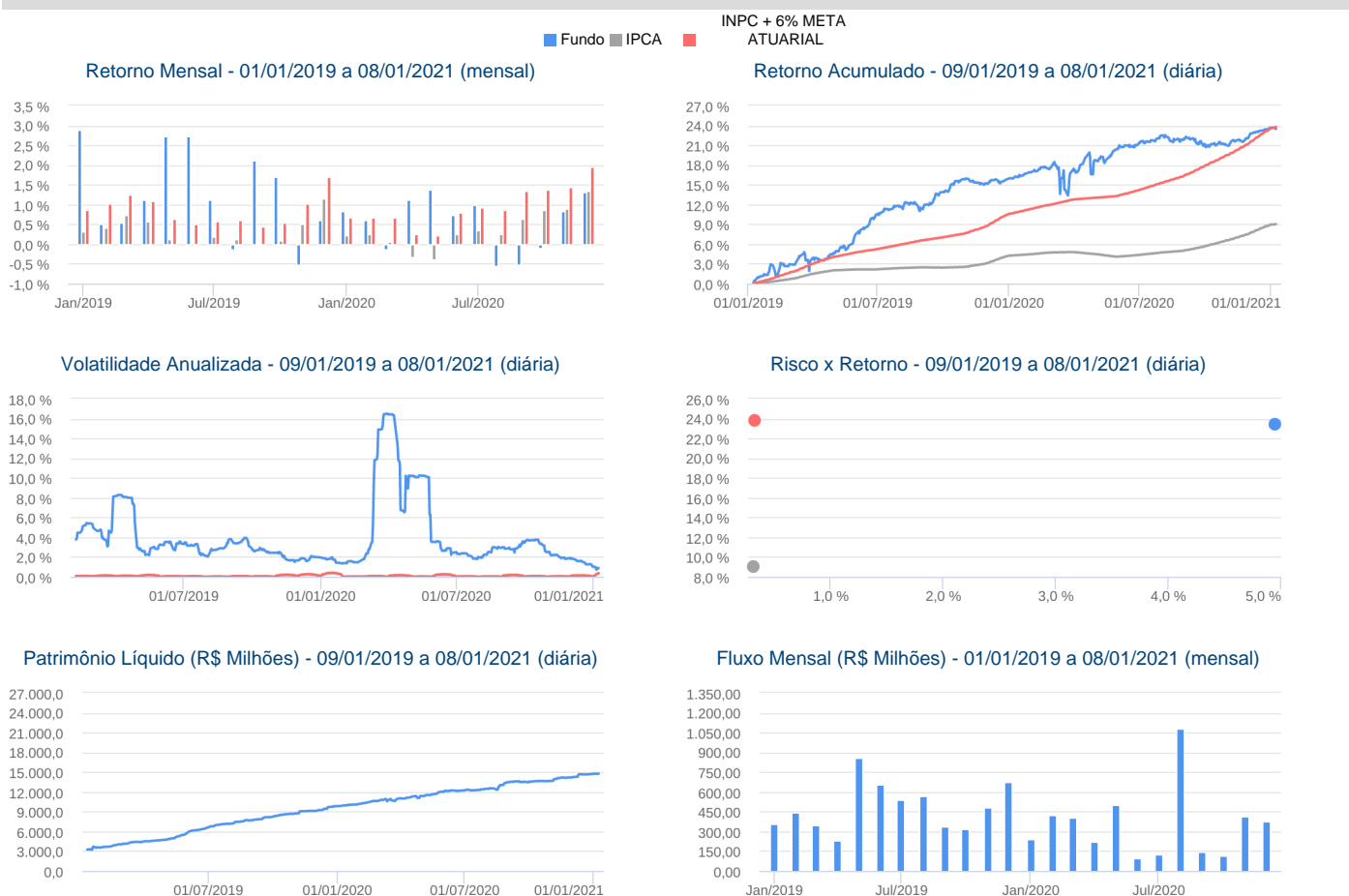

Marcelo Vilas-Boas Marinheiro da Silva
Diretor de investimentos


Helton Carlos de Albuquerque Ferreira
Presidente Executivo

Recebido em
08/01/21


TIAGO WILLIAMS RODRIGUES
Gerente de Investimentos PJ (BIPRI)
Matr. 134.853.000
Av. Ipojuca, nº 152
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Características		Informações Operacionais															
CNPJ: 23.215.097/0001-55		Aplicação Mínima: R\$ 1.000,00															
Gestão: Caixa Econômica Federal		Aplicação Adicional: R\$ 0,00															
Administrador: Caixa Econômica Federal		Saldo Mínimo: R\$ 0,00															
Taxa de Administração: 0,40%		Resgate Mínimo: R\$ 0,00															
Taxa de Administração (Máxima): 0,40%		Conversão da Cota para Aplicação: D+0															
Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Livre Soberano		Conversão da Cota para Resgate: D+0															
Código de Referência: 427683		Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0															
Início do Fundo: 04/11/2016																	
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	dez/20	nov/20	out/20	set/20	ago/20	jul/20	jun/20	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20
Fundo	51,23	-0,14	6,43	23,47	33,26	1,32	0,82	-0,11	-0,50	-0,56	0,98	0,75	1,38	1,11	-0,13	0,62	0,82
% do IPCA	300,70	-221,87	141,52	260,53	253,33	97,83	92,13	-12,54	-78,62	-232,15	271,47	288,31	-362,82	-358,48	-186,68	246,84	390,14
INPC + 6% META ATUARIAL	48,57	0,18	11,81	23,77	35,77	1,98	1,42	1,38	1,36	0,85	0,98	0,79	0,21	0,23	0,69	0,59	0,70
IPCA	17,04	0,06	4,54	9,01	13,13	1,35	0,89	0,86	0,64	0,24	0,36	0,26	-0,38	-0,31	0,07	0,25	0,21
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	1,512269	14.735.962,67	12.351.121,71	5,92%	-4,27%	2,81%	-0,18	5,93%	1,38%	-0,56%	5						
IPCA	-	-	-	0,36%	-0,69%	0,17%	1,00	0,00%	1,35%	-0,38%	0						

Gráficos

Composição da Carteira

jan/2021

Performance dos Fundos em Carteira

Retorno (%) / % do Benchmark - IPCA

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 BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA

08/01/2021

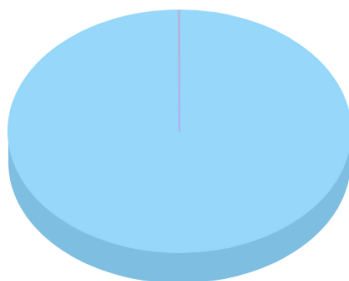
FUNDO	% do PL	Mês		Ano		Desde o início		Desde o início		06 meses	12 meses
		Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio
CAIXA MASTER SOBERANO ATIVA FI RENDA FIXA	100,01	-0,25	-396,32	-0,25	-396,32	115,01	178,67	115,01	178,67	0,55	R\$ 882.743.578,2
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	-0,04	-61,35	-0,04	-61,35	161,20	204,31	161,20	204,31	0,32	R\$ 11.442.004.034,6
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	-0,85	-1.359,11	-0,85	-1.359,11	133,52	227,31	133,52	227,31	3,01	R\$ 13.278.028.025,2
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	-0,14	-220,47	-0,14	-220,47	222,44	282,07	222,44	282,07	2,24	R\$ 12.971.511.584,3

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

Tipo de Aplicação	jan/21	dez/20	nov/20	out/20	set/20	ago/20	jul/20	jun/20
Cotas de Fundos	100,01%	99,73%	99,79%	99,79%	99,79%	99,79%	99,86%	99,90%
Valores a receber	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%
Valores a pagar	-0,01%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%
Operações Compromissadas	-	0,27%	0,22%	0,22%	0,22%	0,22%	0,14%	0,11%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	14.822.912,41	14.722.139,60	14.161.450,97	13.635.004,72	13.535.810,68	13.462.808,03	12.451.209,80	12.211.119,7
Data da Divulgação	03/02/2021	06/01/2021	02/12/2020	05/11/2020	05/10/2020	04/09/2020	04/08/2020	06/07/2020

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

jan/2021



Cotas de CAIXA MASTER SOBERANO ATIVA FI RENDA FIXA	100,01 %
Valores a pagar / Taxa de Administração	-0,01 %
Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,00 %
Valores a pagar / Taxa Cetip	0,00 %
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0,00 %
Valores a receber / Taxa de Fiscalização CVM	0,00 %
Valores a pagar / Taxa Selic	0,00 %
Valores a receber / Ajustes de Quantidades Patrimônio Credor	0,00 %
Cotas de CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00 %
Cotas de CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00 %
Outras Disponibilidades	0,00 %
Cotas de CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00 %