




IPOJUCAPREV

A PREVIDÊNCIA DA GENTE

AUTARQUIA PREVIDENCIÁRIA DO IPOJUCA

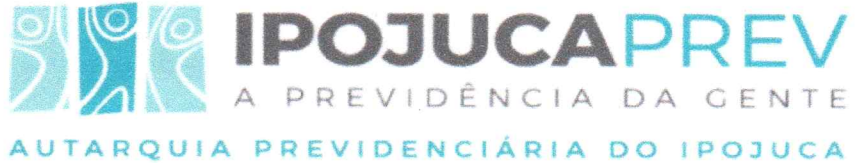
| | | | | | |
|---|--|--|--|---|--|
|  IPOJUCAPREV A PREVIDÊNCIA DA GENTE AUTARQUIA PREVIDENCIÁRIA DO IPOJUCA | | AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO RESGATE – APR ART. 3º-B DA PORTARIA MPS Nº 519/2011, INCLUÍDO PELO ART. 2º DA PORTARIA MPS Nº 170, DE 25/04/2012 | | | |
| AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR Unidade gestora do RPPS: AUTARQUIA PREVIDENCIARIA DO IPOJUCA - IPOJUCAPREV CNPJ: 22.236.946/0001-94 | | Nº / ANO: 007/2021 DATA: 19/01/2021 | | | |
| VALOR (R\$): 1.900.000,00 | | TIPO DE OPERAÇÃO: Resgate | | | |
| | | 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: Resgate Solicitado pela Dir. ADM e Financeira para pagar a folha de aposentados e pensionistas referentes ao mês de Janeiro/2021. | | | | | |
| CARACTERÍSTICAS DO ATIVO: : : CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA CNPJ: 23.215.097/0001-55 | | | | | |
| Administrador: CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | | Taxa de administração: 0,20% | | | |
| CNPJ Administrador: 00.360.305/0001-04 | | Benchmark: IPCA | | | |
| Gestão: CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | | Taxa de performance: Não possui | | | |
| CNPJ Gestão: 00.360.305/0001-04 | | Retorno Mês Anterior: 1,32% | | | |
| Disponibilidade recursos resgatados: D+0 | | Patrimônio líquido no dia de Movimento: 14.781.810.653,03 | | | |
| Data de inicio do fundo: 04/11/2016 | | Valor da cota no dia de Movimento: 1,513859 | | | |
| | | Qtde de Cotas: 1.255.070,650569175 | | | |
| 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
MATRICULA - 66672

MARCELO VILAS BOAS M. DA SILVA
DIRETOR DE INVESTIMENTOS
IPOJUCAPREV
MATRICULA - 66672

Comércio, nº 152 - PE - CEP 55590 - 000
Fone: (81) 3551-2523, MATRICULA - 66672
<https://ipojucaprev.ipojuca.pe.gov.br/>

HELTON CARLOS DE ALBUQUERQUE FERREIRA
Presidente Executivo - IPOJUCAPREV
Matricula : 71917



Ofício Nº 26 /2021

Ipojuca-PE, 19 de Janeiro de 2021

**À Caixa Econômica Federal
Luciano Pereira de Lucena**

Ref. Alocação de Recursos

De acordo com a solicitação da Diretoria Administrativa - Financeira, para pagar a folha dos aposentados e pensionistas referente ao mês de Janeiro de 2021, solicitamos que sejam feitas as seguintes movimentações:

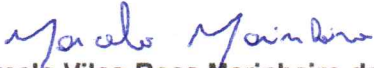
Resgate

Fundo: CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA
CNPJ 10.740.670/0001-06
Conta vinculada: 22-5
Valor: R\$ 1.900.000,00 (Hum Milhão e Novecentos Mil Reais)

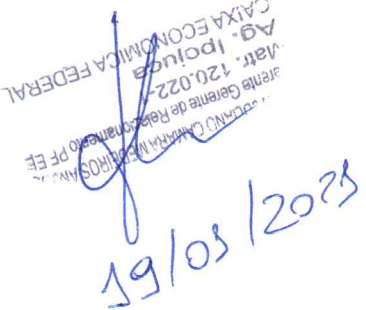
Fundo: CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA
CNPJ 23.215.097/0001-55
Conta vinculada: 22-5
Valor: R\$ 1.900.000,00 (Hum Milhão e Novecentos Mil Reais)

Transferência

Origem: Conta 22-5
Destino: Conta 20-9
Valor: R\$ 3.800.000,00 (Três Milhões e Oitocentos Mil Reais)


Marcelo Vilas-Boas Marinheiro da Silva
Diretor de investimentos

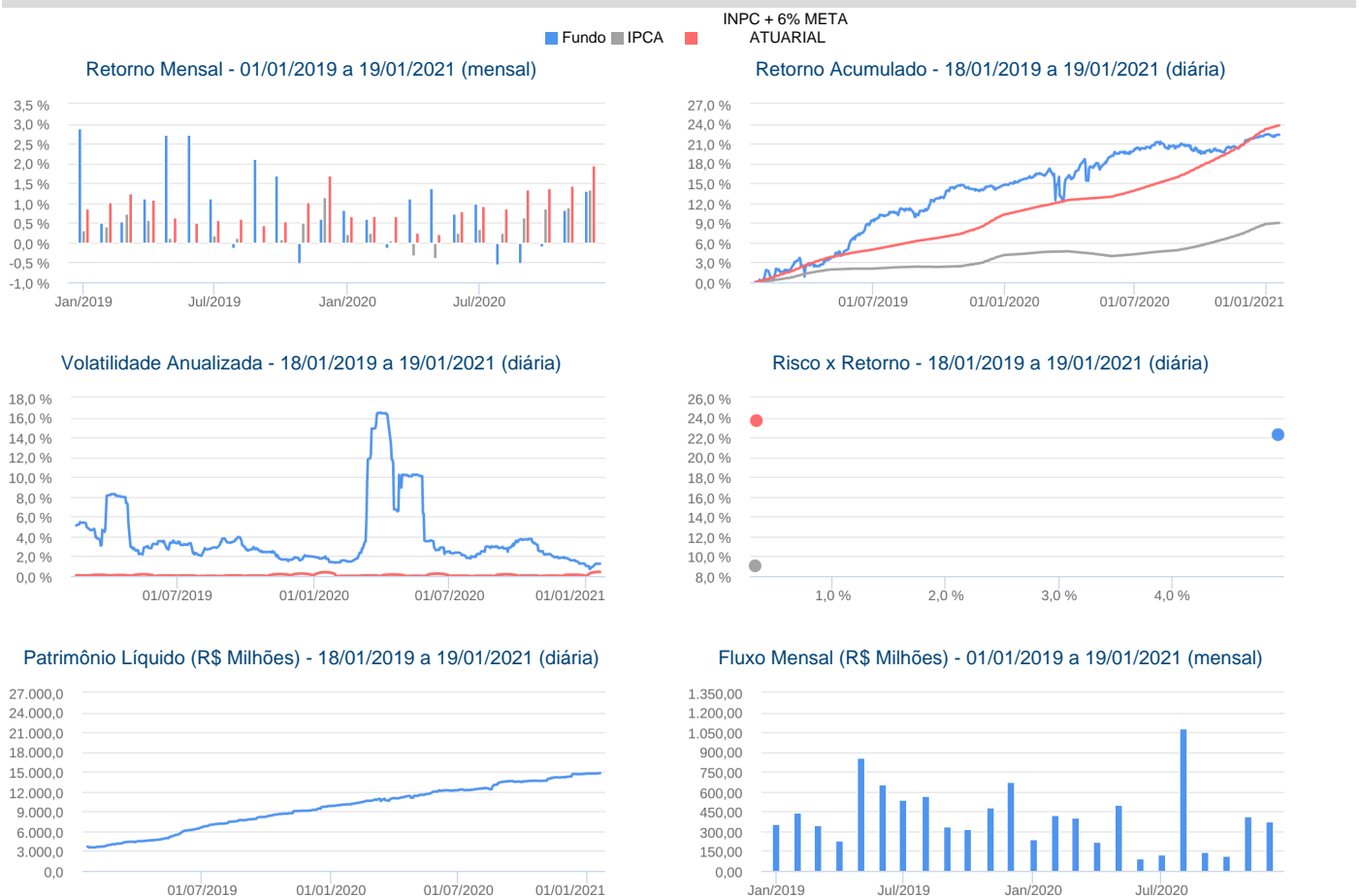

Helton Carlos de Albuquerque Ferreira
Presidente Executivo


CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
Ag. Ipojuca
Matr. 120.022
Gerente de Relacionamento PE/EE

:: CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA

19/01/2021

| 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 | 51,39 | -0,03 | 6,31 | 22,32 | 33,09 | 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 | 299,83 | -22,37 | 138,18 | 248,20 | 252,19 | 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 | 48,95 | 0,44 | 11,85 | 23,75 | 35,80 | 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 | 17,14 | 0,15 | 4,56 | 8,99 | 13,12 | 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 | 1,513859 | 14.781.810,65 | 12.484.812,69 | 5,91% | -4,27% | 2,81% | -0,19 | 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

19/01/2021

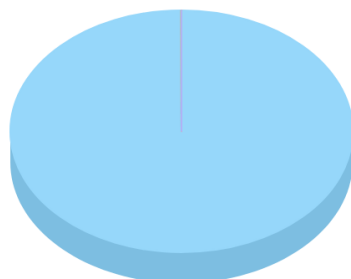
| FUNDO | % do PL | Mês | | Ano | | Desde o início | | Desde o início | | 06 meses | 12 meses |
|--|---------|---------|----------|---------|----------|----------------|----------|----------------|----------|--------------|----------------------|
| | | Nominal | Relativo | Nominal | Relativo | Nominal | Relativo | Nominal | Relativo | Volatilidade | PL Médio |
| CAIXA MASTER SOBERANO ATIVA FI RENDA FIXA | 100,01 | -0,13 | -87,60 | -0,13 | -87,60 | 115,26 | 178,66 | 115,26 | 178,66 | 0,69 | R\$ 1.272.432.622,0 |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,00 | -0,01 | -8,12 | -0,01 | -8,12 | 161,27 | 203,99 | 161,27 | 203,99 | 0,33 | R\$ 11.430.393.975,0 |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,00 | -1,08 | -720,14 | -1,08 | -720,14 | 132,97 | 225,85 | 132,97 | 225,85 | 3,08 | R\$ 12.925.161.792,9 |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,00 | 0,01 | 7,81 | 0,01 | 7,81 | 222,92 | 282,12 | 222,92 | 282,12 | 2,29 | R\$ 13.072.812.850,8 |

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 % |