




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: 004/2021 DATA: 08/01/2021	
VALOR (R\$): 2.768.750,00		TIPO DE OPERAÇÃO: Aplicação	
		Dispositivos de resolução do CMN: 3.922/2010, Artigo 8º, Inciso III	
HISTÓRICO / DESCRIÇÃO DA OPERAÇÃO: Características do Fundo: O fundo aplica seus recursos em carteira diversificada de ativos financeiros, no âmbito do mercado financeiro e de capitais nacional e internacional, não podendo deter mais de 30% em ativos de renda variável. 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: Aumento de exposição em fundo 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: 2,56% Patrimônio líquido no dia de Movimento: 2.260.174.228,21 Valor da cota no dia de Movimento: 8,0676493 Qtde de Cotas: 343.191,665507820	
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
 MARCELO VILAS BOAS M. DA SILVA
 DIRETOR DE INVESTIMENTOS
 IPOJUCAPREV
 MATRICULA 66614

Marcelo Vilas Boas M. da Silva
 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



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

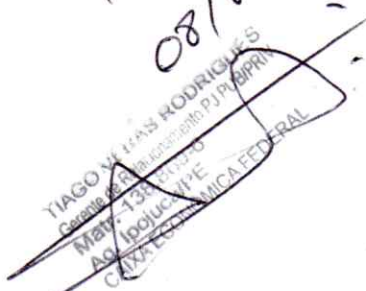
Fundo: CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA
CNPJ 23.215.097/0001-55
Conta vinculada: 22-5
Valor: R\$ 5.537.500,00 (Cinco Milhões Quinhentos e Trinta e Sete Mil e Quinhentos Reais)

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

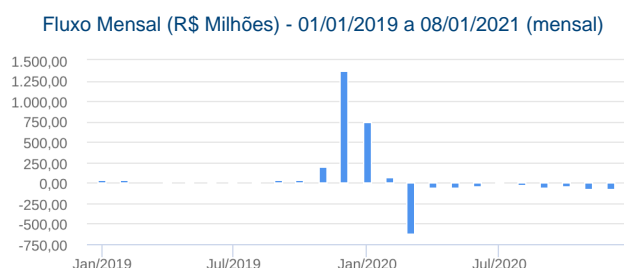
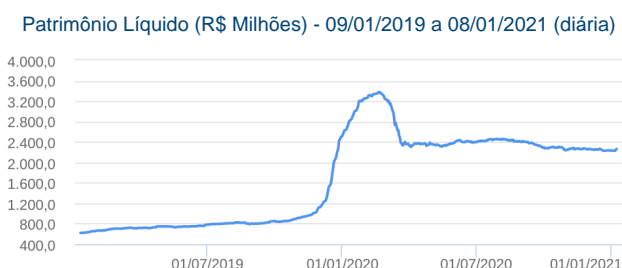
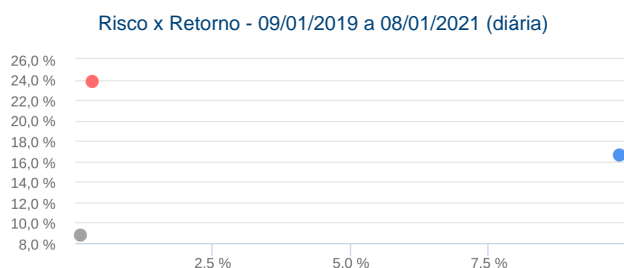

Helton Carlos de Albuquerque Ferreira
Presidente Executivo

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: 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	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	691,52	1,47	3,76	16,60	26,80	2,56	4,02	-0,38	-2,05	-0,78	2,44	2,60	2,49	3,40	-8,45	-2,41	-0,25
% do CDI	79,01	3.934,17	138,07	188,88	169,33	1.557,09	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
INPC + 6% META ATUARIAL	985,28	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
CDI	875,21	0,04	2,73	8,79	15,83	0,16	0,15	0,16	0,16	0,16	0,19	0,21	0,24	0,28	0,34	0,29	0,38

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	8,0676493	2.260.174,23	2.493.801,66	12,95%	-15,71%	6,15%	-19,03	12,96%	4,02%	-8,45%	6
CDI	-	-	-	0,06%	-	0,03%	1,00	0,00%	0,34%	0,15%	0

Gráficos

Composição da Carteira

jan/2021

Performance dos Fundos em Carteira

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

08/01/2021

Fundo	% do PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio
-------	---------	---------	----------	---------	----------	---------	----------	---------	----------	--------------	----------

Não há fundos(FI) na carteira

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

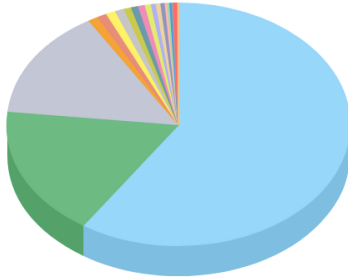
Tipo de Aplicação	jan/21	dez/20	nov/20	out/20	set/20	ago/20	jul/20	jun/20
Títulos Públicos	82,40%	80,05%	78,95%	81,04%	75,85%	75,41%	76,69%	76,01%
Operações Compromissadas	17,42%	19,06%	20,68%	18,73%	22,78%	24,00%	22,59%	23,01%
Ações	1,28%	0,71%	0,68%	0,68%	0,69%	0,76%	0,73%	0,69%
Valores a pagar	0,42%	0,57%	0,76%	-0,45%	-0,34%	-0,25%	-0,23%	-0,28%
Certificado ou recibo de depósito de valores mobiliários	0,15%	-	-	-	-	-	-	-
Opções - Posições titulares	0,03%	0,04%	0,15%	0,05%	0,06%	0,08%	0,10%	0,13%
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%	-0,00%
Opções - Posições lançadas	-0,01%	-0,06%	-0,15%	-0,02%	-0,02%	-0,07%	-0,07%	-0,06%
Mercado Futuro - Posições compradas	-0,86%	-0,09%	-0,32%	-0,69%	0,30%	-0,62%	-0,50%	-0,12%
Cotas de Fundos	-	0,83%	0,77%	0,66%	0,66%	0,66%	0,66%	0,61%
DIFERENCIAL DE SWAP A PAGAR	-	0,02%	0,02%	-0,02%	-0,02%	-0,02%	-0,03%	-0,02%
DIFERENCIAL DE SWAP A RECEBER	-	0,05%	0,02%	0,02%	0,04%	0,05%	0,06%	0,03%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	2.188.049,55	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
Data da Divulgação	03/02/2021	07/01/2021	04/12/2020	06/11/2020	08/10/2020	08/09/2020	06/08/2020	06/07/2020

:: CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP

08/01/2021

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

out/2020



LFT - Venc.: 01/03/2026	60,79 %
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/2027	17,79 %
LFT - Venc.: 01/03/2024	14,90 %
LFT - Venc.: 01/09/2022	0,96 %
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/2021	0,94 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2022	0,92 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	0,90 %
Mercado Futuro - Posições compradas - INDFUTZ20	-0,69 %
LFT - Venc.: 01/09/2024	0,68 %
Cotas de ISHARES BM&FBOVESPA SMALL CAP FUNDO DE ÍNDICE - SMAL11	0,66 %
LFT - Venc.: 01/03/2023	0,59 %
LFT - Venc.: 01/03/2022	0,46 %
Outros Valores a pagar	-0,45 %
LFT - Venc.: 01/03/2021	0,40 %
LFT - Venc.: 01/09/2023	0,26 %
MAGAZ LUIZA ON NM - MGLU3	0,20 %
LFT - Venc.: 01/09/2021	0,19 %
VIAVAREJO ON N2 - VVAR3	0,17 %
Lançamentos positivos menores que 0,17%	0,39 %
Lançamentos negativos maiores que -0,45%	-0,04 %