

		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: 238/2021 DATA: 03/11/2021	
VALOR (R\$): 6.800.000,00	TIPO DE OPERAÇÃO: Resgate	Dispositivos de resolução do CMN: 3.922/2010, Artigo 8º, Inciso III	
HISTÓRICO / DESCRIÇÃO DA OPERAÇÃO: Características do Fundo: O fundo aplica seus recursos nos mercados de renda fixa e renda variável, sem o compromisso de concentração em nenhum ativo ou fator de risco em especial. No mercado de renda variável, realizará operações de derivativos envolvendo contratos futuros de S&P500. Alçada de Deliberação: Autorizada a partir de apresentação de estudo de alocação, realizada na reunião do C.I. Nº 10/2021, no dia 25/10/2021. Justificativa: Resgate de fundo de investimentos no exterior visando a realização dos resultados positivos da estratégia, além de diminuir a exposição direta ao S&P 500 com hedge cambial.			
CARACTERÍSTICAS DO ATIVO: :: CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP CNPJ: 30.036.235/0001-02			
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+1 Data de início do fundo: 16/10/2018		Taxa de administração: 1,20% Benchmark: NÃO INFORMADO Taxa de performance: Não possui Retorno Mês Anterior: 7,64% Patrimônio líquido no dia de Movimento: 3.525.522.908,69 Valor da cota no dia de Movimento: 1,701065 Qtde de Cotas: 3.997.495,686525794	
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: 29/09/2023	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			

Ofício nº804/2021 - IPOJUCAPREV

Ipojuca, 03 de novembro de 2021

À Caixa Econômica Federal
Sr. 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, referendada e aceita também pelos membros do Conselho Deliberativo e do Conselho Fiscal, solicitamos que sejam feitas as seguintes movimentações

Tipo movimentação: Resgate

Fundo: CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP
CNPJ: 30.036.235/0001-02
Conta Vinculada: 22-5
Valor: R\$ 6.800.000,00 (Seis Milhões e Oito Centos Mil Reais)

Tipo movimentação: Transferência


Conta Origem:

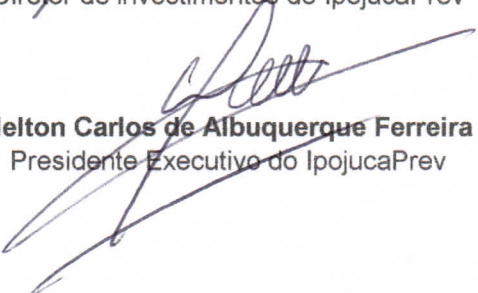
Banco: Caixa Econômica Federal
Agência 3014
C/C: 22-5

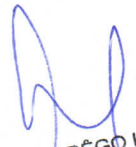
Valor: R\$ 6.800.000,00 (Seis Milhões e Oito Centos Mil Reais)

Conta Destino:

Banco: Caixa Econômica Federal
Agência 3014
C/C: 20-9


Marcelo Vilas-Boas Marinheiro da Silva
Diretor de investimentos do IpojucaPrev


Helton Carlos de Albuquerque Ferreira
Presidente Executivo do IpojucaPrev

03/11/2021

LAÚRCIANA DO RÉGIO LINS
Gerente de Carteira PJ
Matr. 090072-6
Ag. Ipojuca/PE
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

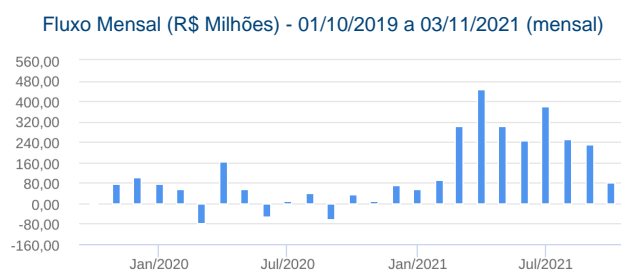
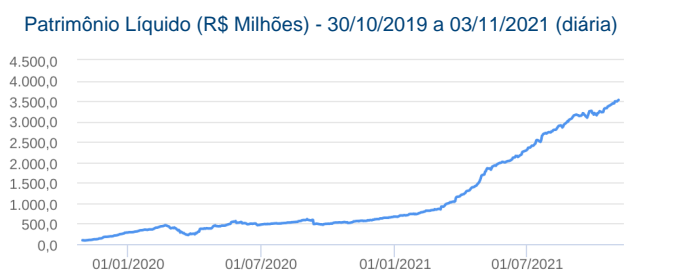
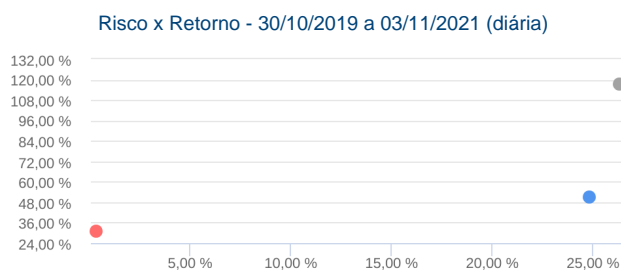
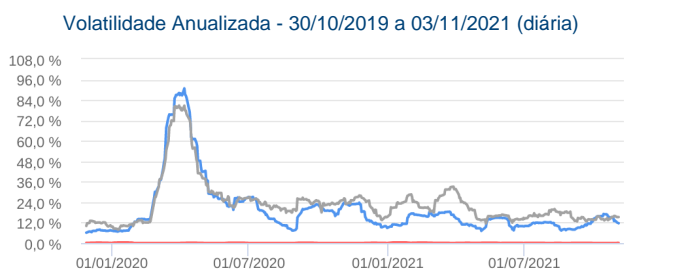
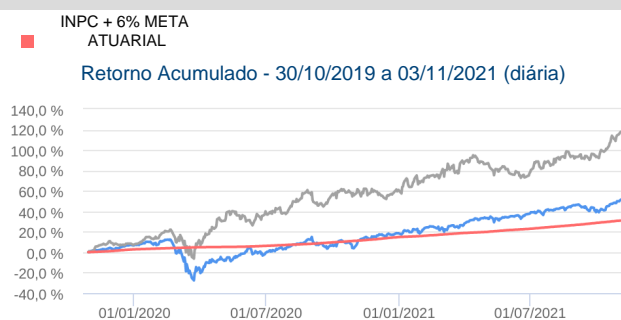
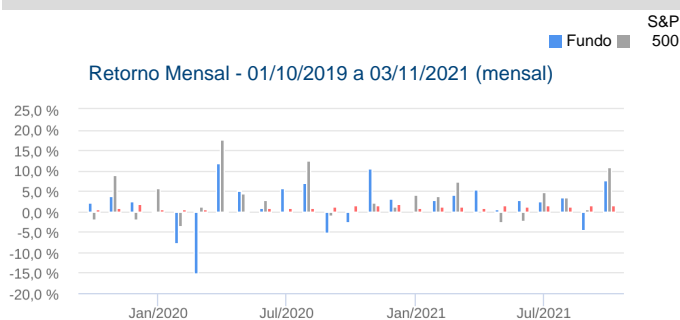
:: CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP

03/11/2021

Características	Informações Operacionais
CNPJ: 30.036.235/0001-02	Aplicação Mínima: R\$ 100,00
Gestão: Caixa DTVM	Aplicação Adicional: R\$ 100,00
Administrador: Caixa Econômica Federal	Saldo Mínimo: R\$ 50,00
Taxa de Administração: 0,80%	Resgate Mínimo: R\$ 100,00
Taxa de Administração (Máxima): Não possui	Conversão da Cota para Aplicação: D+0
Classificação Anbima: Multimercados Livre	Conversão da Cota para Resgate: D+0
Código de Referência: 476692	Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+1 du
Início do Fundo: 16/10/2018	

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21	fev/21	jan/21	dez/20	nov/20
Fundo	70,11	27,69	45,74	51,31	79,89	7,64	-4,64	3,34	2,63	2,71	0,48	5,38	4,05	2,70	-0,05	3,14	10,66
% do S&P 500	45,67	78,39	114,50	43,58	45,66	70,01	-638,68	100,11	55,73	-119,48	-18,20	-2.941,99	54,75	74,34	-1,26	289,27	461,64
INPC + 6% META ATUARIAL	42,85	13,94	17,84	30,88	42,32	1,63	1,69	1,39	1,54	1,09	1,45	0,85	1,40	1,24	0,73	1,98	1,42
S&P 500	153,50	35,32	39,94	117,72	174,97	10,92	0,73	3,34	4,72	-2,27	-2,64	-0,18	7,39	3,63	4,20	1,09	2,31

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	1,701065	3.525.522,91	1.782.496,43	13,17%	-5,16%	6,25%	0,34	16,58%	10,66%	-4,64%	6
S&P 500	-	-	-	19,62%	-11,30%	9,32%	1,00	0,00%	10,92%	-2,64%	0

Gráficos

Composição da Carteira

nov/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 INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP

03/11/2021

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

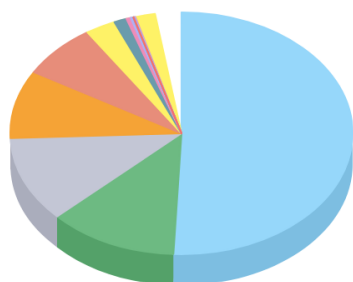
Não há fundos(FI) na carteira

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

Tipo de Aplicação	nov/21	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21
Operações Compromissadas	52,09%	54,07%	52,66%	50,57%	44,66%	51,93%	45,94%	42,05%
Títulos Públicos	50,54%	44,89%	48,83%	49,50%	55,43%	48,00%	55,01%	58,50%
Disponibilidades	0,01%	0,00%	0,01%	0,02%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a receber	0,00%	1,11%	-	0,00%	0,00%	0,12%	0,00%	0,00%
Mercado Futuro - Posições compradas	-2,01%	1,11%	-1,33%	-0,04%	-0,03%	0,12%	-0,27%	-0,47%
Valores a pagar	-2,63%	-0,07%	-1,50%	-0,09%	-0,09%	-0,05%	-0,94%	-0,55%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	3.554.282,11	3.490.527,60	3.166.279,76	3.077.448,00	2.736.512,00	2.298.502,55	1.997.517,42	1.686.612,03
Data da Divulgação	07/12/2021	04/11/2021	05/10/2021	03/09/2021	04/08/2021	02/07/2021	04/06/2021	05/05/2021

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

nov/2021



Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/10/2022	52,09 %
LFT - Venc.: 01/03/2026	12,51 %
LFT - Venc.: 01/09/2027	11,73 %
LFT - Venc.: 01/09/2026	9,32 %
LFT - Venc.: 01/03/2027	7,48 %
LFT - Venc.: 01/03/2025	6,97 %
Valores a pagar / Liquidação - Nota de Corretagem	-2,01 %
Mercado Futuro - Posições compradas - ISPFUTZ21	-2,01 %
LFT - Venc.: 01/09/2024	1,22 %
LFT - Venc.: 01/09/2025	0,88 %
Valores a pagar / IR	-0,45 %
LFT - Venc.: 01/03/2024	0,39 %
Outros Valores a pagar	-0,15 %
LFT - Venc.: 01/09/2023	0,04 %
Valores a pagar / Imposto de Renda	-0,02 %
Outras Disponibilidades	0,01 %
Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00 %
Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,00 %
Lançamentos positivos menores que 0,00%	0,00 %