



AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO RESGATE - APR
ART. 116 DA PORTARIA MTP 1.467/2022

AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR

Unidade gestora do RPPS: AUTARQUIA PREVIDENCIÁRIA DO IPOJUCA

CNPJ: 05.364.629/0001-34

Nº / ANO: 016/2023

DATA: 13/01/2023

VALOR (R\$): 16.528.906,32 **TIPO DE OPERAÇÃO:** Resgate

Dispositivos de resolução do CMN:
4.963, Artigo 10º, Inciso I

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 12/2022, NO DIA 27/12/2022. JUSTIFICATIVA: RESGATE DE FUNDO MULTIMERCADO COM EXPOSIÇÃO DE ATÉ 30% EM RENDA VARIÁVEL, VISANDO APLICAÇÃO EM FUNDO MULTIMERCADO QUE MANTÉM ESTRATÉGIA MAIS CONSERVADORA, CONFORME APR 017/2023.

CARACTERÍSTICAS DO ATIVO

CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP

CNPJ: 03.737.188/0001-43

Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL

CNPJ Administrador: 00.360.305/0001-04

Gestão: CAIXA DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.

Disponibilidade recursos resgatados: D+3

Valor da cota no dia de Movimento: 8,9042

Data de início do fundo: 20/06/2000

Taxa de administração: 1,00%

Benchmark: 125% do CDI

Taxa de performance: 0

CNPJ Gestão: 42.040.639/0001-40

Patrimônio líquido no dia de Movimento: R\$ 737.751.391,36

Qtde de Cotas: 82.854.306,59589

Representante Legal:

HELTON CARLOS DE ALBUQUERQUE FERREIRA

CPF: ***.019.444-**

Ass:

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

Proponente/Gestor:

MARCELO VILAS BOAS MARINHEIRO DA SILVA

CPF: ***.431.764-**

Certificação: ANBIMA - CEA

Validade: 29/09/2023

Ass:

MARCELO VILAS BOAS M. DA SILVA
Presidente Executivo - IPOJUCAPREV
Matrícula : 71917

Liquidante:

HELTON CARLOS DE ALBUQUERQUE FERREIRA

CPF: ***.019.444-**

Ass:

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

Ofício nº 20/2023 - IPOJUCAPREV

Ipojuca, 11 de Janeiro de 2023

À Caixa Econômica Federal
Sr. Luciano Pereira de Lucena

CÓPIA

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 RV 30 FI MULTIMERCADO LP**

CNPJ: 03.737.188/0001-43

Conta Vinculada: 22-5

Valor: Resgate Total


Tipo movimentação: Aplicação

Fundo: **CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP**

CNPJ: 14.120.520/0001-42

Conta Vinculada: 22-5

Valor: Valor Total Proveniente do Resgate


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

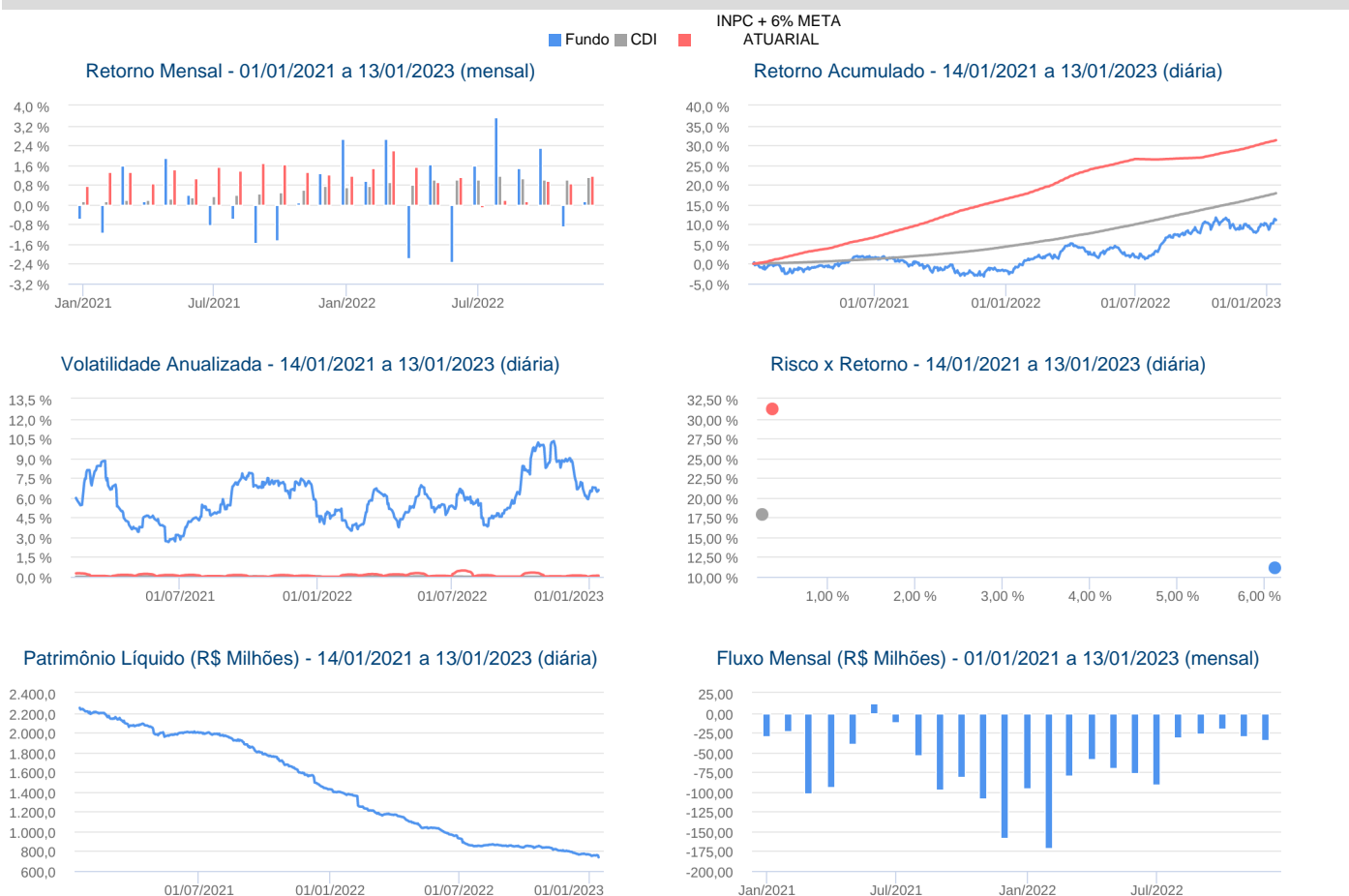

Helton Carlos de Albuquerque Ferreira
Presidente Executivo do IpojucaPrev

11/01/2023
23

LAURA ANA DO REGO LINS
Gerente de Carteira PJ
Matr. 090072-6
Ag. IpojucaPE
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Características																	Informações Operacionais																
CNPJ: 03.737.188/0001-43																	Aplicação Mínima: R\$ 0,00																
Gestão: CAIXA Asset																	Aplicação Adicional: R\$ 0,00																
Administrador: Caixa Econômica Federal																	Saldo Mínimo: R\$ 0,00																
Taxa de Administração: 1,00%																	Resgate Mínimo: R\$ 0,00																
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 (%)	Dia	Dia	Dia	24 meses	36 meses	dez/22	nov/22	out/22	set/22	ago/22	jul/22	jun/22	mai/22	abr/22	mar/22	fev/22	jan/22																
Fundo	-0,18	-0,18	-0,18	11,05	14,86	0,14	-0,87	2,29	1,48	3,55	1,57	-2,31	1,63	-2,17	2,67	0,96	2,67																
% do CDI	-357,96	-357,96	-357,96	61,94	70,67	12,29	-85,14	224,67	137,74	303,98	151,86	-228,10	158,50	-260,68	289,28	128,21	364,84																
INPC + 6% META ATUARIAL	0,04	0,04	0,04	31,25	46,77	1,20	0,85	0,94	0,17	0,22	-0,12	1,11	0,96	1,48	2,23	1,44	1,16																
CDI	0,05	0,05	0,05	17,84	21,03	1,12	1,02	1,02	1,07	1,17	1,03	1,01	1,03	0,83	0,92	0,75	0,73																
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	8,9042009	737.751,39	974.123,13	6,39%	-3,75%	3,03%	4,25	6,39%	3,55%	-2,31%	8																						
CDI	-	-	-	0,08%	-	0,04%	1,00	0,00%	1,17%	0,73%	0																						

Gráficos



Composição da Carteira

jan/2023

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

13/01/2023

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/23	dez/22	nov/22	out/22	set/22	ago/22	jul/22	jun/22
Títulos Públicos	81,18%	88,34%	83,65%	79,15%	78,15%	78,73%	86,43%	91,63%
Operações Compromissadas	18,62%	12,11%	17,00%	20,88%	21,70%	21,74%	12,06%	9,37%
Mercado Futuro - Posições compradas	0,31%	0,00%	0,32%	0,36%	0,64%	-0,14%	0,17%	-0,25%
DIFERENCIAL DE SWAP A RECEBER	0,29%	0,08%	-	-	-	-	-	-
Disponibilidades	0,09%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Opções - Posições titulares	0,03%	-	0,08%	0,23%	0,25%	0,23%	0,02%	0,01%
Valores a receber	0,00%	0,01%	0,00%	0,00%	0,03%	0,00%	0,00%	0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	-0,01%	0,00%	0,00%	-0,01%	0,00%	0,02%	-0,03%	-0,14%
Opções - Posições lançadas	-0,11%	-	-0,04%	-0,18%	-0,24%	-0,29%	-0,04%	-0,01%
DIFERENCIAL DE SWAP A PAGAR	-0,20%	-	-	-	-	-	-	-
Valores a pagar	-0,21%	-0,54%	-0,98%	-0,42%	-0,53%	-0,30%	-0,54%	-2,33%
Ações	-	-	-	-	-	-	1,39%	1,23%
Certificado ou recibo de depósito de valores mobiliários	-	-	-	-	-	-	0,54%	0,49%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	718.828,42	767.161,48	801.068,74	838.070,97	839.545,44	853.306,19	853.918,06	930.017,23
Data da Divulgação	07/02/2023	03/01/2023	02/12/2022	08/11/2022	05/10/2022	08/09/2022	02/08/2022	06/07/2022

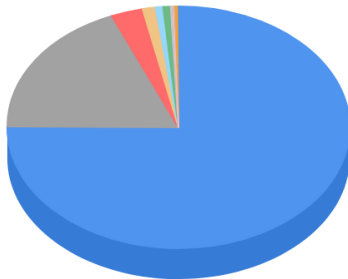
As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas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

13/01/2023

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

jan/2023



LFT - Venc: 01/03/2026	75,51 %
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/01/2025	18,62 %
LFT - Venc.: 01/09/2023	3,02 %
LFT - Venc: 01/09/2027	1,23 %
LFT - Venc: 01/09/2024	0,71 %
LFT - Venc.: 01/03/2025	0,71 %
Mercado Futuro - Posições compradas / FUT IND/G23	0,31 %
DIFERENCIAL DE SWAP A RECEBER - 999 X 999	0,29 %
Outros Valores a pagar	-0,21 %
DIFERENCIAL DE SWAP A PAGAR - 999 X 999	-0,20 %
Outras Disponibilidades	0,09 %
Opções - Posições lançadas / OPF ISP/HRIN	-0,08 %
Opções - Posições titulares / OPF ISP/HRMK	0,02 %
Opções - Posições lançadas - IBOVL135	-0,02 %
Mercado Futuro - Posições vendidas / FUT SEK/K23	-0,01 %
Opções - Posições titulares - IBOVX104	0,01 %
Opções - Posições lançadas / OPF ISP/HRMF	-0,01 %
Opções - Posições lançadas - IBOVL127	-0,01 %
Lançamentos positivos menores que 0,01%	0,02 %
Lançamentos negativos maiores que -0,01%	0,00 %