



**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:** 017/2023

**DATA:** 17/01/2023

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

**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 MERCADO DE TAXAS DE JUROS PREFIXADAS E PÓS-FIXADAS, NO MERCADO DE CÂMBIO E DE INDEXADORES DE PREÇOS. **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:** APLICAÇÃO EM FUNDO MULTIMERCADO MAIS CONSERVADOR, POIS MANTÉM MAIOR PARTE DOS INVESTIMENTOS EM TÍTULOS PÚBLICOS E TAMBÉM TEM UM ORÇAMENTO DE RISCO PEQUENO PARA INVESTIR NO MERCADO DE MOEDAS, VISANDO RETORNO SUPERIOR AO CDI.

**CARACTERÍSTICAS DO ATIVO**

CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP

**CNPJ:** 14.120.520/0001-42

**Administrador:** CAIXA ECONOMICA FEDERAL

**CNPJ Administrador:** 00.360.305/0001-04

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

**CNPJ Gestão:** 42.040.639/0001-40

**Disponibilidade recursos resgatados:** D+0

**Data de inicio do fundo:** 28/06/2012

**Taxa de administração:** 0,70%

**Benchmark:** 125% do CDI

**Taxa de performance:** 20% do que excede 100% do CDI

**Patrimônio líquido no dia de Movimento:** R\$ 1.605.011.672,38

**Valor da cota no dia de Movimento:** 2,50518

**Qtde de Cotas:** 640.676.418,60096

**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 MARINHEIRO 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

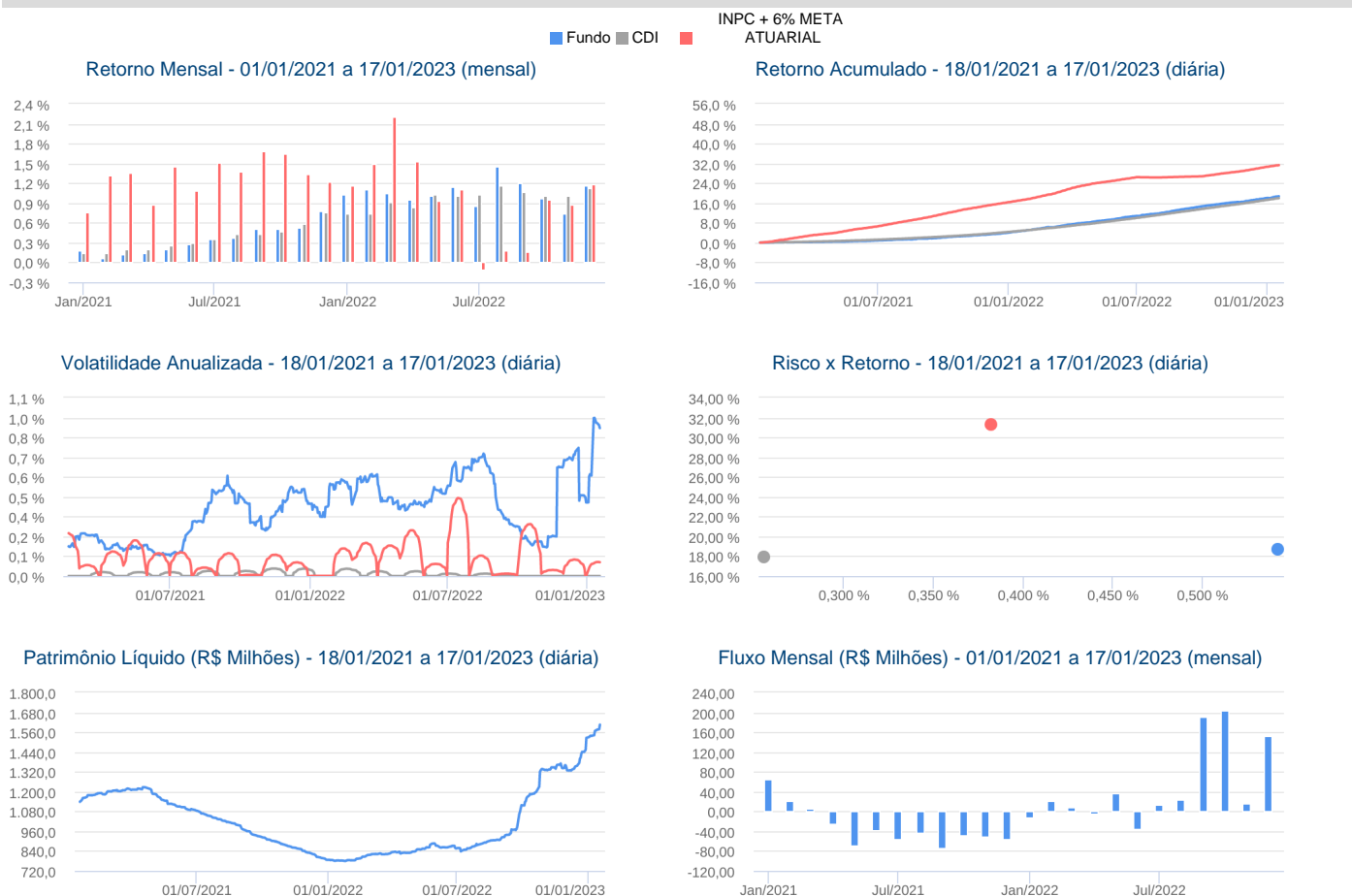
**:: CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP**

17/01/2023

Características	Informações Operacionais
CNPJ: 14.120.520/0001-42	Aplicação Mínima: R\$ 10.000,00
Gestão: CAIXA Asset	Aplicação Adicional: R\$ 100,00
Administrador: Caixa Econômica Federal	Saldo Mínimo: R\$ 1.000,00
Taxa de Administração: 0,70%	Resgate Mínimo: R\$ 100,00
Taxa de Administração (Máxima): 0,70%	Conversão da Cota para Aplicação: D+0
Classificação Anbima: Multimercados Juros e Moedas	Conversão da Cota para Resgate: D+0
Código de Referência: 307122	Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0
Início do Fundo: 28/06/2012	

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	0,05	0,05	0,05	18,69	22,44	1,16	0,74	0,97	1,20	1,45	0,86	1,14	1,02	0,96	1,05	1,11	1,03
% do CDI	98,29	98,29	98,29	104,16	106,31	103,65	72,61	95,23	111,67	123,80	83,02	112,41	98,83	115,01	114,10	147,54	140,70
INPC + 6% META ATUARIAL	0,04	0,04	0,04	31,27	46,81	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	17,94	21,11	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	2,505183	1.605.011,67	1.006.896,64	0,56%	-0,13%	0,27%	0,75	0,57%	1,45%	0,74%	8
CDI	-	-	-	0,07%	-	0,03%	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 JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP**

17/01/2023

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)

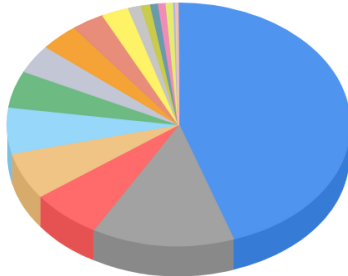
Tipo de Aplicação	jan/23	dez/22	nov/22	out/22	set/22	ago/22	jul/22	jun/22
Operações Compromissadas	44,84%	32,49%	27,77%	43,96%	50,67%	43,05%	28,70%	31,03%
Títulos Públicos	37,71%	48,81%	55,90%	38,04%	30,11%	32,80%	45,08%	41,15%
Depósitos a prazo e outros títulos de IF	17,53%	18,82%	17,01%	18,10%	19,32%	24,24%	26,29%	27,94%
Mercado Futuro - Posições compradas	0,00%	0,00%	0,00%	0,03%	0,02%	0,01%	0,00%	0,00%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,02%	0,01%	0,02%	0,00%	0,03%	0,01%
Mercado Futuro - Posições vendidas	-0,02%	0,00%	-0,04%	-0,05%	-0,04%	-0,02%	-0,03%	-0,07%
Valores a pagar	-0,08%	-0,07%	-0,55%	-0,12%	-0,12%	-0,09%	-0,09%	-0,13%
DIFERENCIAL DE SWAP A PAGAR	-	-0,07%	-0,15%	-	-	-	-	-
DIFERENCIAL DE SWAP A RECEBER	-	0,03%	-	-	-	-	-	-
Valores a receber	-	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	1.658.091,41	1.526.300,68	1.358.976,40	1.332.530,94	1.116.431,65	913.914,27	876.108,53	856.062,12
Data da Divulgação	07/02/2023	06/01/2023	08/12/2022	04/11/2022	07/10/2022	06/09/2022	08/08/2022	05/07/2022

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

17/01/2023

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

jan/2023



Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/01/2024	44,84 %
LFT - Venc: 01/09/2027	13,45 %
CDB/ RDB - CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF (00.360.305/0001-04) - Ven...	6,67 %
LTN - Venc: 01/04/2024	6,27 %
LFT - Venc: 01/03/2026	6,14 %
LTN - Venc: 01/01/2026	4,91 %
LFT - Venc: 01/03/2027	3,82 %
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12) - Ven...	3,61 %
LFT - Venc: 01/03/2029	3,11 %
Letra Financeira - BANCO VOTORANTIM S.A. (59.588.111/0001-03) - V...	2,55 %
DPGE - BANCO MERCANTIL BRASIL S.A. (17.184.037/0001-10) - Venc.: ...	1,23 %
Letra Financeira - BANCO DAYCOVAL S.A. (62.232.889/0001-90) - Ven...	0,88 %
Letra Financeira - BANCO ABC BRASIL S.A. (28.195.667/0001-06) - V...	0,73 %
DPGE - BES INVESTIMENTO DO BRASIL S.A. - BANCO DE	0,73 %
INVESTIMENTO (3...	
Letra Financeira - BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A. (90.400.888/0001...	0,72 %
Letra Financeira - ITAÚ UNIBANCO HOLDING S.A. (60.872.504/0001-23...	0,19 %
Letra Financeira - CAIXA ECONOMICA FEDERAL (00.360.305/0001-04) - ...	0,16 %
Outros Valores a pagar	-0,08 %
Lançamentos positivos menores que 0,16%	0,06 %
Lançamentos negativos maiores que -0,08%	-0,02 %