

**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:** 005/2024**CC:** 22-5**DATA:** 18/01/2024**VALOR (R\$):** 2.500.000,00 **TIPO DE OPERAÇÃO:** Aplicação**Dispositivos de resolução do CMN:** 4.963, Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "**HISTÓRICO / DESCRIÇÃO DA OPERAÇÃO**

CARACTERÍSTICAS DO FUNDO: APLICA SEUS RECURSOS EM CARTEIRA COMPOSTA POR TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS, INDEXADOS A TAXAS PRÉ-FIXADAS E PÓS-FIXADAS (SELIC/CDI). FUNDO PASSIVO QUE BUSCA ACOMPANHAR A VARIAÇÃO DO IRF-M. ALÇADA DE DELIBERAÇÃO: AUTORIZADA A PARTIR DE APRESENTAÇÃO DE ESTUDO DE ALOCAÇÃO, REALIZADA NA REUNIÃO ORDINÁRIA CI Nº 12/2023, NO DIA 28/12/2023. JUSTIFICATIVA: APLICAÇÃO EM FUNDO IRF-M VISANDO SE BENEFICIAR DO FECHAMENTO DA CURVA DE JUROS FUTUROS.

CARACTERÍSTICAS DO ATIVO

CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF

CNPJ: 14.508.605/0001-00**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+0**Valor da cota no dia de Movimento:** 2,91575**Data de inicio do fundo:** 16/08/2012**Taxa de administração:** 0,20%**Benchmark:** IRF-M**Taxa de performance:** 0**CNPJ Gestão:** 42.040.639/0001-40**Patrimônio líquido no dia de Movimento:** R\$ 2.374.266.030,49**Qtde de Cotas:** 814.289.987,30687**Representante Legal:**

HELTON CARLOS DE ALBUQUERQUE FERREIRA

CPF: ***.019.444-**

Ass:

Helton Carlos de Albuquerque Ferreira
Presidente Executivo
IpojucaPREV
Matricula: 71917**Proponente/Gestor:**

MARCELO VILAS BOAS MARINHEIRO DA SILVA

CPF: ***.431.764-****Certificação:** TOTUM - TOTUM GESTOR REC/COMITÊ**Validade:** 29/11/2026

Ass:

MARCELO VILAS-BOAS M. DA SILVA
DIRETOR DE INVESTIMENTOS
IPOSICAPREV
MATRICULA 06614**Liquidante:**

HELTON CARLOS DE ALBUQUERQUE FERREIRA

CPF: ***.019.444-**

Ass:

Helton Carlos de Albuquerque Ferreira
Presidente Executivo
IpojucaPREV
Matricula: 71917

Ofício nº 40/2024 - IPOJUCAPREV

Ipojuca, 18 de Janeiro de 2024

À Caixa Econômica Federal
Sr. Isnaldo Acioly

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 BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA

CNPJ: 14.508.643/0001-55

Conta Vinculada: 20-9

Valor: R\$ 11.435.000,00 (Onze Milhões Quatrocentos e Trinta e Cinco Mil Reais)

Tipo movimentação: Transferência

Conta Origem:

Banco: Caixa Econômica Federal

Agência 3014

C/C: 20-9

Valor: R\$ 11.435.000,00 (Onze Milhões Quatrocentos e Trinta e Cinco Mil Reais)

Conta Destino:

Banco: Caixa Econômica Federal

Agência 3014

C/C: 22-5

CNPJ: 05.364.629/0001-34

Tipo movimentação: Aplicação

Fundo: **CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP**

CNPJ: 14.508.605/0001-00

Conta Vinculada: 22-5

Valor: R\$ 2.500.000,00 (Dois Milhões e Quinhentos Mil Reais)

Fundo: **CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA**

CNPJ: 10.740.670/0001-06

Conta Vinculada: 22-5

Valor: R\$ 8.935.000,00 (Oito Milhões Novecentos e Trinta e Cinco Mil Reais)


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


Helton Carlos de Albuquerque Ferreira
Presidente Executivo do IpojucaPrev

ipojucaprev.ipojuca.pe.gov.br

FONES: (81) 3551-2523 | 3551-2984

Recebido em 18/01/24
ADRIANA ALMEIDA F. S. DE LIMA
Assistente de Variável
Matr. 152127-3
Ag. Ipojuca/PE
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Características		Informações Operacionais											
CNPJ: 14.508.605/0001-00		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: 0,2%		Resgate Mínimo: R\$ 0,00											
Taxa de Administração (Máxima): Não possui		Conversão da Cota para Aplicação: D+0											
Classificação Anbima: Renda Fixa Indexados		Conversão da Cota para Resgate: D+0											
Código de Referência: 310646		Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0											
Início do Fundo: 16/08/2012													

Retorno (%)	Dia	Dia	Dia	24 meses	36 meses	dez/23	nov/23	out/23	set/23	ago/23	jul/23	jun/23	mai/23	abr/23	mar/23	fev/23	jan/23
Fundo	0,09	0,09	0,09	27,01	25,45	1,46	2,47	0,35	0,15	0,73	0,88	2,10	2,20	1,08	2,12	0,83	0,88
% do IRF-M	100,86	100,86	100,86	98,82	97,79	98,61	99,99	92,64	85,38	96,13	99,56	98,88	99,83	98,19	98,92	96,26	105,13
INPC + 6% META ATUARIAL	0,05	0,05	0,05	23,50	44,47	1,02	0,56	0,61	0,57	0,73	0,40	0,39	0,87	0,95	1,18	1,19	0,97
IRF-M	0,09	0,09	0,09	27,33	26,03	1,48	2,47	0,37	0,17	0,76	0,89	2,12	2,20	1,10	2,15	0,86	0,84

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	2,91575	2.374.266,03	1.647.409,49	2,52%	-0,94%	1,19%	1,00	0,04%	2,47%	0,15%	1
IRF-M	-	-	-	2,51%	-0,92%	1,19%	1,00	0,00%	2,47%	0,17%	0

Gráficos

Composição da Carteira

jan/2024

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 BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP

18/01/2024

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

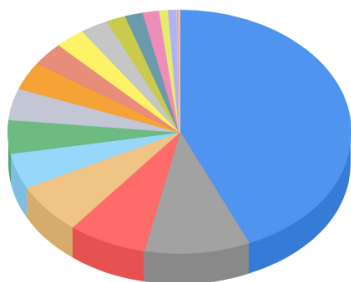
Não há fundos(FI) na carteira

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

Tipo de Aplicação	jan/24	dez/23	nov/23	out/23	set/23	ago/23	jul/23	jun/23
Títulos Públicos	56,50%	51,91%	52,83%	54,31%	54,84%	55,54%	42,17%	41,36%
Operações Compromissadas	43,44%	48,15%	47,14%	45,69%	45,03%	44,58%	57,77%	58,51%
Mercado Futuro - Posições compradas	0,07%	0,00%	0,03%	-0,00%	0,13%	-0,12%	0,06%	0,14%
Valores a receber	0,07%	0,00%	0,03%	0,00%	0,13%	0,00%	0,06%	0,14%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,01%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,00%	-0,06%	-0,00%	-0,00%	-0,01%	-0,13%	-0,01%	-0,01%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	2.406.843,35	2.351.648,71	2.261.375,93	2.161.431,24	2.124.960,94	1.941.182,59	1.825.912,85	1.551.038,46
Data da Divulgação	08/02/2024	09/01/2024	07/12/2023	08/11/2023	06/10/2023	08/09/2023	09/08/2023	06/07/2023

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

jan/2024



Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2025	43,44 %
LFT - Venc.: 01/09/2027	9,93 %
LTN - Venc.: 01/07/2026	7,40 %
LTN - Venc.: 01/01/2026	6,77 %
NTN-F - Venc.: 01/01/2029	4,71 %
LTN - Venc.: 01/04/2025	4,47 %
LTN - Venc.: 01/01/2025	4,18 %
NTN-F - Venc.: 01/01/2027	3,71 %
NTN-F - Venc.: 01/01/2025	3,12 %
LTN - Venc.: 01/07/2025	2,84 %
LFT - Venc.: 01/03/2026	2,60 %
LTN - Venc.: 01/10/2025	1,85 %
NTN-F - Venc.: 01/01/2033	1,68 %
LTN - Venc.: 01/07/2027	1,53 %
LTN - Venc.: 01/04/2024	0,86 %
NTN-F - Venc.: 01/01/2031	0,77 %
LTN - Venc.: 01/07/2024	0,08 %
Outros Valores a receber	0,07 %
Lançamentos positivos menores que 0,07%	0,07 %