

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

<b>AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR</b> <b>Unidade gestora do RPPS: AUTARQUIA PREVIDENCIÁRIA DO IPOJUCA</b> <b>CNPJ: 05.364.629/0001-34</b>	<b>Nº / ANO: 335/2023</b>
	<b>CC: 22-5</b>
	<b>DATA: 08/12/2023</b>
<b>VALOR (R\$): 6.760.000,00 TIPO DE OPERAÇÃO: Aplicação</b>	<b>Dispositivos de resolução do CMN: 4.963, Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "</b>




**HISTÓRICO / DESCRIÇÃO DA OPERAÇÃO**

CARACTERÍSTICAS DO FUNDO: O FUNDO APLICA SEUS RECURSOS EM CARTEIRA COMPOSTA POR TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS, BUSCANDO ACOMPANHAR O IRF-M 1. ALÇADA DE DELIBERAÇÃO: AUTORIZADA A PARTIR DO LIMITE DE ALÇADA DO GESTOR DE RECURSOS. JUSTIFICATIVA: APLICAÇÃO EM FUNDO IRF-M 1 BUSCANDO A PROTEÇÃO DA CARTEIRA E POSICIONAMENTO DA CARTEIRA EM UM MOMENTO DE JUROS ELEVADO, POSSIBILITANDO A CAPTURA DE GANHOS EM CASO DE FECHAMENTO DA CURVA.

**CARACTERÍSTICAS DO ATIVO**

CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI RF

**CNPJ: 10.740.670/0001-06****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: 3,36807****Data de início do fundo: 28/05/2010****Taxa de administração: 0,20%****Benchmark: IRF-M 1****Taxa de performance: 0****CNPJ Gestão: 42.040.639/0001-40****Patrimônio líquido no dia de Movimento: R\$ 8.404.929.251,16****Qtde de Cotas: 2.495.476.410,24849**

<b>Representante Legal:</b>  HELTON CARLOS DE ALBUQUERQUE FERREIRA  CPF: ***.019.444-**  Ass:   Helton Carlos de Albuquerque Ferreira Presidente Executivo IpojucaPREV Matricula: 71917	<b>Proponente/Gestor:</b>  MARCELO VILAS BOAS MARINHEIRO DA SILVA  CPF: ***.431.764-**  <b>Certificação: TOTUM - TOTUM GESTOR REC/COMITÊ</b>  <b>Validade: 29/11/2026</b>  Ass:   MARCELO VILAS BOAS M. DA SILVA DIRETOR DE INVESTIMENTOS IPOJUCAPREV MATRICULA 66814	<b>Liquidante:</b>  HELTON CARLOS DE ALBUQUERQUE FERREIRA  CPF: ***.019.444-**  Ass:   Helton Carlos de Albuquerque Ferreira Presidente Executivo IpojucaPREV Matricula: 71917
---	---	--

Ofício nº 870/2023 - IPOJUCAPREV

Ipojuca, 08 de Dezembro de 2023

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\$ 8.760.000,00 (Oito Milhões Setecentos e Sessenta Mil Reais)

**Tipo movimentação:** Transferência

**Conta Origem:**

Banco: Caixa Econômica Federal

Agência 3014

C/C: 20-9

Valor: R\$ 8.760.000,00 (Oito Milhões Setecentos e Sessenta 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\$ 2.000.000,00 (Dois Milhões de Reais)

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

CNPJ: 10.740.670/0001-06

Conta Vinculada: 22-5

Valor: R\$ 6.760.000,00 (Seis Milhões Setecentos e Sessenta Mil Reais)

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

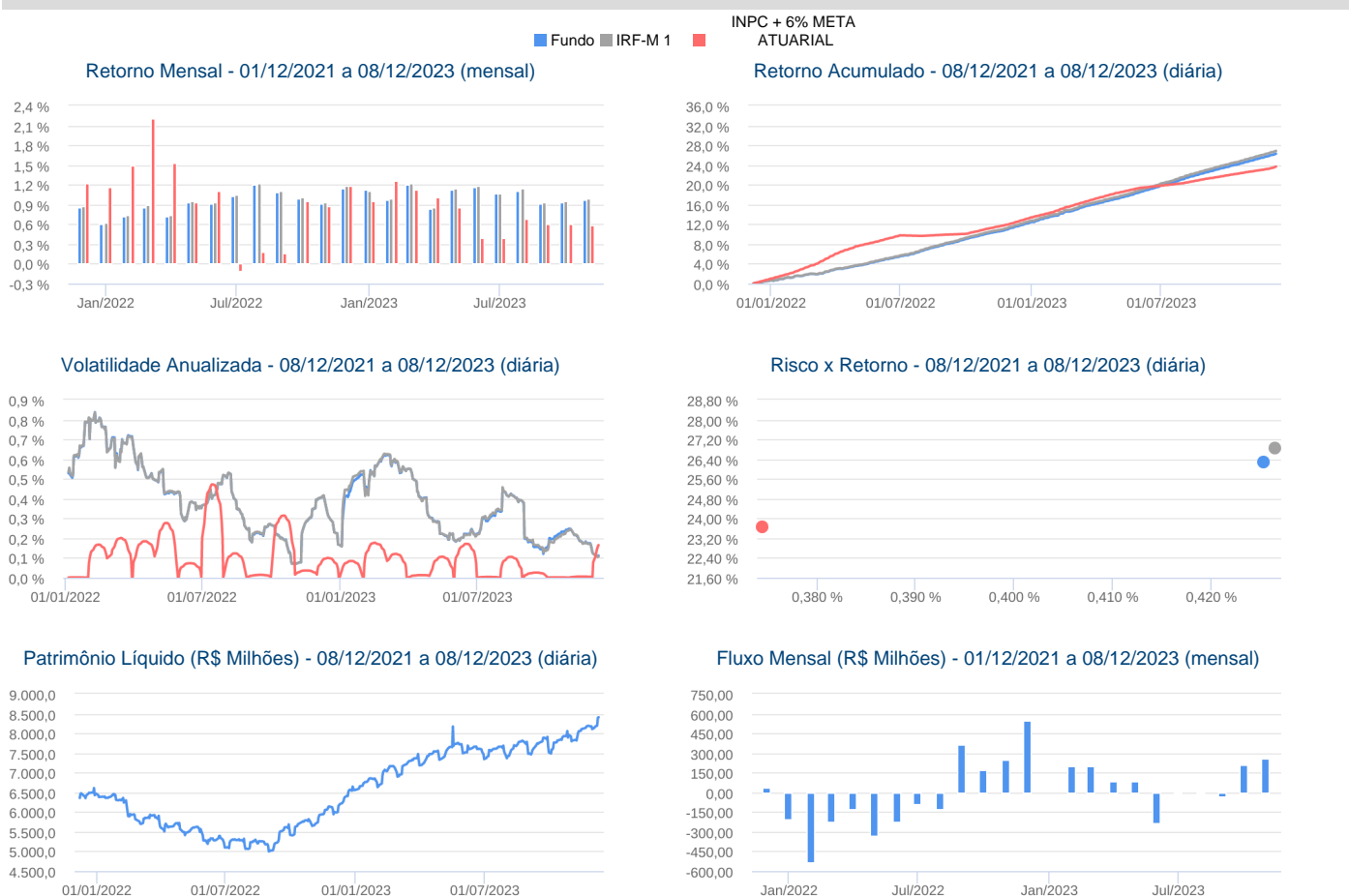
  
**Helton Carlos de Albuquerque Ferreira**  
Presidente Executivo do IpojucaPrev

[ipojucaprev.ipojuca.pe.gov.br](http://ipojucaprev.ipojuca.pe.gov.br)

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

*Recebido em 08/12/23*  
ADRIANA ALMEIDA F. S. DE L. B.  
Assistente de Varejo  
Matr. 152127-3  
Ag. Ipojuca/PE  
CAIXA ECONÔMICA

Características		Informações Operacionais															
CNPJ: 10.740.670/0001-06		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: 248975		Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0															
Início do Fundo: 28/05/2010																	
Retorno (%)	Dia	Dia	Dia	24 meses	36 meses	nov/23	out/23	set/23	ago/23	jul/23	jun/23	mai/23	abr/23	mar/23	fev/23	jan/23	dez/22
Fundo	0,04	0,04	0,04	26,26	29,13	0,97	0,94	0,91	1,11	1,07	1,16	1,12	0,84	1,21	0,97	1,12	1,15
% do IRF-M 1	97,29	97,29	97,29	97,86	97,09	97,57	98,36	97,73	96,97	100,28	97,42	98,17	97,90	98,37	98,31	101,98	97,88
INPC + 6% META ATUARIAL	0,05	0,05	0,05	23,67	45,39	0,56	0,61	0,57	0,73	0,40	0,39	0,87	0,95	1,18	1,19	0,97	1,20
IRF-M 1	0,04	0,04	0,04	26,84	30,01	1,00	0,96	0,93	1,15	1,07	1,19	1,14	0,86	1,23	0,98	1,10	1,18
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	3,368066	8.404.929,25	7.433.560,47	0,35%	-0,02%	0,17%	0,98	0,03%	1,21%	0,84%	2						
IRF-M 1	-	-	-	0,35%	-0,04%	0,17%	1,00	0,00%	1,23%	0,86%	0						

**Gráficos**

**Composição da Carteira**

dez/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 BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA**

08/12/2023

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

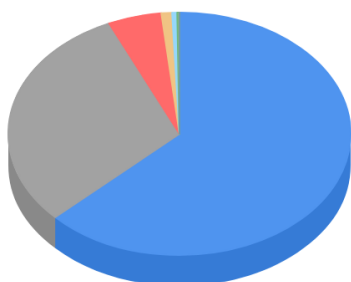
Não há fundos(FI) na carteira

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

Tipo de Aplicação	dez/23	nov/23	out/23	set/23	ago/23	jul/23	jun/23	mai/23
Operações Compromissadas	62,92%	61,81%	76,85%	80,61%	82,85%	83,39%	58,87%	59,87%
Títulos Públicos	37,08%	38,15%	23,10%	19,33%	17,12%	16,56%	41,06%	40,10%
Mercado Futuro - Posições compradas	0,00%	0,01%	0,01%	0,01%	-0,01%	0,01%	0,02%	-0,01%
Valores a receber	0,00%	0,01%	0,01%	0,01%	3,06%	0,01%	0,02%	0,00%
Disponibilidades	0,00%	0,04%	0,04%	0,05%	0,06%	0,05%	0,05%	0,04%
Valores a pagar	-0,01%	-0,00%	-0,00%	-0,01%	-0,02%	-0,01%	-0,01%	-0,01%
Vendas a termo a receber	-	-	-	-	3,06%	-	-	-
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	8.470.280,31	8.126.749,36	7.795.296,70	7.513.988,20	7.477.458,11	7.409.323,50	7.342.301,50	7.491.213,17
Data da Divulgação	09/01/2024	07/12/2023	08/11/2023	06/10/2023	08/09/2023	09/08/2023	06/07/2023	09/06/2023

**Composição da Carteira Individual - Ativos (%)**

dez/2023



Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/07/2025	62,92 %
LTN - Venc.: 01/01/2024 (BRSTNCLTN7S1)	30,34 %
LTN - Venc.: 01/04/2024 (BRSTNCLTN7Y9)	5,05 %
LFT - Venc.: 01/03/2024 (BRSTNCLF1RA8)	1,01 %
LTN - Venc.: 01/07/2024 (BRSTNCLTN7W3)	0,47 %
LTN - Venc.: 01/10/2024 (BRSTNCLTN822)	0,21 %
Outros Valores a pagar	-0,01 %
Outras Disponibilidades	0,00 %
Outros Valores a receber	0,00 %
Mercado Futuro - Posições compradas - D11FUTJ24	0,00 %
Mercado Futuro - Posições compradas - D11FUTV24	0,00 %
Mercado Futuro - Posições compradas - D11FUTN24	0,00 %
Mercado Futuro - Posições compradas - D11FUTF24	0,00 %