RELATÓRIO MENSAL

ELABORADO POR:

Superintendência de Investimentos

FEVEREIRO DE 2024



REGIME PRÓPRIO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE MANAUS

Manaus Previdência
Autarquia Municipal

Prefeitura de Manaus

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790



DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790

SUMÁRIO

APRESENTAÇÃO 03

CENÁRIO MACROECONÔMICO INTERNACIONAL 04
Estados Unidos - Taxa de Inflação
Europa - Zona do Euro | Taxa de Inflação
Ásia | China | PIB Taxa de Crescimento Anual Global

CENÁRIO MACROECONÔMICO NACIONAL 10
Brasil | PIB Taxa de Crescimento Anual
Inflação | Política Monetária | COPOM
Taxa Selic Meta

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO RPPS 14
Evolução Patrimonial | Plano Previdenciário
Composição da Carteira de Investimentos
Composição dos Ativos por Classe

PLANO PREVIDENCIÁRIO 17
Ativos do Plano Previdenciário
Rentabilidade do Plano Previdenciário
Fundos Problemáticos | Demais Ativos

GESTÃO DE RISCOS 25
Volatilidade | Retorno diário e mensal | Liquidez Execução da Política de Investimentos
Gestores e Administradores da Carteira

COMITÊ DE INVESTIMENTOS 31

CONCEITOS IMPORTANTES 33

PARTICIPANTES DO PROCESSO DE INVESTIMENTOS 37

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790

APRESENTAÇÃO

É com satisfação que apresentamos nosso **Relatório Mensal de Investimentos de Fevereiro de 2024**, por meio do qual reforçamos nosso compromisso com a transparência, trazendo as principais ações e resultados do período e o modo como criamos valor para a Carteira de Investimentos do Fundo Previdenciário da Manaus Previdência.

Todos os atos praticados durante a execução do presente Relatório estão pautados na observância dos princípios constitucionais impostos à administração pública, atendendo à legalidade, à impessoalidade, à moralidade, à publicidade e à eficiência.

O conteúdo do Relatório é organizado em capítulos. Apresentamos inicialmente um resumo sobre o cenário macroeconômico internacional, contemplando as principais economias do mundo. Em seguida, tratamos do cenário macro doméstico, detalhando os principais indicadores econômicos.

Na sequência, apresentamos a evolução e a composição da carteira seguida de cada um dos seus ativos, inclusive aqueles considerados problemáticos.

Em continuidade, o Relatório resume os principais indicadores da gestão de riscos, seguindo com uma síntese das principais decisões tomadas pelo Comitê de Investimentos nas reuniões do mês em foco.

Como forma de auxiliar na melhor compreensão do presente documento, reservamos ainda um capítulo em que consta os principais conceitos sobre ativos e índices essenciais na comprensão e análise de investimentos. E, por fim, o Relatório traz os participantes do processo de investimentos no âmbito do RPPS.

Importante reforçar que o Comitê de Investimentos da Manaus Previdência é o órgão colegiado responsável por examinar e deliberar acerca das propostas de investimentos, desinvestimentos e redirecionamentos de recursos, bem como por acompanhar e avaliar o desempenho dos investimentos realizados.

Tenham todos uma exelente leitura!



DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790



CENÁRIO MACROECONÔMICO INTERNACIONAL

EUA

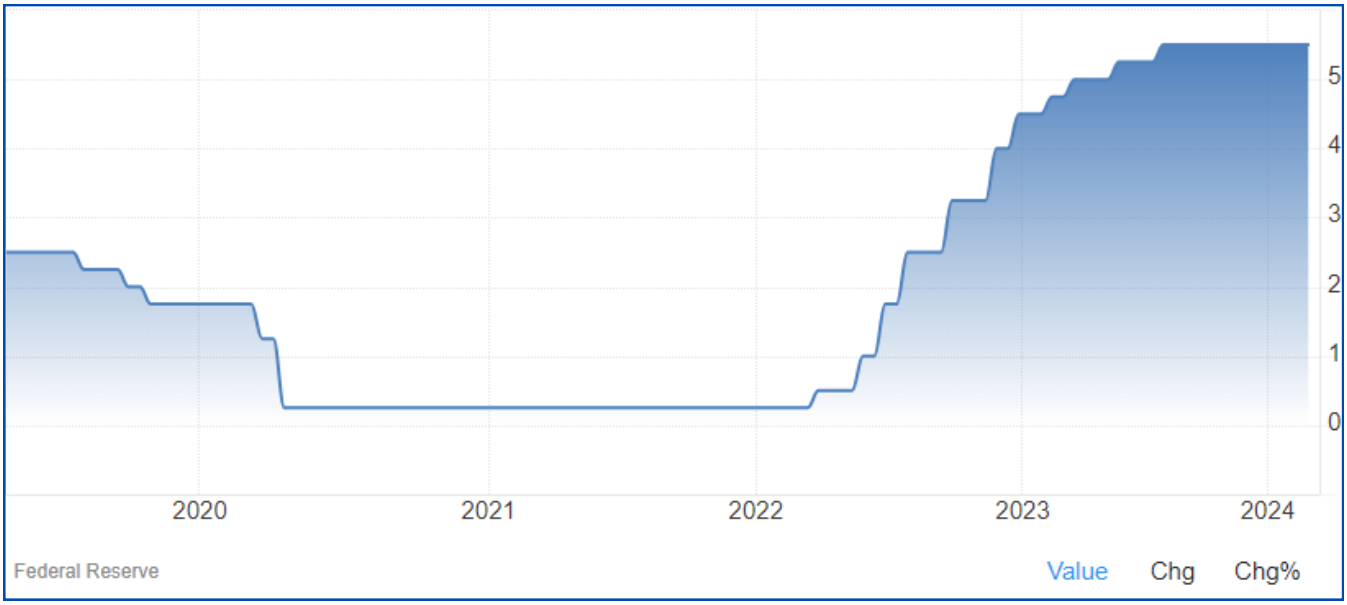
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790

A inflação medida pelo índice CPI de janeiro acelerou o ritmo ao registrar 0,3% (M/M), e a inflação medida pelo PCE de janeiro apresentou crescimento de 0,3% (M/M). Sobre a inflação, os membros do FOMC, sinalizaram que arrefeceu ao longo do último ano, ainda que permaneça elevada e acima do objetivo de 2,0% do FOMC. Apesar de os dados de inflação terem indicado desinflação significativa na segunda metade do ano passado, os participantes da reunião observaram que continuarão avaliando de maneira cuidadosa os próximos dados, de forma a julgar se a inflação está se movendo de maneira sustentada na direção do objetivo.

O comitê sinalizou que não considera ser apropriado reduzir o intervalo de variação da Fed Funds Rate (FFR) até que ganhe maior confiança que a inflação está se movendo sustentadamente na direção do patamar de 2,0%. os ganhos de empregos moderaram desde o início do ano passado, mas seguem fortes, mantendo a visão de que o desemprego permanece baixo. Foram reiteradas as menções à solidez do sistema bancário e ao aperto de condições financeiras.

Fonte: Boletim RPPS da Caixa Asset - Março de 2024.

ESTADOS UNIDOS - TAXA DE JUROS



DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790



CENÁRIO MACROECONÔMICO INTERNACIONAL

EUROPA

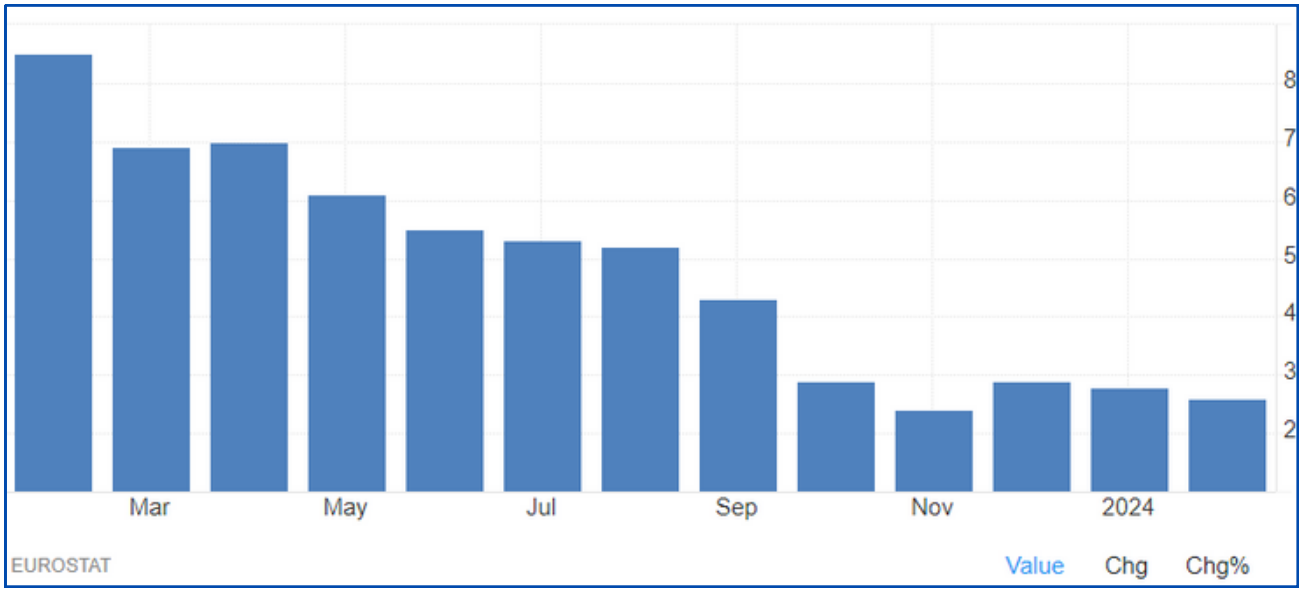
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790

A inflação medida pelo do CPI de janeiro desacelerou de 2,9% para 2,8% (A/A), acima das expectativas de mercado (2,7%). Os resultados demonstraram desaceleração bem disseminada com destaque para alimentos 5,7% (A/A), por outro lado, a inflação de serviços se manteve aos 4,0% (A/A) pelo terceiro mês seguido. A produção industrial na Zona do Euro variou 2,6% (M/M) no mês de dezembro/23. O resultado mensal veio acima das expectativas do mercado (-0,2%). As vendas do comércio varejista apresentou variação de –1,1% (M/M), desacelerando em relação ao mês anterior e abaixo das expectativas de mercado.

Por fim, o Comitê de Política Monetária (MPC) do Bank of England (BoE) manteve sua taxa básica de juros em 5,25% a.a. Nessa reunião, dos nove membros, seis votaram pela manutenção, dois foram favoráveis a uma elevação de 0,25 p.p. e uma sugeriu um corte de 0,25 p.p. Na última reunião o MPC avalia que o ritmo de crescimento segue deprimido, entretanto, a atividade nos EUA continua a ser mais forte.

Fonte: Boletim RPPS da Caixa Asset - Março de 2024.

ZONA DO EURO - TAXA DE INFLAÇÃO



DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790



CENÁRIO MACROECONÔMICO INTERNACIONAL

ÁSIA

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790

O PBoC (People´s Bank of China) informou a manutenção da taxa de referência para empréstimos (LPR) de um ano em 3,45% (em linha com a expectativa do mercado), enquanto reduziu a de 5 anos em 3,95% ante 4,20%, vindo abaixo da expectativa do mercado (4,10%).

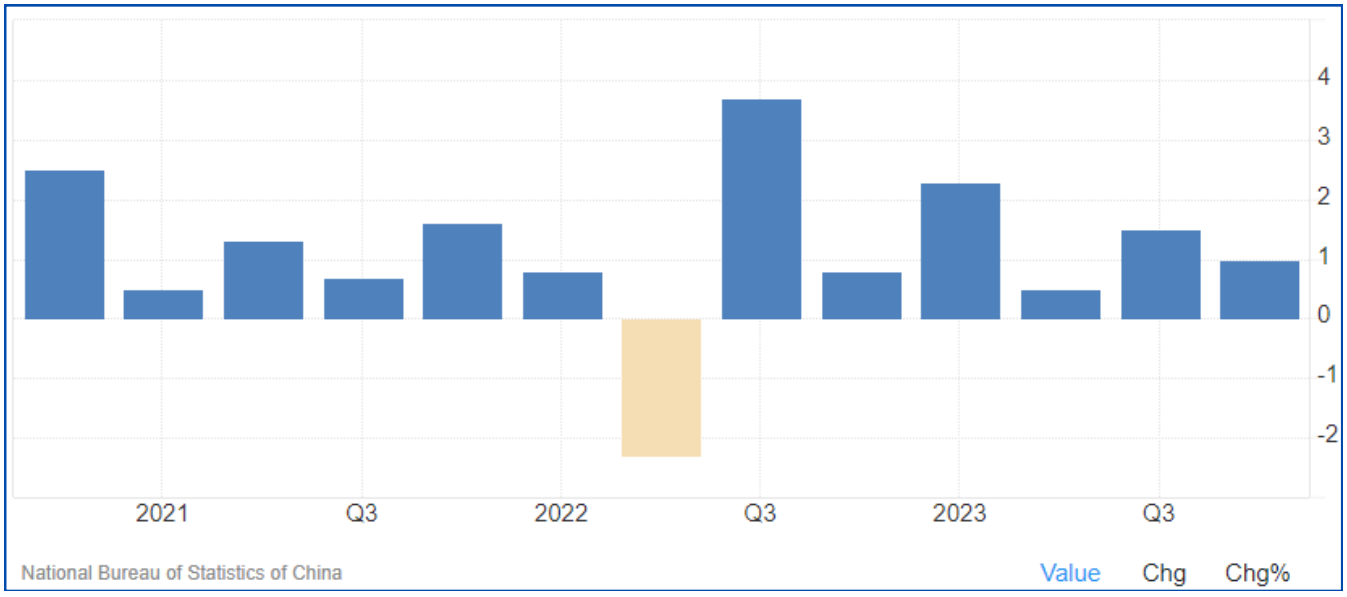
GLOBAL

No front geopolítico, a tensão continua no oriente médio com o conflito entre Israel e Hamas e a incursão de rebeldes “houthis” do Iêmen no Mar Vermelho, com reflexos no frete marítimo no canal e Suez, a principal via entre o principal porto da Europa (Roterdã) e a Ásia.

Já a guerra entre Rússia e Ucrânia, completou 24 meses, continuando sem perspectivas de novas negociações diplomáticas.

Fonte: Boletim RPPS da Caixa Asset - Março de 2024.

CHINA - TAXA DE CRESCIMENTO DO PIB



DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790



CENÁRIO MACROECONÔMICO NACIONAL

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790

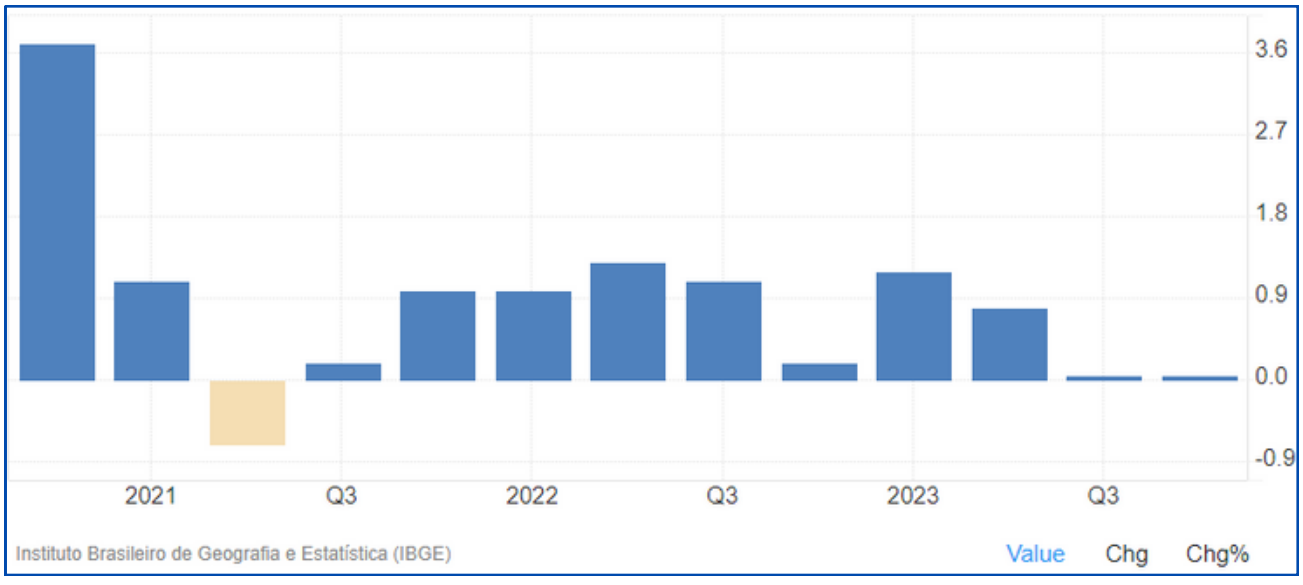
ATIVIDADE ECONÔMICA

Acerca dos indicadores de atividade divulgados em fevereiro: destaque negativo para a confiança de serviços (-1,6%, M/M) e a deterioração das expectativas. A produção industrial teve crescimento de 1,1% em dezembro. Nos ramos industriais, a maioria das categorias acompanharam o movimento de crescimento mensal, com destaque para confecção de artigos de vestuário e acessórios (14,5%), equipamentos de informática (10,4%), produtos diversos (6,1%), equipamentos de transporte (5,7%) e preparação de couros e calçados (3,4%). No acumulado em 12 meses, houve aceleração de 0,1% para 0,2%. O volume de serviços de dezembro cresceu 0,3% (M/M).

Nesse contexto, teve um destaque positivo para Serviços prestados às famílias (3,5%), Transportes, serviços auxiliares aos transportes e correio (1,3%) e Serviços de informação e comunicação (0,2%). No acumulado em 12 meses, houve desaceleração de 3,1% para 2,3%. O IBCBr de dezembro avançou 0,8% (M/M), refletindo a melhora da confiança vista no final de 2023 e o bom número da indústria, mesmo com a economia estando sob influência dos efeitos defasados negativos da política monetária contracionista.

Fonte: Boletim RPPS da Caixa Asset - Março de 2024.

BRASIL - PIB TAXA DE CRESCIMENTO ANUAL



DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790

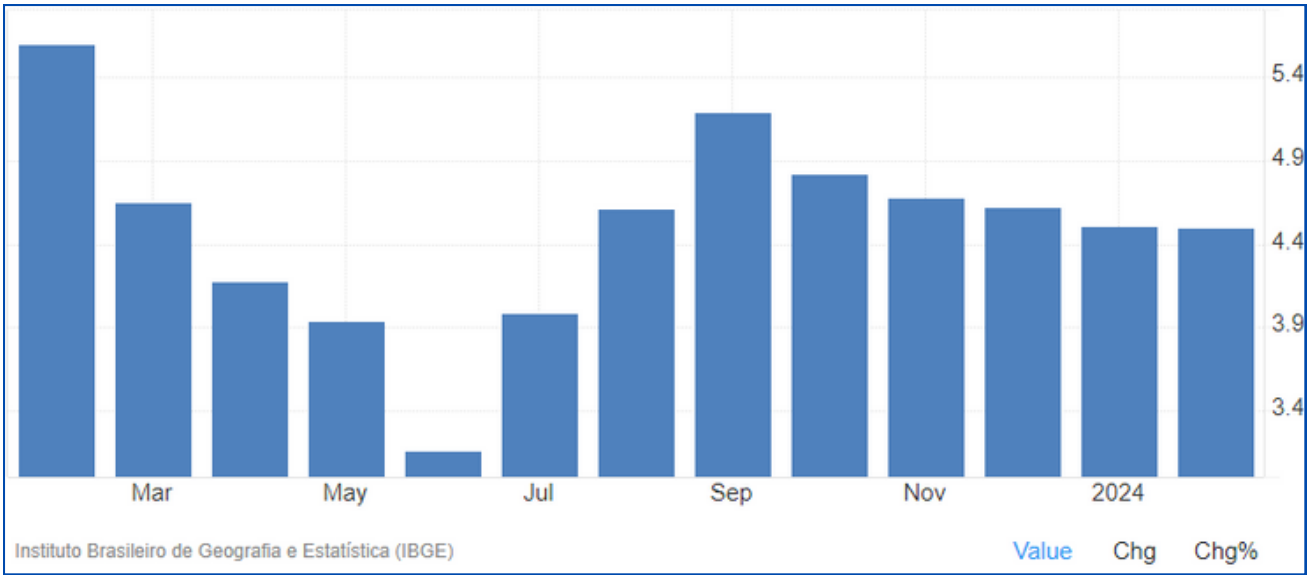
INFLAÇÃO

A inflação medida pelo IPCA avançou +0,83% (M/M) em fevereiro, acelerando em relação ao avanço de +0,42% (M/M) observado no mês anterior. Foi a maior variação mensal dos últimos 12 meses. Sendo que a variação foi superior a projeção de mercado de +0,76%. Com isso, o índice acumulou alta de +4,5% em 12 meses (ante +4,51% em janeiro), desacelerando assim nessa base comparação. Dentre os grupos, os que mais contribuíram para variação vieram dos Transportes (variação de +0,72% ante projeção de +0,21%) e Alimentação e bebidas (+0,95% ante projeção de +0,82%). A maior contribuição para a variação do índice contudo, partiu do grupo Educação influenciado pelo expressivo aumento dos itens de Cursos regulares, como esperado pela sazonalidade.

Contudo, os preços administrados avançaram +0,88% em fevereiro, influenciados principalmente pelo avanço dos preços do item Emplacamento e licença (-0,09% ante - 6,34% na leitura anterior). Já os preços livres aceleraram (+0,81%) ainda se mantendo como os principais vetores do IPCA. Nas aberturas dos preços livres, produtos industriais e alimentos desaceleraram de (+0,21%) e (+1,12%), respectivamente. Por outro lado, os serviços aceleraram em +1,06%.

Fonte: Boletim RPPS da Caixa Asset - Março de 2024.

BRASIL - TAXA DE INFLAÇÃO MENSAL



DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790

POLÍTICA MONETÁRIA

Na reunião do COPOM, em fev/2024, há a avaliação de que o Copom, não trouxe novas indicações sobre a condução de política monetária, ratificando a necessidade de manter uma política monetária contracionista até que se consolide a convergência da inflação e das expectativas para as metas. No geral, os membros concordaram unanimemente que o ritmo de 0,50 p.p., nas próximas reuniões, é entendido como apropriado para manter a política monetária contracionista o suficiente para que o processo desinflacionário tenha continuidade. No pós reunião do Copom a Selic foi levada de 11,75% para 11,25% aa.

➤ GERAL

Ainda há incertezas presentes em relação ao cenário externo e possíveis impactos no processo inflacionário global.

➤ COPOM

SELIC em 11,25 % a.a.

Próximo COPOM: 19 e 20 de março de 2024

➤ IPCA JANEIRO DE 2024

O IPCA avançou 0,83% (M/M) em Fevereiro. Acumulado alta de 4,5% em 12 meses.

Fonte: Boletim RPPS da Caixa Asset - Março de 2024.

BRASIL - TAXA SELIC META



DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790

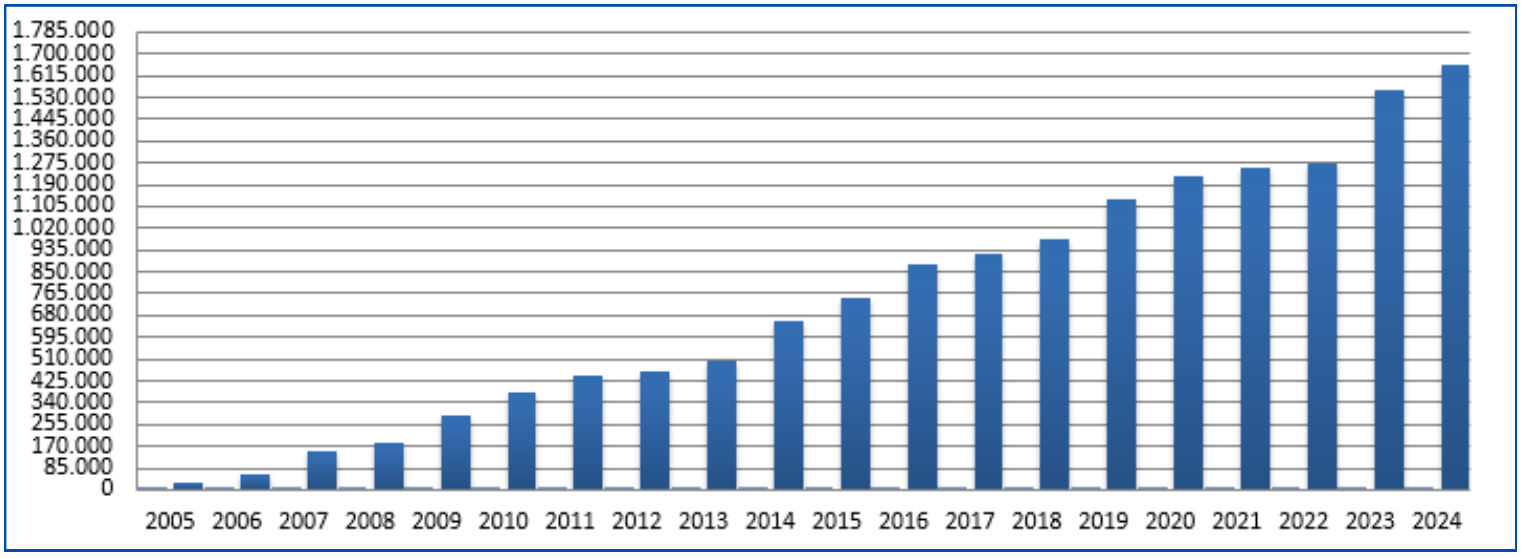


CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO RPPS

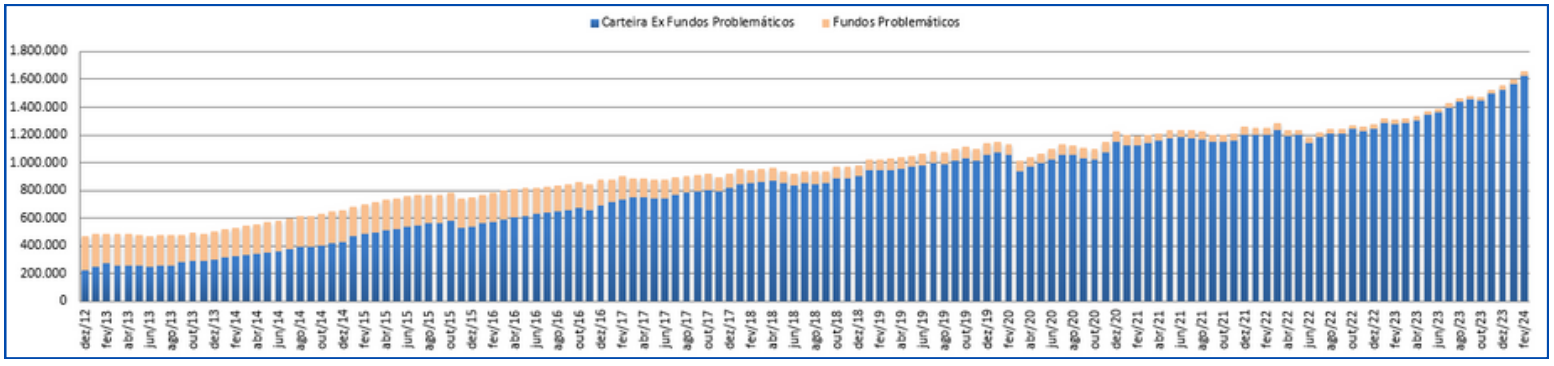
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790

A carteira de investimentos da Manaus Previdência é composta por ativos que estão vinculados aos seus respectivos planos, quais sejam: **Plano Financeiro (PFIN) e Plano Previdenciário (PPREV)**. Além desses, compõem a carteira de investimentos os recursos oriundos da taxa de administração, que são utilizados na manutenção dos serviços e pagamento de pessoal da autarquia. Dado que apenas o Plano Previdenciário possui meta atuarial estabelecida, sendo este um fundo previdenciário em regime de capitalização dos recursos, este relatório dará enfoque aos ativos a ele vinculados.

EVOLUÇÃO PATRIMONIAL DA CARTEIRA DO PLANO PREVIDENCIÁRIO (R$ MIL)



CARTEIRA SEM FUNDOS PROBLEMÁTICOS VS FUNDOS PROBLEMÁTICOS

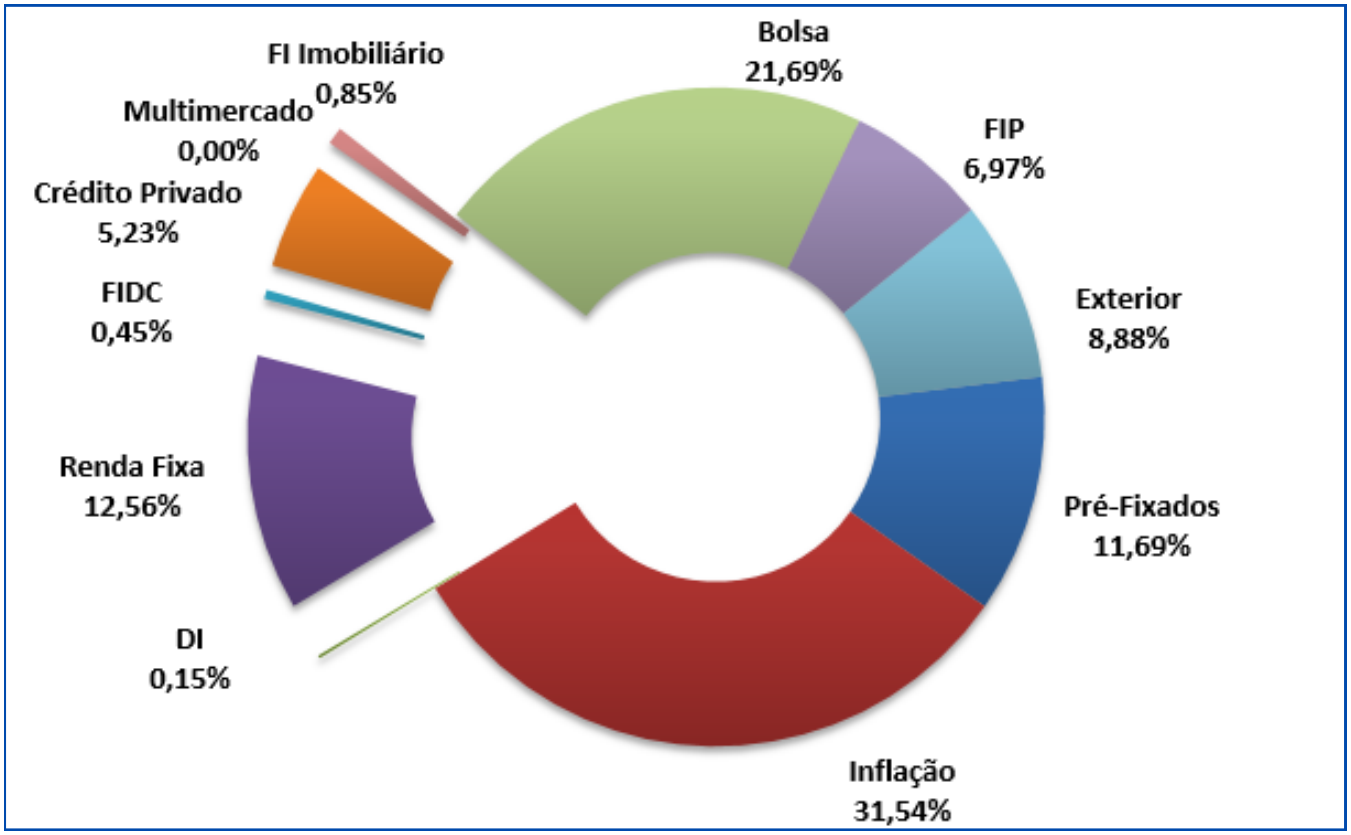


DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO RPPS

Renda Fixa			**927.980.540,97**	**59,32%**					**1.021.556.344,38**	**61,62%**
	Pré-Fixados	R$	193.843.377,03	12,39%				R$	193.843.377,15	11,69%
	Inflação	R$	522.944.851,40	33,43%				R$	522.944.851,73	31,54%
	DI	R$	946.323,50	0,06%			R$ 1.482.018,24	R$	2.428.341,74	0,15%
	Renda Fixa	R$	116.108.503,82	7,42%	R$	84.025.604,19	R$ 8.068.180,39	R$	208.202.288,47	12,56%
	FIDC	R$	7.437.714,79	0,48%				R$	7.437.714,79	0,45%
	Crédito Privado	R$	86.699.770,43	5,54%				R$	86.699.770,49	5,23%
Renda Variável		**R$**	**489.148.607,47**	**31,27%**				**R$**	**489.148.607,78**	**29,50%**
	Multimercado	R$	-	0,00%				R$	-	0,00%
	FI Imobiliário	R$	14.057.920,19	0,90%				R$	14.057.920,20	0,85%
	Bolsa	R$	359.577.557,10	22,99%				R$	359.577.557,33	21,69%
	FIP	R$	115.513.130,18	7,38%				R$	115.513.130,25	6,97%
Investimento no Exterior		**R$**	**147.174.295,06**	**9,41%**				**R$**	**147.174.295,15**	**8,88%**
	Exterior	R$	147.174.295,06	9,41%				R$	147.174.295,15	8,88%
Total		**R$**	**1.564.303.443,50**	**100%**	**R$**	**84.025.604,19**	**R$ 9.550.198,63**	**R$**	**1.657.879.246,32**	**100%**

COMPOSIÇÃO DOS ATIVOS POR CLASSE



DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790



PLANO PREVIDENCIÁRIO

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790

RENTABILIDADE DO PLANO PREVIDENCIÁRIO

	fev/24	jan/24	dez/23	2023	12 m	24 m
Carteira PPREV	1,80%	-0,03%	2,55%	1,77%	16,52%	17,69%
Carteira Ex Fundos Problemáticos	1,83%	-0,03%	2,58%	1,80%	16,71%	18,97%
Meta Atuarial	1,21%	0,86%	0,78%	2,07%	9,64%	21,46%
CDI	0,80%	0,97%	0,90%	1,78%	12,72%	27,34%
Ibovespa	0,99%	-4,79%	5,38%	-3,85%	22,94%	14,02%

Em fevereiro, a rentabilidade da carteira de investimentos do plano previdenciário foi de **1,80%**. Já no acumulado dos últimos 12 e 24 meses foi de **16,52%** e **17,69%**, respectivamente. A linha intitulada **"Carteira Ex Fundos Problemáticos"** informa a rentabilidade do plano previdenciário desconsiderando o impacto dos fundos problemáticos, que são aqueles aplicados durante os anos de 2008 a 2012 e que se encontram fechados para resgates por não possuírem recursos em caixa.

A linha intitulada **Meta Atuarial** informa a meta de rendimento anual estabelecida para o plano previdenciário a partir da avaliação técnica atuarial anual.

A linha "**CDI**" informa a rentabilidade do CDI para o respectivo período. Esse *benchmark* é utilizado como parâmetro base para investimentos de baixo risco. Uma carteira eficiente deve possuir rentabilidade histórica superior à rentabilidade do CDI.

A linha **"Ibovespa"** informa a rentabilidade do principal índice de ações da bolsa de valores brasileira. O Ibovespa é utilizado como benchmark para a maioria dos fundos de ações brasileiros.



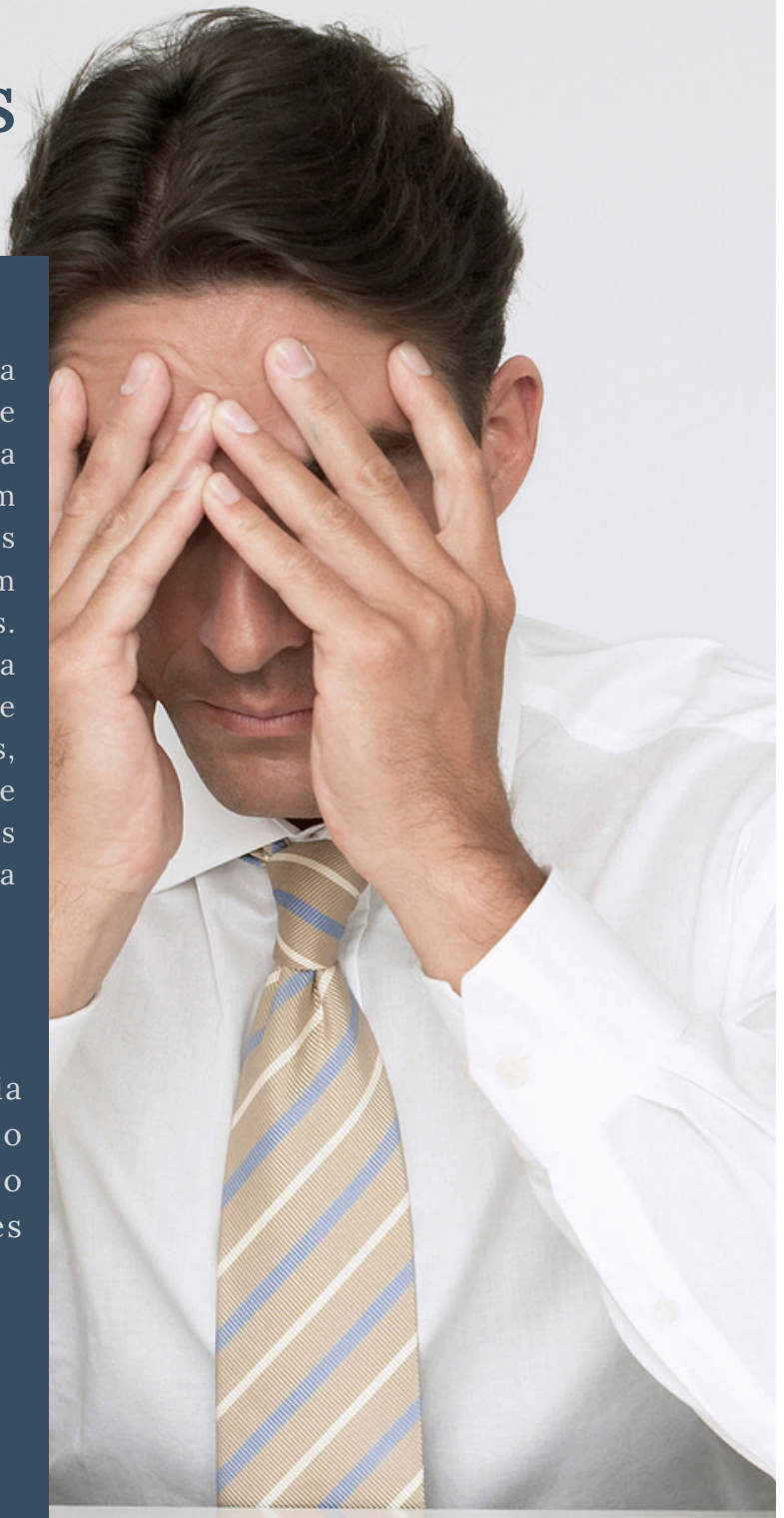
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790



ATIVOS DO PLANO PREVIDENCIÁRIO

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790

FUNDOS PROBLEMÁTICOS



A Manaus Previdência possui em sua carteira de investimentos 11 (onze) fundos de investimentos que estão fechados para resgates por não possuírem recursos em caixa. Na maioria dos casos, os fundos adquiriram títulos de crédito que não foram honrados por seus devedores e coobrigados. A gestão de todos esses fundos foi repassada para novas instituições, que atualmente buscam recuperar os valores investidos, inclusive via ações judiciais. Importante destacar que as aplicações nesses fundos foram realizadas durante o período de 2008 a 2012.

A partir de 2013, a Manaus Previdência iniciou um trabalho de recuperação desses investimentos, tendo conseguido o resgate total de um terço desses fundos de alto risco.

No fechamento do mês de janeiro, **1,82% (R$ 30.112.592,58.),** do total da carteira de investimentos, ainda estavam vinculados a estes fundos. Ressalte-se que, em 2012, esse percentual era superior a 50% da carteira.

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790

FUNDOS PROBLEMÁTICOS

29/02/2024

	APLICAÇÃO INICIAL	DATA DA 1ª APLICAÇÃO	POSIÇÃO ATUALIZADA	RESGATES	GANHO/ PERDA	SITUAÇÃO
TOP FI RF (ADINVEST TOP)	R$ 7.500.000,00	31/08/12	R$ 845.945,50	R$ 4.127.041,84	-R$ 2.527.012,66	Fechado para resgate
FI VITORIA REGIA	R$ 10.000.000,00	03/08/12	R$ 1.129.826,67	R$ 4.993.300,25	-R$ 3.876.873,08	Fechado para resgate
DIFERENCIAL FI RF LP	R$ 28.000.000,00	21/12/10	R$ 633.079,08	R$ 24.503.776,42	-R$ 2.863.144,50	Fechado para resgate
BBIF MASTER FIDC LP	R$ 25.500.000,00	03/11/10	R$ 5.567.352,70	R$ -	-R$ 19.932.647,30	Fechado para resgate
BVA MASTER FIDC	R$ 15.000.000,00	28/04/10	R$ 118.980,01	R$ 16.886.600,40	R$ 2.005.580,41	Fechado para resgate
BVA MASTER II FIDC	R$ 9.999.963,06	06/08/10	R$ 89.549,36	R$ 12.221.055,83	R$ 2.310.642,13	Fechado para resgate
FIDC MULTIS. ITÁLIA	R$ 7.500.000,00	11/06/12	R$ 1.661.832,72	R$ 7.500.155,04	R$ 1.661.987,76	Fechado para resgate
SECURITY FI REF. DI LP	R$ 5.000.000,00	02/09/09	R$ 843.621,78	R$ 3.167.634,60	-R$ 988.743,62	Fechado para resgate
PIATÃ FI RF RPPS CP LP	R$ 43.337.555,64	19/11/08	R$ 5.344.567,77	R$ 37.058.353,73	-R$ 934.634,14	Fechado para resgate
ÁTICO GER ENER FIP	R$ 2.500.000,00	13/05/11	-R$ 180.083,20	R$ -	-R$ 2.680.083,20	Fechado para resgate
FII BR HOTÉIS	R$ 20.000.000,00	26/09/12	R$ 14.057.920,19	R$ 2.931.614,65	-R$ 3.010.465,16	Sem liquidez
SUB-TOTAL	**R$ 174.337.518,70**		**R$ 30.112.592,58**	**R$ 113.389.532,76**	**-R$ 30.835.393,36**	
Fundos Liquidados						
PATRIARCA FIP	R$ 19.999.999,99	02/09/10		R$ 4.129.769,98	-R$ 15.870.230,01	Liquidado
ATICO FIDC IMOBILIARIOS	R$ 3.748.631,03	13/05/11		R$ 3.873.549,50	R$ 124.918,47	Liquidado
ECOHEDGE MULTIM.	R$ 23.698.637,66	31/08/12		R$ 11.825,29	-R$ 23.686.812,37	Liquidado
SUB-TOTAL	**R$ 47.447.268,68**			**R$ 8.015.144,77**	**-R$ 39.432.123,91**	
TOTAL	**R$ 221.784.787,38**		**R$ 30.112.592,58**	**R$ 121.404.677,53**	**-R$ 70.267.517,27**	



DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790

DEMAIS ATIVOS DO PLANO PREVIDENCIÁRIO

FUNDOS PRÉ-FIXADOS			MÊS	CDI	ANO	CDI	12 MESES	CDI
NTN-F - 01.01.2027 (Curva) - 06.08.2021	R$	17.046.296,23	0,68%	0,80%	1,57%	1,78%	9,48%	12,72%
NTN-F - 01.01.2027 (Curva) - 20.08.2021	R$	17.146.359,12	0,75%	0,80%	1,72%	1,78%	10,45%	12,72%
NTN-F - 01.01.2031 (Curva) - 08.09.2021	R$	42.571.603,34	0,79%	0,80%	1,88%	1,78%	11,05%	12,72%
NTN-F - 01.01.2031 (Curva) - 25.10.2021	R$	40.379.254,58	0,90%	0,80%	2,15%	1,78%	12,78%	12,72%
CAIXA BRASIL IRF-M	R$	76.699.863,76	0,43%	0,80%	1,11%	1,78%	15,62%	12,72%
TOTAL	R$	193.843.377,03						
% TOTAL DA CARTEIRA		12,39%						

FUNDOS DE INFLAÇÃO			MÊS	CDI	ANO	CDI	12 MESES	CDI
NTN-B - 15.08.2030 (Curva) - 18.08.2021	R$	55.161.547,69	0,93%	0,80%	1,96%	1,78%	9,52%	12,72%
NTN-B - 15.08.2030 (Curva) - 08.09.2021	R$	48.215.204,17	0,93%	0,80%	1,96%	1,78%	9,56%	12,72%
NTN-B - 15.05.2045 (Curva) - 26.07.2022	R$	85.485.150,07	1,04%	0,80%	2,34%	1,78%	11,30%	12,72%
NTN-B - 15.05.2045 (Curva) - 06.07.2023	R$	18.920.254,90	1,00%	0,80%	2,22%	1,78%	-	-
NTN-B - 15.08.2050 (Curva) - 05.07.2023	R$	30.173.322,15	0,99%	0,80%	2,23%	1,78%	-	-
NTN-B - 15.05.2055 (Curva) - 05.07.2023	R$	31.013.947,50	0,99%	0,80%	2,25%	1,78%	-	-
NTN-B - 15.05.2055 (Curva) - 11.10.2023	R$	51.015.840,34	1,02%	0,80%	2,32%	1,78%	-	-
NTN-B - 15.08.2060 (Curva) - 15.08.2022	R$	53.467.617,44	1,02%	0,80%	2,33%	1,78%	11,00%	12,72%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL	R$	62.446.368,33	0,48%	0,80%	-0,10%	1,78%	14,56%	12,72%
TOTAL	R$	435.899.252,59						
% TOTAL DA CARTEIRA		27,87%						

FUNDOS RENDA FIXA			MÊS	CDI	ANO	CDI	12 MESES	CDI
TOP FI RF (ADINVEST TOP)	R$	845.945,50	-0,07%	0,80%	0,13%	1,78%	2,24%	12,72%
BRASIL RF LP (DIFERENCIAL)	R$	633.079,08	-1,80%	0,80%	-5,18%	1,78%	-51,79%	12,72%
FI VITORIA RÉGIA	R$	1.129.826,67	-0,08%	0,80%	0,04%	1,78%	1,58%	12,72%
BB RPPS FLUXO - FPREV	R$	25.176.895,11	0,73%	0,80%	1,61%	1,78%	11,62%	12,72%
BB PERFIL - FPREV	R$	35.534.845,17	0,80%	0,80%	1,78%	1,78%	12,75%	12,72%
BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL	R$	51.222.020,63	0,74%	0,80%	1,58%	1,78%	12,69%	12,72%
ITAÚ ALOC DINÂMICA	R$	1.115.399,64	0,56%	0,80%	1,04%	1,78%	15,14%	12,72%
BTG PACTUAL TESOURO SELIC DI	R$	946.323,50	0,79%	0,80%	1,76%	1,78%	12,58%	12,72%
TOTAL	R$	116.604.335,30						
% TOTAL DA CARTEIRA		7,45%						

TÍTULOS DE INSTITUIÇÃO FINANCEIRA			MÊS	CDI	ANO	CDI	12 MESES	CDI
LF BTG PACTUAL 05 ANOS - VENC. 31.03.2027	R$	43.332.156,21	0,87%	0,80%	1,97%	1,78%	10,80%	12,72%
LF BTG PACTUAL 10 ANOS - VENC. 31.03.2032	R$	43.713.442,60	0,90%	0,80%	2,05%	1,78%	11,31%	12,72%
TOTAL	R$	87.045.598,81						
% TOTAL DA CARTEIRA		5,56%						

FUNDOS CRÉDITO PRIVADO			MÊS	CDI	ANO	CDI	12 MESES	CDI
SECURITY FI REFERENCIADO DI LP	R$	843.621,78	0,47%	0,80%	1,09%	1,78%	7,86%	12,72%
BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO	R$	51.732.226,15	1,28%	0,80%	2,67%	1,78%	16,54%	12,72%
BRADESCO PERFORMANCE INSTITUCIONAL CP	R$	28.779.354,72	0,93%	0,80%	2,17%	1,78%	14,45%	12,72%
PIATÃ FI RENDA FIXA	R$	5.344.567,78	-0,32%	0,80%	-0,56%	1,78%	-1,86%	12,72%
TOTAL	R$	86.699.770,43						
% TOTAL DA CARTEIRA		5,54%						

FIDC's			MÊS	CDI	ANO	CDI	12 MESES	CDI
BBIF MASTER FIDC LP	R$	5.567.352,70	-0,50%	0,80%	-0,87%	1,78%	-4,65%	12,72%
BVA MASTER FIDC MULTISETORIAL SÊNIOR	R$	118.980,01	15,12%	0,80%	-	-	-	-
BVA MASTER II FIDC MULTISETORIAL SÊNIOR	R$	89.549,36	15,17%	0,80%	-	-	-	-
FIDC MULTISETORIAL ITALIA	R$	1.661.832,72	0,71%	0,80%	-	-	-	-
TOTAL	R$	7.437.714,79						
% TOTAL DA CARTEIRA		0,48%						

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790

FUNDOS DE AÇÕES								
			MÊS	IBOV	ANO	IBOV	12 MESES	IBOV
XP INVESTOR FI AÇÕES	R$	32.465.087,50	1,98%	0,99%	-0,49%	-3,85%	28,79%	22,94%
XP INVESTOR 30 FICFI AÇÕES	R$	27.807.905,82	2,22%	0,99%	0,07%	-3,85%	29,36%	22,94%
TARPON GT 30 FIC FIA	R$	60.217.371,82	2,24%	0,99%	-4,06%	-3,85%	49,41%	22,94%
CAIXA AÇÕES VALOR RPPS	R$	101.201.699,92	1,03%	0,99%	-3,15%	-3,85%	21,59%	22,94%
SUL AMÉRICA SELECTION FIC FIA	R$	24.754.487,01	2,80%	0,99%	-5,87%	-3,85%	1,75%	22,94%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	R$	42.045.020,88	2,90%	0,99%	1,37%	-3,85%	50,26%	22,94%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA (BTG)	R$	23.192.709,92	2,89%	0,99%	1,36%	-3,85%	49,31%	22,94%
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FICFI	R$	47.893.274,23	2,81%	0,99%	0,46%	-3,85%	17,30%	22,94%
TOTAL	R$	359.577.557,10						
% TOTAL DA CARTEIRA		22,99%						

FIP's								
			MÊS	CDI	ANO	CDI	12 MESES	CDI
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP	-R$	180.083,20	-0,20%	0,80%	-	-	-	-
BTG - INFRAESTRUTURA II	R$	224.655,09	-5,70%	0,80%	-	-	-	-
BTG - ECONOMIA REAL FIP	R$	30.458.793,02	-0,16%	0,80%	-0,34%	1,78%	16,13%	12,72%
BTG - ECONOMIA REAL II FIP	R$	3.582.111,79	-2,18%	0,80%	-4,59%	1,78%	-20,48%	12,72%
BTG - FIP IMPACTO	R$	22.196.284,26	0,10%	0,80%	-0,13%	1,78%	9,83%	12,72%
BTG PACTUAL - INFRAESTRUTURA DIVIDENDOS - FIP	R$	14.912.600,60	3,42%	0,80%	10,31%	1,78%	62,64%	12,72%
CAIXA FIP LOGÍSTICA	R$	758,75	-	-	-	-	-	-
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII	R$	3.905.160,06	-2,28%	0,80%	-2,28%	1,78%	-	-
VINCI CAPITAL PARTNERS III	R$	13.683.829,32	-0,02%	0,80%	-0,12%	1,78%	6,26%	12,72%
VINCI STRATEGIC PARTNERS I	R$	6.487.109,31	14,90%	0,80%	14,20%	1,78%	7,53%	12,72%
KINEA PRIVATE EQUITY IV FIP	R$	8.675.383,51	3,04%	0,80%	2,87%	1,78%	6,02%	12,72%
KINEA PRIVATE EQUITY V FIP	R$	11.566.527,67	-0,52%	0,80%	-1,33%	1,78%	-16,30%	12,72%
TOTAL	R$	115.513.130,18						
% TOTAL DA CARTEIRA		7,38%						

FUNDO IMOBILIÁRIO								
			MÊS	CDI	ANO	CDI	12 MESES	CDI
BR HOTÉIS FII	R$	14.057.920,19	0,04%	0,80%	0,04%	1,78%	-0,40%	12,72%
TOTAL	R$	14.057.920,19						
% TOTAL DA CARTEIRA		0,90%						

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR								
			MÊS	MSCI ACWI	ANO	MSCI ACWI	12 MESES	MSCI ACWI
MS GLOBAL OPPORTUNITIES IE	R$	50.016.817,68	8,42%	4,79%	12,80%	7,79%	38,33%	15,81%
LEGG MASON MARTIN CURRIE GLOBAL IE	R$	16.497.532,03	9,02%	4,79%	13,22%	7,79%	18,08%	15,81%
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FIC FIM IE	R$	14.108.682,17	3,51%	4,79%	3,42%	7,79%	1,76%	15,81%
MS US GROWTH FIC FIA IE	R$	18.401.392,84	10,80%	4,79%	6,09%	7,79%	28,29%	15,81%
WESTERN ASSET BDR NÍVEL I	R$	48.149.870,34	7,85%	4,79%	14,61%	7,79%	40,95%	15,81%
TOTAL	R$	147.174.295,06						
% TOTAL DA CARTEIRA		9,41%						

TÍTULOS DA DÍVIDA AGRÁRIA								
			MÊS	CDI	ANO	CDI	12 MESES	CDI
TÍTULOS DA DÍVIDA AGRÁRIA	R$	450.492,02	0,51%	0,80%	1,21%	1,78%	10,57%	12,72%
TOTAL	R$	450.492,02						
% TOTAL DA CARTEIRA		0,03%						

TOTAL	R$	1.564.303.443,50
TOTAL	R$	1.564.303.443,50

TOTAL DA CARTEIRA **R$ 1.564.303.443,50**

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790

FUNDOS DE INVESTIMENTOS EM PARTICIPAÇÕES – FIP – ART. 10º, II

	CAPITAL COMPROMETIDO	%COMPROMETIDO/ CARTEIRA	CAPITAL APLICADO	CAPITAL RETORNADO	SALDO
BTG INFRA II	R$ 10.000.000,00		R$ 4.910.000,28	R$ 13.181.375,77	R$ 224.655,09
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP	R$ 15.000.000,00		R$ 15.000.000,01	R$ 197.953,31	R$ 30.458.793,02
BTG PACTUAL - INFRAESTRUTURA DIVIDENDOS - FIP	R$ 12.416.752,78		R$ 12.416.752,78	R$ 7.631.742,66	R$ 14.912.600,60
BTG PACTUAL - FIP IMPACTO	R$ 27.116.859,94		R$ 20.324.000,72	R$ 478.860,16	R$ 22.196.284,26
KINEA PRIVATE EQUITY IV FIP	R$ 7.500.000,00		R$ 6.821.913,00	R$ 2.467.248,04	R$ 8.675.383,51
VINCI CAPITAL PARTNERS III	R$ 10.000.000,00	15,50%	R$ 9.470.887,47	R$ -	R$ 13.683.829,32
VINCI STRATEGIC PARTNERS I	R$ 25.000.000,00		R$ 5.474.729,56	R$ 439.465,42	R$ 6.487.109,31
KINEA PRIVATE EQUITY V FIP	R$ 50.000.000,00		R$ 14.414.463,84	R$ -	R$ 11.566.527,67
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP	R$ 60.000.000,00		R$ 4.504.540,86	R$ -	R$ 3.582.111,79
PÁTRIA VII	R$ 20.000.000,00		R$ 4.222.227,00	R$ -	R$ 3.905.160,06
BTG INFRA III	R$ 20.000.000,00		R$ -	R$ -	R$ -
TOTAL	R$ 257.033.612,72		R$ 97.559.515,52	R$ 24.396.645,36	R$ 115.692.454,63

FUNDO DE INVESTIMENTOS EM PARTICIPAÇÕES	APLICAÇÃO INICIAL	TIR - Desde o início do fundo			
		Mensal	Anualizada	Acumulada	IPCA + (Anualizado)
BTG INFRA II	jun/13	1,82%	24,22%	929,35%	17,31%
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP	out/20	2,41%	33,15%	165,98%	24,10%
BTG PACTUAL - INFRAESTRUTURA DIVIDENDOS - FIP	nov/20	1,84%	24,47%	107,46%	16,10%
BTG PACTUAL - FIP IMPACTO	ago/21	0,51%	6,24%	16,93%	-0,26%
KINEA PRIVATE EQUITY IV FIP	mai/18	1,42%	18,37%	167,41%	11,98%
VINCI CAPITAL PARTNERS III	dez/18	1,21%	15,55%	113,57%	9,18%



Os fundos tratados nesse artigo apresentam fluxos de caixa diferentes de fundos tradicionais. O desembolso da aplicação se dá de forma gradual, ao longo de um período, na medida em que o fundo conclui novas operações de aquisição, e o capital também retorna de forma gradual, na medida em que o fundo realiza desinvestimentos ou na medida em que recebe dividendos das empresas investidas. Por conta disso, utilizamos o cálculo da TIR (Taxa Interna de Retorno) para que possamos avaliar a rentabilidade do fundo, levando em consideração esses fluxos de caixa inconstantes.

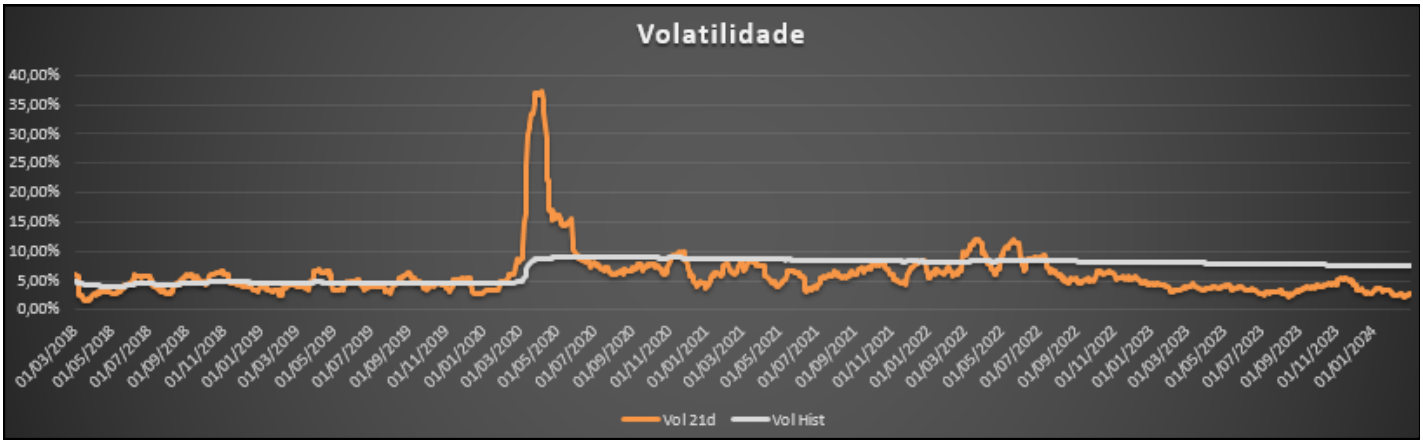
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790



GESTÃO DE RISCOS

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790

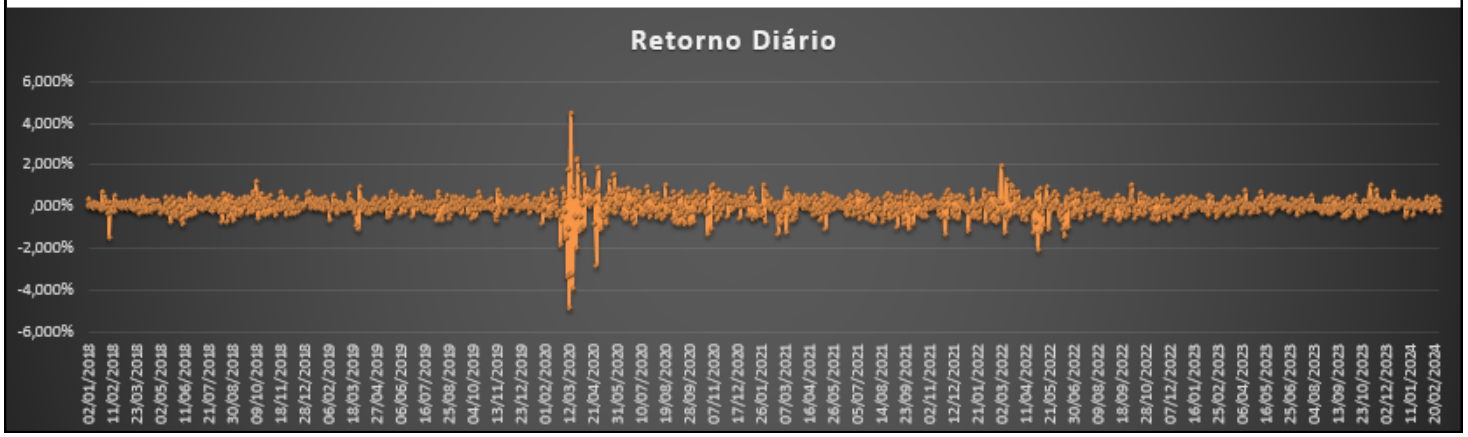
VOLATILIDADE



No gráfico acima, a linha branca representa a volatilidade histórica da carteira do plano previdenciário, medida a partir de janeiro de 2018. A linha laranja representa a volatilidade da carteira para uma média móvel dos últimos 21 dias. Do gráfico infere- se que a volatilidade da carteira ultrapassou seus valores históricos nos meses de março a maio de 2020, período no qual a pandemia de Coronavírus ainda era uma grande incerteza assoladora dos mercados financeiros em todo o mundo.

RETORNO DIÁRIO

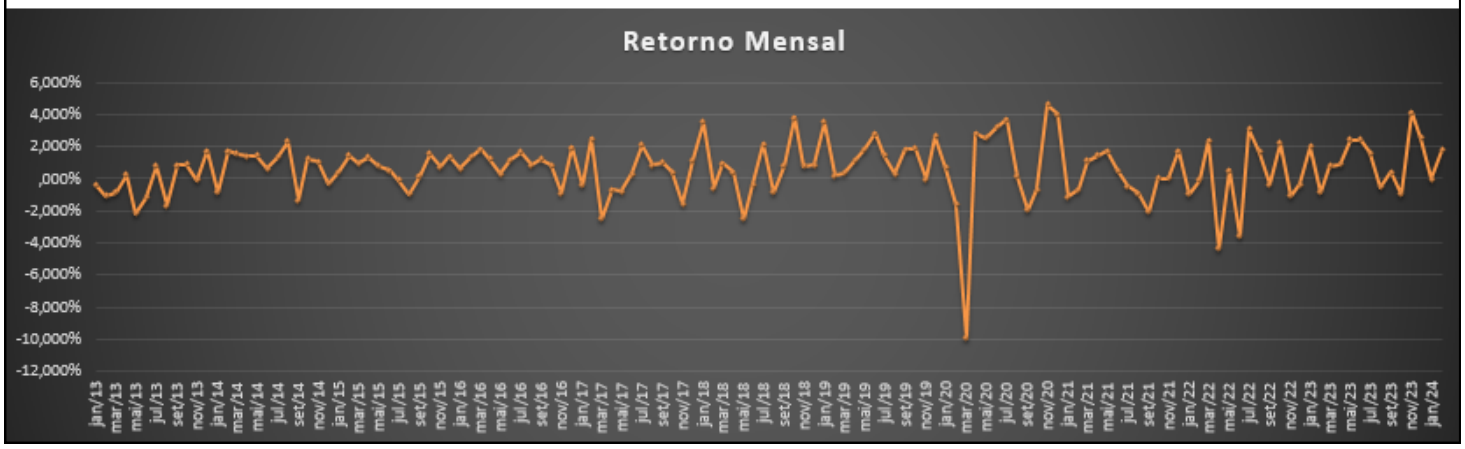
Retorno Diário		
Maior Retorno Diário	4,47%	13/03/2020
Menor Retorno Diário	-4,87%	12/03/2020
Retorno Médio Diário	0,03%	
VaR Histórico - 95%	-0,75%	-R$ 11.667.963,42



DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790

RETORNO MENSAL

Retorno Mensal		
Maior Retorno Mensal	4,63%	nov/20
Menor Retorno Mensal	-9,93%	mar/20
Retorno Médio Mensal	0,61%	



Os dados acima informam as oscilações do retorno diário para a carteira da MANAUSPREV. Percebe-se a elevação da oscilação a partir do início da pandemia de Coronavírus no Brasil. Considerando os dados desde janeiro de 2018, o maior retorno para um único dia foi de 4,47%, o pior retorno diário foi de -4,87%.

Com a mesma metodologia descrita no gráfico de retorno diário, neste apresenta- se o maior retorno obtido em um único mês (4,63%), enquanto a pior rentabilidade mensal foi de -9,93%, ocorrida no mês de março/2020, no auge das incertezas relacionadas à pandemia de Coronavírus.

LIQUIDEZ

Tabela de Liquidez			
De 0 a 30 dias (Limite 100%)	R$	933.980.951,99	56,3%
De 31 a 365 dias (Limite 50%)	R$	-	0,0%
Acima de 365 dias (Limite 60%)	R$	723.898.294,33	43,7%
Total	R$	1.657.879.246,32	100,00%

A tabela de liquidez mostra a relação entre o percentual da carteira e o seu respectivo nível de liquidez. Neste caso, 56,3% da carteira de investimentos da Manaus Previdência possui liquidez de até 30 dias, ou seja, a maior parte dos ativos financeiros pode ser resgatada e monetizada dentro desse período.

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790

EXECUÇÃO DA POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

A tabela abaixo descreve os limites de aplicação, por artigo, da Resolução CMN nº 4.963/2021, conforme aqueles autorizados pela política de investimentos da Manaus Previdência para o exercício corrente. A coluna "Pró-Gestão" descreve os limites máximos permitidos para os RPPS que possuem a certificação institucional em nível IV do Pró-Gestão, como a Manaus Previdência.

LIMITES DA RESOLUÇÃO CMN 4963/2021											
TIPOS DE ATIVOS				PRÓ-GESTÃO NÍVEL IV			CARTEIRA ATUAL			POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
RENDA FIXA	TÍTULOSPÚBLICOS	Títulos Públicos de emissão do TN	Art 7º, I, a		100%	100%		29,62%	61,62%	20%	32,00%	75%
	FUNDOS DE INVESTIMENTO	Fundos 100% Títulos Públicos	Art 7º, I, b		100%			8,45%		0%	8,00%	50%
		Fundos Renda fixa em geral	Art 7º, III, a		80%			12,62%		0%	8,00%	60%
		Títulos de Instituição Financeira	Art 7º, IV		20%			5,25%		0%	5,00%	20%
		FIDCs - Aberto ou Fechado- Cota Sênior	Art 7º, V, a	35%	20%		5,68%	0,45%		0%	0,50%	5%
		Fundos Renda fixa - Crédito Privado	Art 7º, V, b		20%			5,23%		0%	4,50%	20%
RENDA VARIÁVEL	FUNDOS DE INVESTIMENTO	Fundos de Ações em geral	Art 8º, I		50%	60%	6,97%	21,69%	29,50%	0%	25,00%	35%
		Fundos Multimercado	Art 10º, I	20%	15%			0,00%		0%	0,00%	10%
		FIPs (que atendam requisitos governança)	Art 10º, II		15%			6,97%		0%	8,00%	15%
		Fundo Imobiliário	Art 11		20%			0,85%		0%	0,00%	15%
INVESTIMENTO NO EXTERIOR	FUNDOS DE INVESTIMENTO	Fundo de Investimentos - Sufixo I.E.	Art 9º, II	10%	10%	10%	8,88%	5,97%	8,88%	0%	5,00%	10%
		Fundo de Ações - BDR Nível I	Art 9º, III		10%			2,90%		0%	4,00%	10%
EMPRÉSTIMOS	CONSIGNADOS	Empréstimos Consignados	Art 12	10%	10%	10%	0,00%	0,00%	0,00%	0%	0,00%	10%



DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790

RELAÇÃO DE GESTORES DOS RECURSOS DA MANAUS PREVIDÊNCIA

Gestor	Manausprev	% Manausprev	ANBIMA	% ANBIMA
Tesouro Nacional	R$ 491.046.889,55	29,62%	-	-
BTG PACTUAL	R$ 262.320.613,85	15,82%	R$ 364.844.910.000,00	0,07%
Caixa	R$ 177.902.322,43	10,73%	R$ 510.382.270.000,00	0,03%
Banco do Brasil	R$ 152.805.524,86	9,22%	R$ 1.559.153.730.000,00	0,01%
XP	R$ 110.289.811,00	6,65%	R$ 149.113.570.000,00	0,07%
GUEPARDO	R$ 65.237.730,80	3,94%	R$ 4.060.700.000,00	1,61%
WESTERN ASSET	R$ 64.647.402,37	3,90%	R$ 41.062.370.000,00	0,16%
J SAFRA	R$ 62.446.368,33	3,77%	R$ 130.511.930.000,00	0,05%
TARPON	R$ 60.217.371,82	3,63%	R$ 6.468.990.000,00	0,93%
ITAÚ UNIBANCO	R$ 49.008.673,87	2,96%	R$ 881.969.420.000,00	0,01%
BRASIL PLURAL	R$ 31.317.531,66	1,89%	R$ 60.122.750.000,00	0,05%
BRADESCO	R$ 30.261.372,96	1,83%	R$ 666.404.170.000,00	0,00%
SUL AMÉRICA	R$ 24.754.487,01	1,49%	R$ 49.373.860.000,00	0,05%
KINEA	R$ 20.241.911,18	1,22%	R$ 144.639.400.000,00	0,01%
VINCI	R$ 20.170.938,63	1,22%	R$ 52.278.630.000,00	0,04%
MAG	R$ 14.108.682,17	0,85%	R$ 12.770.390.000,00	0,11%
GRAPHEN	R$ 14.057.920,19	0,85%	R$ 623.220.000,00	2,26%
PÁTRIA	R$ 3.905.160,06	0,24%	R$ 44.933.410.000,00	0,01%
VILA RICA	R$ 1.661.832,72	0,10%	R$ 3.987.780.000,00	0,04%
SECURITY	R$ 843.621,78	0,05%	R$ 3.620.570.000,00	0,02%
BRZ Investimentos	R$ 633.079,08	0,04%	R$ 2.553.410.000,00	0,02%
TOTAL	R$ 1.657.879.246,32	100,00%		

RELAÇÃO DE ADMINISTRADORES DOS RECURSOS DA MANAUS PREVIDÊNCIA

Administrador	Manausprev	% Manausprev	ANBIMA	% ANBIMA
Tesouro Nacional	R$ 491.046.889,55	29,62%	-	-
BTG PACTUAL	R$ 292.000.433,08	17,61%	R$ 741.470.400.000,00	0,04%
Caixa	R$ 177.902.322,43	10,73%	R$ 635.502.300.000,00	0,03%
Banco do Brasil	R$ 152.805.524,86	9,22%	R$ 1.559.935.000.000,00	0,01%
BNP PARIBAS	R$ 147.174.295,06	8,88%	R$ 88.209.900.000,00	0,17%
BANCO DAYCOVAL	R$ 102.262.392,70	6,17%	R$ 49.571.800.000,00	0,21%
SAFRA	R$ 62.446.368,33	3,77%	R$ 128.032.700.000,00	0,05%
ITAÚ UNIBANCO	R$ 49.008.673,87	2,96%	R$ 799.440.900.000,00	0,01%
BEM DTVM	R$ 38.438.316,33	2,32%	R$ 515.536.300.000,00	0,01%
XP	R$ 36.370.247,56	2,19%	R$ 118.595.600.000,00	0,03%
SANTANDER	R$ 33.375.258,52	2,01%	R$ 438.680.600.000,00	0,01%
BRADESCO	R$ 30.261.372,96	1,83%	R$ 587.042.600.000,00	0,01%
RJI	R$ 13.877.836,99	0,84%	R$ 8.403.400.000,00	0,17%
INTRAG	R$ 11.566.527,67	0,70%	R$ 680.442.500.000,00	0,00%
LIONS TRUST	R$ 8.675.383,51	0,52%	R$ 33.072.200.000,00	0,03%
GENIAL	R$ 5.553.097,15	0,33%	R$ 83.187.700.000,00	0,01%
BNY MELLON	R$ 2.819.393,95	0,17%	R$ 353.040.000.000,00	0,00%
BRL DTVM	R$ 1.661.832,72	0,10%	R$ 400.316.200.000,00	0,00%
INTRADER	R$ 633.079,08	0,04%	R$ 2.147.000.000,00	0,03%
TOTAL	R$ 1.595.828.334,53	100,00%		

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790

RELAÇÃO ANALÍTICA DOS ATIVOS DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO RPPS

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS	%		FEVEREIRO	Gestor	Credenciamento	Administrador	Credenciamento
FI RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS - Art 7º, I, a	**29,62%**	**R$**	**491.046.889,55**				
TÍTULOS DA DÍVIDA AGRÁRIA	0,03%	R$	450.492,02	Tesouro Nacional		Tesouro Nacional	
NTN-B - 15.08.2030 (Curva) - 18.08.2021	3,33%	R$	55.161.547,69	Tesouro Nacional		Tesouro Nacional	
NTN-B - 15.08.2030 (Curva) - 08.09.2021	2,91%	R$	48.215.204,17	Tesouro Nacional		Tesouro Nacional	
NTN-B - 15.05.2045 (Curva) - 26.07.2022	5,16%	R$	85.485.150,07	Tesouro Nacional		Tesouro Nacional	
NTN-B - 15.05.2045 (Curva) - 06.07.2023	1,14%	R$	18.920.254,90	Tesouro Nacional		Tesouro Nacional	
NTN-B - 15.08.2050 (Curva) - 05.07.2023	1,82%	R$	30.173.322,15	Tesouro Nacional		Tesouro Nacional	
NTN-B - 15.05.2055 (Curva) - 05.07.2023	1,87%	R$	31.013.947,50	Tesouro Nacional		Tesouro Nacional	
NTN-B - 15.05.2055 (Curva) - 11.10.2023	3,08%	R$	51.015.840,34	Tesouro Nacional		Tesouro Nacional	
NTN-B - 15.08.2060 (Curva) - 15.08.2022	3,23%	R$	53.467.617,44	Tesouro Nacional		Tesouro Nacional	
NTN-F - 01.01.2027 (Curva) - 06.08.2021	1,03%	R$	17.046.296,23	Tesouro Nacional		Tesouro Nacional	
NTN-F - 01.01.2027 (Curva) - 20.08.2021	1,03%	R$	17.146.359,12	Tesouro Nacional		Tesouro Nacional	
NTN-F - 01.01.2031 (Curva) - 08.09.2021	2,57%	R$	42.571.603,34	Tesouro Nacional		Tesouro Nacional	
NTN-F - 01.01.2031 (Curva) - 25.10.2021	2,44%	R$	40.379.254,58	Tesouro Nacional		Tesouro Nacional	
FI RENDA FIXA TITULOS PUBLICOS - Art 7º, I, b	**8,45%**	**R$**	**140.092.555,59**				
BTG PACTUAL TESOURO SELIC DI	0,06%	R$	946.323,50	BTG PACTUAL	16.01.2026	BTG PACTUAL	16.01.2026
CAIXA BRASIL IRF-M	4,63%	R$	76.699.863,76	Caixa DTVM	08.03.2024	Caixa	16.01.2026
SAFRA IMA INSTITUCIONAL	3,77%	R$	62.446.368,33	J SAFRA	16.01.2026	SAFRA	16.01.2026
FI RENDA FIXA - Art 7º, III, a	**12,62%**	**R$**	**209.233.814,62**				
BB RPPS FLUXO - ADM PREV	0,09%	R$	1.472.922,88	Banco do Brasil	16.01.2026	Banco do Brasil	16.01.2026
BB RPPS FLUXO - ADIANTAMENTO	0,00%	R$	2.098,06	Banco do Brasil	16.01.2026	Banco do Brasil	16.01.2026
BB RPPS FLUXO - ADM FIN	0,02%	R$	336.669,92	Banco do Brasil	16.01.2026	Banco do Brasil	16.01.2026
BB RPPS FLUXO - FFIN	1,20%	R$	19.817.667,85	Banco do Brasil	16.01.2026	Banco do Brasil	16.01.2026
BB RPPS FLUXO - FPREV	1,52%	R$	25.176.895,11	Banco do Brasil	16.01.2026	Banco do Brasil	16.01.2026
BB PERFIL - ADM PREV	0,37%	R$	6.108.945,67	Banco do Brasil	16.01.2026	Banco do Brasil	16.01.2026
BB PERFIL - ADM FIN	0,01%	R$	147.543,86	Banco do Brasil	16.01.2026	Banco do Brasil	16.01.2026
BB PERFIL - FFIN	3,87%	R$	64.207.936,34	Banco do Brasil	16.01.2026	Banco do Brasil	16.01.2026
BB PERFIL - FPREV	2,14%	R$	35.534.845,17	Banco do Brasil	16.01.2026	Banco do Brasil	16.01.2026
BRADESCO DI PREMIUM - ADM PREV	0,09%	R$	1.482.018,24	BRADESCO	16.01.2026	BRADESCO	16.01.2026
BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL	3,09%	R$	51.222.020,63	BTG PACTUAL	16.01.2026	BTG PACTUAL	16.01.2026
ITAÚ ALOC DINÂMICA	0,07%	R$	1.115.399,64	ITAÚ UNIBANCO	16.01.2026	ITAÚ UNIBANCO	16.01.2026
TOP FI RF (ADINVEST TOP)	0,05%	R$	845.945,50	BRASIL PLURAL	16.01.2026	BNY MELLON	16.01.2026
BRASIL RF LP (DIFERENCIAL)	0,04%	R$	633.079,08	BRZ Investimentos	16.01.2026	INTRADER	16.01.2026
FI VITORIA RÉGIA	0,07%	R$	1.129.826,67	BRASIL PLURAL	16.01.2026	BNY MELLON	16.01.2026
TÍTULOS DE INSTITUIÇÃO FINANCEIRA - Art 7º, IV	**5,25%**	**R$**	**87.045.598,81**				
LF BTG PACTUAL 05 ANOS - VENC. 31.03.2027	2,61%	R$	43.332.156,21	BTG PACTUAL	16.01.2026	BTG PACTUAL	16.01.2026
LF BTG PACTUAL 10 ANOS - VENC. 31.03.2032	2,64%	R$	43.713.442,60	BTG PACTUAL	16.01.2026	BTG PACTUAL	16.01.2026
FIDCs - Art 7º, V, a	**0,45%**	**R$**	**7.437.714,79**				
BBIF MASTER FIDC LP	0,34%	R$	5.567.352,70	BRASIL PLURAL	16.01.2026	SANTANDER	16.01.2026
BVA MASTER FIDC MULTISETORIAL SÊNIOR	0,01%	R$	118.980,01	BRASIL PLURAL	16.01.2026	GENIAL	16.01.2026
BVA MASTER II FIDC MULTISETORIAL SÊNIOR	0,01%	R$	89.549,36	BRASIL PLURAL	16.01.2026	GENIAL	16.01.2026
FIDC MULTISETORIAL ITALIA	0,10%	R$	1.661.832,72	VILA RICA	16.01.2024	BRL DTVM	16.01.2026
FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO - Art 7º, V, b	**5,23%**	**R$**	**86.699.770,43**				
BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO	3,12%	R$	51.732.226,15	BTG PACTUAL	16.01.2026	BTG PACTUAL	16.01.2026
BRADESCO PERFORMANCE INSTITUCIONAL CP	1,74%	R$	28.779.354,72	BRAM	16.01.2026	BRADESCO	16.01.2026
SECURITY FI REFERENCIADO DI LP	0,05%	R$	843.621,78	SECURITY	16.01.2026	BNY MELLON	16.01.2026
PIATÃ FI RENDA FIXA	0,32%	R$	5.344.567,78	BRASIL PLURAL	16.01.2026	GENIAL	16.01.2026
FI DE RENDA VARIÁVEL - Art 8º, I	**21,69%**	**R$**	**359.577.557,10**				
CAIXA AÇÕES VALOR RPPS	6,10%	R$	101.201.699,92	Caixa DTVM	08.03.2024	Caixa	16.01.2026
XP INVESTOR FI AÇÕES	1,96%	R$	32.465.087,50	XP	16.01.2026	XP CCTVM	08.11.2025
XP INVESTOR 30 FICFI AÇÕES	1,68%	R$	27.807.905,82	XP	16.01.2026	SANTANDER	16.01.2026
SUL AMÉRICA SELECTION FIC FIA	1,49%	R$	24.754.487,01	SUL AMÉRICA	16.01.2026	BEM DTVM	16.01.2026
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	2,54%	R$	42.045.020,88	GUEPARDO	17.11.2024	Banco Daycoval	16.01.2026
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA (BTG)	1,40%	R$	23.192.709,92	GUEPARDO	17.11.2024	BTG PACTUAL	16.01.2026
TARPON GT 30 FIC FIA	3,63%	R$	60.217.371,82	TARPON	16.01.2026	Banco Daycoval	16.01.2026
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FICFI	2,89%	R$	47.893.274,23	ITAÚ UNIBANCO	16.01.2026	ITAÚ UNIBANCO	16.01.2026
FI DE RENDA VARIÁVEL - Art 9º, II	**5,97%**	**R$**	**99.024.424,72**				
MS GLOBAL OPPORTUNITIES IE	3,02%	R$	50.016.817,68	XP ALLOCATION ASSET	25.07.2024	BNP PARIBAS	16.01.2026
LEGG MASON MARTIN CURRIE GLOBAL IE	1,00%	R$	16.497.532,03	WESTERN ASSET	16.01.2026	BNP PARIBAS	16.01.2026
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FIC FIM IE	0,85%	R$	14.108.682,17	MAG	26.04.2024	BNP PARIBAS	16.01.2026
MS US GROWTH FIC FIA IE	1,11%	R$	18.401.392,84	PLURAL INVESTIMENTOS	26.04.2024	BNP PARIBAS	16.01.2026
FI DE RENDA VARIÁVEL - Art 9º, III	**2,90%**	**R$**	**48.149.870,34**				
WESTERN ASSET BDR NÍVEL I	2,90%	R$	48.149.870,34	WESTERN ASSET	16.01.2026	BNP PARIBAS	16.01.2026
FI DE RENDA VARIÁVEL - Art 10º, II	**6,97%**	**R$**	**115.513.130,18**				
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP	-0,01%	-R$	180.083,20	BRASIL PLURAL	16.01.2026	RJI	16.01.2026
BTG - INFRAESTRUTURA II	0,01%	R$	224.655,09	BTG PACTUAL	16.01.2026	BTG PACTUAL	16.01.2026
BTG - ECONOMIA REAL FIP	1,84%	R$	30.458.793,02	BTG PACTUAL	16.01.2026	BTG PACTUAL	16.01.2026
BTG - ECONOMIA REAL II FIP	0,22%	R$	3.582.111,79	BTG PACTUAL	16.01.2026	BTG PACTUAL	16.01.2026
BTG - FIP IMPACTO	1,34%	R$	22.196.284,26	BTG PACTUAL	16.01.2026	BTG PACTUAL	16.01.2026
BTG PACTUAL - INFRAESTRUTURA DIVIDENDOS - FIP	0,90%	R$	14.912.600,60	BTG PACTUAL	16.01.2026	BTG PACTUAL	16.01.2026
CAIXA FIP LOGÍSTICA	0,00%	R$	758,75	Caixa	16.01.2026	Caixa	16.01.2026
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII	0,24%	R$	3.905.160,06	PÁTRIA	12.09.2025	XP CCTVM	08.11.2025
VINCI CAPITAL PARTNERS III	0,83%	R$	13.683.829,32	Vinci	16.01.2026	BEM DTVM	16.01.2026
VINCI STRATEGIC PARTNERS I	0,39%	R$	6.487.109,31	Vinci	16.01.2026	BTG PACTUAL	16.01.2026
KINEA PRIVATE EQUITY IV FIP	0,52%	R$	8.675.383,51	KINEA	16.01.2026	LIONS TRUST	16.01.2026
KINEA PRIVATE EQUITY V FIP	0,70%	R$	11.566.527,67	KINEA	16.01.2026	INTRAG	16.01.2026
FI DE RENDA VARIÁVEL - Art 11	**0,85%**	**R$**	**14.057.920,19**				
BR HOTÉIS FII	0,85%	R$	14.057.920,19	GRAPHEN	16.01.2026	RJI	16.01.2026
TOTAL	**100%**	**R$**	**1.657.879.246,32**				

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790



COMITÊ DE INVESTIMENTOS

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790

ÚLTIMAS DELIBERAÇÕES

Em fevereiro, o Comitê de Investimentos da Manaus Previdência reuniu-se com representantes da Morgan Stanley, para falar sobre o cenário atual de investimentos no exterior e performance dos fundos geridos pela Asset. Na última reunião do mês, o Comitê recebeu o representante da gestora Guepardo Investimentos, que falou sobre o desempenho do fundo em 2023 e detalhou as posições da carteira para o ano de 2024.

Com relação às movimentações na carteira, foram recebidos recursos referentes ao pagamento de juros semestrais das NTN-B 2030, NTN-B 2050 e NTN-B 2060, amortizações do FIDC Multisetorial Master II e dividendos dos FIP´s BTG Infra II e BTG Impacto.

Durante o mês de fevereiro, não houve deliberação do comitê sobre movimentação da carteira de investimentos, restando apenas realocações de recursos entre os fundos de caixa BB RPPS FLUXO e BB RPPS PERFIL.



DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790



CONCEITOS IMPORTANTES

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790

CONCEITOS DE CLASSES DE ATIVOS

Fundos de Investimentos em Participações – FIP

O Fundo de Investimento em Participações (FIP) é uma comunhão de recursos destinados à aplicação em companhias abertas, fechadas ou sociedades limitadas, em fase de desenvolvimento. Cabe ao administrador constituir o fundo e realizar o processo de captação de recursos junto aos investidores através da venda de cotas. O FIP é um investimento em renda variável constituído sob a forma de condomínio fechado, em que as cotas somente são resgatadas ao término de sua duração ou quando é deliberado em assembleia de cotistas a sua liquidação.

Fundos de Ações (Fundos de Bolsa)

São fundos constituídos com o objetivo de investir no mercado de ações. Portanto, têm como principal fator de risco a variação de preços de ações admitidas à negociação no mercado organizado. Devem investir no mínimo 67% do seu patrimônio em ações admitidas à negociação em mercado organizado ou em ativos relacionados, como bônus ou recibo de subscrição, certificados de depósito de ações, cota de fundos de ações, cotas dos fundos de índice de ações e Brazilian Depositary Receipts (BDR) classificados com nível II e III.

Fundos de Investimento no Exterior

Fundos de investimento no exterior são fundos de investimento que possuem uma carteira com ativos financeiros internacionais. Ou seja, são fundos negociados no mercado local que investem em ações, títulos e demais ativos localizados em mercados estrangeiros. Por força da Resolução CMN nº 4.963/2021, nessa classe também estão contidos os fundos de investimentos BDRs.

Fundos DI

Os fundos DI estão entre os mais populares do mercado, especialmente entre investidores que buscam uma opção para formar uma reserva de emergência. Eles estão incluídos na categoria de fundos de renda fixa, como são classificadas as carteiras que tenham pelo menos 80% do patrimônio aplicado em ativos vinculados à variação da taxa de juros, de índices de preço, ou as duas coisas. A principal característica dos fundos DI é o seu objetivo: acompanhar a taxa do CDI, seu índice de referência.

Títulos Públicos e Fundos de Investimentos Atrelados à Inflação

São títulos de emissão do governo brasileiro cuja rentabilidade esteja indexada à variação do IPCA (NTN-B). Nessa classe também estão os fundos de investimentos cujo patrimônio seja composto majoritariamente por títulos públicos indexados ao IPCA.

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790

Fundos de Renda Fixa

São classificadas nessa categoria as carteiras que tenham pelo menos 80% do patrimônio aplicado em ativos vinculados à variação da taxa de juros, de índices de preço, ou as duas coisas. Para terem esse tipo de exposição, os fundos de investimento aplicam, basicamente, em títulos de renda fixa. De maneira simplificada, quem compra esses títulos na verdade "empresta" dinheiro, em troca de receber juros no futuro.

Fundos de Crédito Privado

Um fundo de crédito privado é uma aplicação cuja maior parte da carteira está aplicada em títulos emitidos por bancos ou empresas, os chamados títulos privados. Os títulos de crédito privado são aplicações de renda fixa e, assim como os títulos públicos, podem ser prefixados (quando o rendimento é conhecido no momento da aplicação) ou pós-fixados (quando o rendimento acompanha algum índice de mercado, como a Selic ou o CDI).

Fundos de Investimentos em Direitos Creditórios – FIDCs

O Fundo de Investimento em Direitos Creditórios - FIDC é um veículo de securitização de recebíveis e um tipo de fundo de investimento caracterizado pela aquisição de direitos creditórios. Ele é geralmente definido como uma "comunhão de recursos", por configurar- se juridicamente como um condomínio, no qual os investidores são detentores de cotas.

Fundos de Investimentos Imobiliários – FII

Um fundo imobiliário é uma espécie de "condomínio" de investidores, que reúnem seus recursos para que sejam aplicados em conjunto no mercado imobiliário. A dinâmica mais tradicional é que o dinheiro seja usado na construção ou na aquisição de imóveis, que depois sejam locados ou arrendados. Os ganhos obtidos com essas operações são divididos entre os participantes, na proporção em que cada um aplicou.

Fundos Multimercado

Os multimercados podem aplicar em diferentes mercados (renda fixa, câmbio e, ações, entre outros), além de usar derivativos para proteção da carteira. Eles preveem uma maior liberdade de gestão e buscam oferecer aos investidores um rendimento mais alto que em aplicações conservadoras.

Títulos Públicos Prefixados

Títulos de emissão do governo brasileiro e com rentabilidade predefinida.

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790

CONCEITOS DE INDICADORES DE DESEMPENHO E RISCO

Índice de Sharpe

O Índice de Sharpe é um indicador que leva em consideração a relação entre duas variáveis de grande importância nos investimentos: Risco e Retorno. Esse índice mostra a eficiência do gestor de um fundo de investimento, por exemplo, ao apresentar o quanto de risco a mais ele precisa se expor para obter mais rendimento. Ao ser necessário assumir mais risco para alcançar um mesmo rendimento de um investimento menos arriscado, admite-se que a eficiência nesse caso está comprometida.

VaR

O VaR, ou Value at Risk, é um indicador de risco que estima a perda potencial máxima de um investimento para um período de tempo, com um determinado intervalo de confiança. Ou seja, através de um cálculo estatístico, o VaR mostra a exposição ao risco financeiro que um ou mais ativos possuem em determinado dia, semana ou mês.

Liquidez

Liquidez, em contabilidade, corresponde à velocidade e facilidade com a qual um ativo pode ser convertido em caixa. Por exemplo: ouro é um ativo relativamente líquido, pois pode ser rapidamente vendido; uma instalação fabril não o é. Na realidade, a liquidez possui duas dimensões: facilidade de conversão versus perda de valor. Qualquer ativo pode ser convertido em caixa rapidamente, desde que se reduza suficientemente o preço.

Volatilidade

A volatilidade é uma medida estática que mede o risco de um ativo, de acordo com a intensidade e frequência de sua oscilação de preço em um determinado período.
Por meio dela, é possível entender o histórico de um ativo, qual a probabilidade de ele subir ou cair, de acordo com o período preestabelecido, e qual será a estimativa de oscilação do seu preço no futuro. Se o preço de um ativo for muito volátil, por exemplo, é sinal de que sua cotação, em relação às flutuações do mercado, oscila muito, tornando sua compra arriscada, mas, por outro lado, proporciona maior possibilidade de lucro no curtíssimo prazo

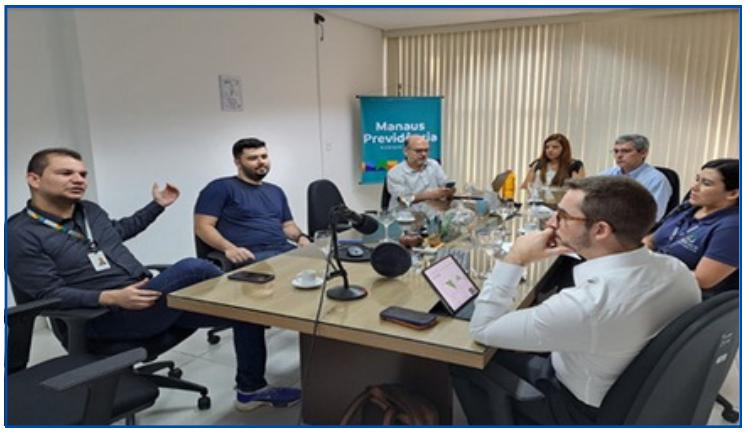
Índice de Treynor

O índice de Treynor mede qual a média de rendimentos global, considerando a contribuição de cada ativo na carteira de investimentos. Por meio do cálculo do índice, é possível analisar concretamente qual investimento traz mais retorno considerando os riscos envolvidos. Isso permite ao investidor identificar qual ativo é mais eficiente e como deve ser a diversificação das aplicações na carteira ou fundo de investimento. Vale ressaltar que a carteira de investimentos pode ser composta de diferentes ativos com retornos variados. Para calcular o Índice de Treynor, portanto, é necessário entender o impacto de cada retorno na carteira como um todo, para chegar ao valor médio total.

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790

PARTICIPANTES DO PROCESSO DE INVESTIMENTOS

Comitê de Investimentos



Carlos Michael Maia Rodrigues
Eduardo Alves Marinho
Eli Camilo Custódio
Fernando Krichanã dos Santos
Flávio Rodrigues de Castro
Jânio José Paes Guimarães
Marcelo Magaldi Alves

Conselho Municipal de Previdência

Marcelo Magaldi Alves
Daniela Cristina Benayon
Vanessa Cardoso Carneiro
Rosiane de Brito Guedes
Rossicleide Fonseca Lucilene
Florêncio Viana Darlen da
Silva Monteiro Cláudia
Serique e Silva



Conselho Fiscal



Suani dos Santos Braga
Maria Enertina Ramos
Ruth Freire de Souza
Izomitel Pessoa Filho
Eli Camilo Custódio
Elizangela de Macedo

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790

Manaus Previdência
Autarquia Municipal

Prefeitura de Manaus

O Relatório de Investimentos do mês de fevereiro de 2024 foi deliberado e aprovado pelo Comitê de Investimentos em 08/04/2024, por meio de votação virtual realizada em aplicativo de mensagem.



DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790

:: PORTFÓLIOS E ATIVOS

29/02/2024

Resumo

12 meses

Nome	Retorno (%)				VaR	Volatilidade
	Mês	Ano	06 meses	12 meses		
TÍTULOS PÚBLICOS - 7, I, A	0,95	1,99	5,27	-	-	-
NTN-B 2030 (CURVA) - COMPRA 08.09.2021	0,93	1,89	4,72	9,60	0,14%	0,29%
NTN-B 2030 (CURVA) - COMPRA 18.08.2021	0,93	1,88	4,70	9,56	0,14%	0,29%
NTN-B 2045 (CURVA) - COMPRA 26.07.2022	1,04	2,13	5,49	11,21	0,14%	0,29%
NTN-B 2050 (Curva) - COMPRA 05.07.2023	0,99	2,01	5,12	-	-	-
NTN-B 2055 (CURVA) - COMPRA 05.07.2023	0,99	2,01	5,12	10,43	0,14%	0,29%
NTN-B 2055 (CURVA) - COMPRA 11.10.2023	1,02	2,07	5,31	10,83	0,14%	0,29%
NTN-B 2060 (CURVA) - COMPRA 15.08.2022	1,02	2,08	5,32	10,85	0,14%	0,29%
NTN-F 2027 (Curva) - Compra 06.08.2021	0,68	1,58	4,72	9,56	0,04%	0,09%
NTN-F 2027 (Curva) - Compra 20.08.2021	0,75	1,73	5,19	10,55	0,05%	0,10%
NTN-F 2031 (Curva) - Compra 08.09.2021	0,79	1,89	5,53	11,16	0,09%	0,18%
NTN-F 2031 (CURVA) - COMPRA 25.10.2021	0,90	2,17	6,36	12,90	0,10%	0,20%
TÍTULO DA DÍVIDA AGRÁRIA - T.D.A.	0,51	1,21	3,92	10,44	0,91%	1,93%

Retorno Mensal (%)

Nome	fev/24	jan/24	dez/23	nov/23	out/23	set/23	ago/23	jul/23	jun/23	mai/23	abr/23	mar/23
TÍTULOS PÚBLICOS - 7, I, A	0,95	1,04	0,82	0,72	0,74	0,72	0,78	-	-	-	-	-
NTN-B 2030 (CURVA) - COMPRA 08.09.2021	0,93	0,94	0,74	0,61	0,63	0,61	0,65	0,39	0,37	0,97	0,87	1,38
NTN-B 2030 (CURVA) - COMPRA 18.08.2021	0,93	0,94	0,74	0,61	0,62	0,61	0,64	0,38	0,37	0,96	0,87	1,38
NTN-B 2045 (CURVA) - COMPRA 26.07.2022	1,04	1,07	0,86	0,73	0,75	0,73	0,78	0,51	0,49	1,10	0,98	1,52
NTN-B 2050 (Curva) - COMPRA 05.07.2023	0,99	1,01	0,80	0,67	0,69	0,68	0,72	-	-	-	-	-
NTN-B 2055 (CURVA) - COMPRA 05.07.2023	0,99	1,01	0,80	0,67	0,69	0,68	0,71	0,45	0,44	1,03	0,92	1,45
NTN-B 2055 (CURVA) - COMPRA 11.10.2023	1,02	1,04	0,83	0,70	0,72	0,70	0,75	0,48	0,47	1,07	0,95	1,48
NTN-B 2060 (CURVA) - COMPRA 15.08.2022	1,02	1,05	0,83	0,70	0,72	0,71	0,75	0,48	0,47	1,07	0,95	1,49
NTN-F 2027 (Curva) - Compra 06.08.2021	0,68	0,89	0,72	0,72	0,76	0,72	0,83	0,76	0,76	0,79	0,65	0,83
NTN-F 2027 (Curva) - Compra 20.08.2021	0,75	0,97	0,79	0,79	0,83	0,79	0,91	0,83	0,83	0,87	0,71	0,91
NTN-F 2031 (Curva) - Compra 08.09.2021	0,79	1,09	0,83	0,83	0,87	0,83	0,95	0,87	0,87	0,91	0,75	0,95
NTN-F 2031 (CURVA) - COMPRA 25.10.2021	0,90	1,25	0,95	0,95	1,00	0,95	1,09	1,00	1,00	1,05	0,86	1,09
TÍTULO DA DÍVIDA AGRÁRIA - T.D.A.	0,51	0,69	0,58	0,60	0,68	0,64	0,83	0,69	0,75	0,80	0,57	2,67
CDI	0,80	0,97	0,90	0,92	1,00	0,97	1,14	1,07	1,07	1,12	0,92	1,17
IPCA	0,83	0,42	0,56	0,28	0,24	0,26	0,23	0,12	-0,08	0,23	0,61	0,71

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, esultar 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 or 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 ndável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.

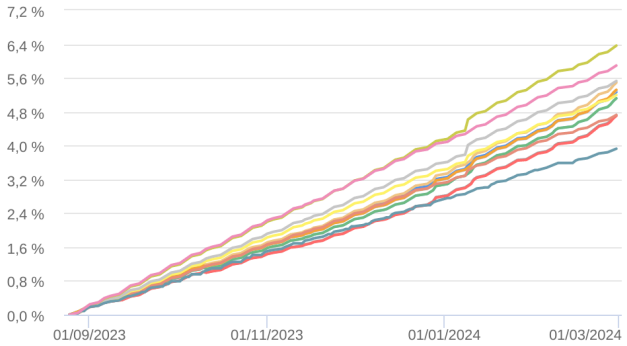
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790

:: PORTFÓLIOS E ATIVOS

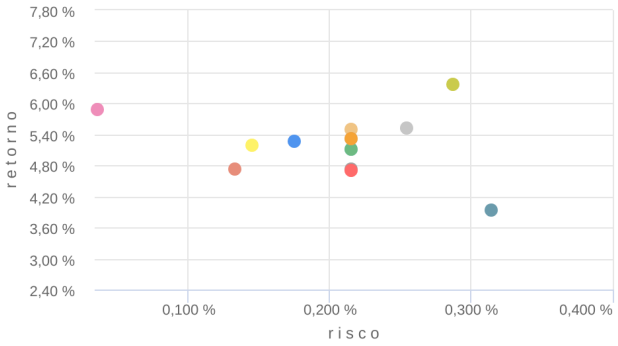
29/02/2024

Gráficos

Retorno Acumulado - 28/08/2023 a 29/02/2024 (diária)



Risco x Retorno - 28/08/2023 a 29/02/2024 (diária)



TÍTULOS PÚBLICOS - 7, I, A
NTN-B 2030 (CURVA) - COMPRA 08.09.2021
NTN-B 2030 (CURVA) - COMPRA 18.08.2021
NTN-B 2045 (CURVA) - COMPRA 26.07.2022
NTN-B 2050 (Curva) - COMPRA 05.07.2023
NTN-B 2055 (CURVA) - COMPRA 05.07.2023
NTN-B 2055 (CURVA) - COMPRA 11.10.2023
NTN-B 2060 (CURVA) - COMPRA 15.08.2022
NTN-F 2027 (Curva) - Compra 06.08.2021
NTN-F 2027 (Curva) - Compra 20.08.2021
NTN-F 2031 (Curva) - Compra 08.09.2021
NTN-F 2031 (CURVA) - COMPRA 25.10.2021
TÍTULO DA DÍVIDA AGRÁRIA - T.D.A.
CDI

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, esultar 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 ɔr 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 ıdável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790

:: PORTFÓLIOS E ATIVOS

29/02/2024

Resumo

12 meses

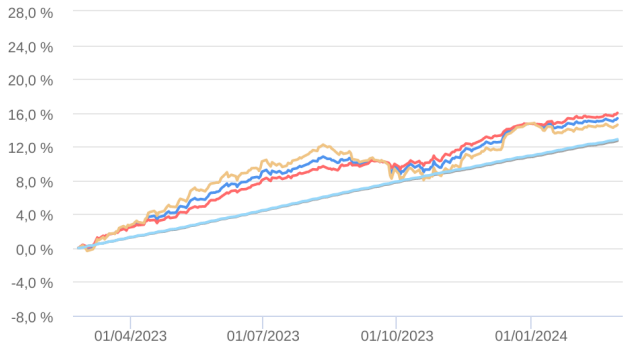
Nome	Retorno (%)				Sharpe	VaR	Volatilidade
	Mês	Ano	06 meses	12 meses			
FI RENDA FIXA TITULOS PUBLICOS - Art 7º, I, b	0,46	0,57	4,52	15,33	0,73	1,44%	3,03%
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,79	1,75	5,81	12,68	-2,67	0,03%	0,06%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,43	1,11	5,70	15,98	1,18	1,11%	2,33%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	0,48	-0,10	3,09	14,57	0,38	1,98%	4,16%

Retorno Mensal (%)

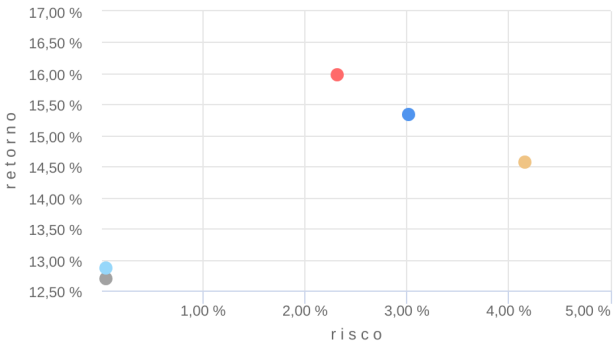
Nome	fev/24	jan/24	dez/23	nov/23	out/23	set/23	ago/23	jul/23	jun/23	mai/23	abr/23	mar/23
FI RENDA FIXA TITULOS PUBLICOS - Art 7º, I, b	0,46	0,11	2,05	2,62	-0,15	-0,38	0,18	0,81	2,20	2,42	1,58	2,35
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,79	0,96	0,89	0,90	0,97	0,97	1,14	1,05	1,08	1,13	0,88	1,15
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,43	0,67	1,46	2,47	0,35	0,15	0,73	0,88	2,10	2,20	1,08	2,12
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	0,48	-0,57	2,76	2,82	-0,76	-1,02	-0,49	0,72	2,33	2,69	2,19	2,64
CDI	0,80	0,97	0,90	0,92	1,00	0,97	1,14	1,07	1,07	1,12	0,92	1,17
IMA-B	0,55	-0,45	2,75	2,62	-0,66	-0,95	-0,38	0,81	2,39	2,53	2,02	2,66
IMA-B 5	0,59	0,68	1,46	1,80	-0,31	0,13	0,61	0,97	1,05	0,57	0,90	1,52
IMA-B 5+	0,51	-1,47	3,94	3,39	-0,98	-1,92	-1,27	0,73	3,37	4,13	3,03	3,73
IRF-M	0,46	0,67	1,48	2,47	0,37	0,17	0,76	0,89	2,12	2,20	1,10	2,15
IRF-M 1	0,76	0,83	0,91	1,00	0,96	0,93	1,15	1,07	1,19	1,14	0,86	1,23
IRF-M 1+	0,34	0,60	1,73	3,14	0,12	-0,15	0,59	0,82	2,65	2,85	1,25	2,67

Gráficos

Retorno Acumulado - 27/02/2023 a 29/02/2024 (diária)



Risco x Retorno - 27/02/2023 a 29/02/2024 (diária)



- FI RENDA FIXA TITULOS PUBLICOS - Art 7º, I, b
- BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI
- CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP
- SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA
- CDI

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, esultar 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 ɔr 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 ıdável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790

:: PORTFÓLIOS E ATIVOS

29/02/2024

Resumo

12 meses

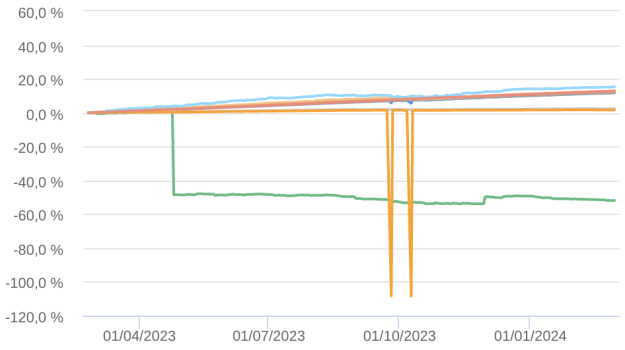
Nome	Retorno (%)				Sharpe	VaR	Volatilidade
	Mês	Ano	06 meses	12 meses			
FI RENDA FIXA - Art 7º, III, a	0,70	1,51	4,64	11,96	-0,22	1,58%	3,33%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,73	1,61	5,36	11,73	-19,22	0,02%	0,05%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,80	1,78	5,89	12,87	0,15	0,03%	0,06%
BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	0,74	1,58	4,52	12,84	-0,01	0,54%	1,13%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,56	1,04	4,62	15,35	0,78	1,36%	2,86%
RECUPERAÇÃO BRASIL FI RENDA FIXA LP	-1,80	-5,18	-4,38	-51,91	-1,33	23,76%	50,03%
TOP FI RENDA FIXA	-0,07	0,13	0,33	2,26	-30,73	0,15%	0,32%
VITÓRIA RÉGIA FI RENDA FIXA LP	-0,08	0,04	0,17	1,60	-1,54	879,91%	1.853,10%

Retorno Mensal (%)

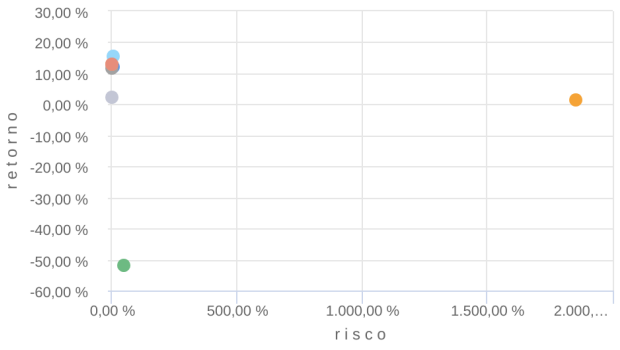
Nome	fev/24	jan/24	dez/23	nov/23	out/23	set/23	ago/23	jul/23	jun/23	mai/23	abr/23	mar/23
FI RENDA FIXA - Art 7º, III, a	0,70	0,80	1,04	1,23	0,50	0,17	1,07	1,01	1,34	1,34	0,59	1,35
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,73	0,88	0,82	0,83	0,90	0,90	1,05	0,98	1,00	1,04	0,83	1,08
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,80	0,97	0,90	0,91	0,99	0,97	1,16	1,06	1,09	1,15	0,89	1,16
BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	0,74	0,84	1,11	1,26	0,43	-0,03	1,15	1,06	1,45	1,44	1,15	1,43
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,56	0,48	1,61	2,60	-0,21	-0,30	0,37	0,90	2,22	2,35	1,23	2,43
RECUPERAÇÃO BRASIL FI RENDA FIXA LP	-1,80	-3,45	1,00	8,88	-2,86	-3,79	-3,32	-1,14	0,68	-0,27	-48,77	0,63
TOP FI RENDA FIXA	-0,07	0,20	0,12	0,14	-0,05	0,12	0,19	0,34	0,33	0,38	0,13	0,37
VITÓRIA RÉGIA FI RENDA FIXA LP	-0,08	0,12	0,06	0,06	-0,11	0,14	0,22	0,26	0,25	0,29	0,05	0,31
CDI	0,80	0,97	0,90	0,92	1,00	0,97	1,14	1,07	1,07	1,12	0,92	1,17

Gráficos

Retorno Acumulado - 27/02/2023 a 29/02/2024 (diária)



Risco x Retorno - 27/02/2023 a 29/02/2024 (diária)



- FI RENDA FIXA - Art 7º, III, a
- BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO
- BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP
- BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP
- ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA
- RECUPERAÇÃO BRASIL FI RENDA FIXA LP
- TOP FI RENDA FIXA
- VITÓRIA RÉGIA FI RENDA FIXA LP
- CDI

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, esultar 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 or 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 ldável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790

:: PORTFÓLIOS E ATIVOS

29/02/2024

Resumo

12 meses

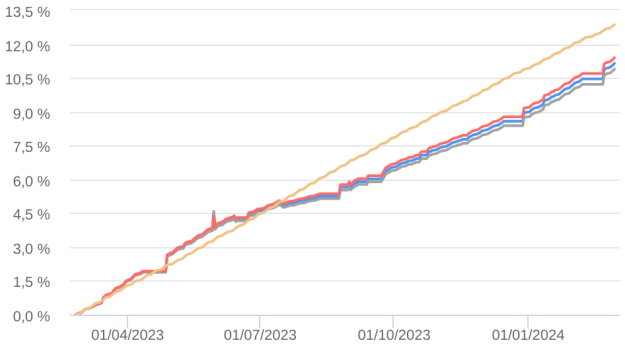
Nome	Retorno (%)				Sharpe	VaR	Volatilidade
	Mês	Ano	06 meses	12 meses			
TÍTULOS PRIVADOS - Art 7º, IV	0,88	2,01	5,20	11,14	-1,07	0,68%	1,43%
LF BTG PACTUAL 05 ANOS - VENC. 31.03.2027	0,87	1,97	5,08	10,89	-1,12	0,74%	1,57%
LF BTG PACTUAL 10 ANOS - VENC. 31.03.2032	0,90	2,05	5,32	11,40	-0,99	0,62%	1,31%

Retorno Mensal (%)

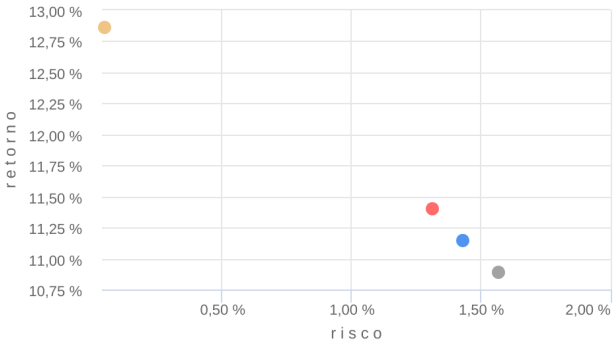
Nome	fev/24	jan/24	dez/23	nov/23	out/23	set/23	ago/23	jul/23	jun/23	mai/23	abr/23	mar/23
TÍTULOS PRIVADOS - Art 7º, IV	0,88	1,11	0,75	0,73	0,78	0,71	0,68	0,43	0,74	1,19	1,11	1,41
LF BTG PACTUAL 05 ANOS - VENC. 31.03.2027	0,87	1,09	0,74	0,71	0,76	0,69	0,66	0,41	0,72	1,17	1,10	1,38
LF BTG PACTUAL 10 ANOS - VENC. 31.03.2032	0,90	1,13	0,77	0,75	0,80	0,73	0,70	0,45	0,76	1,21	1,13	1,43
CDI	0,80	0,97	0,90	0,92	1,00	0,97	1,14	1,07	1,07	1,12	0,92	1,17
IPCA	0,83	0,42	0,56	0,28	0,24	0,26	0,23	0,12	-0,08	0,23	0,61	0,71

Gráficos

Retorno Acumulado - 27/02/2023 a 29/02/2024 (diária)



Risco x Retorno - 27/02/2023 a 29/02/2024 (diária)



- TÍTULOS PRIVADOS - Art 7º, IV
- LF BTG PACTUAL 05 ANOS - VENC. 31.03.2027
- LF BTG PACTUAL 10 ANOS - VENC. 31.03.2032
- CDI

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, esultar 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 ɔr 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 ıdável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790

:: PORTFÓLIOS E ATIVOS

29/02/2024

Resumo

12 meses

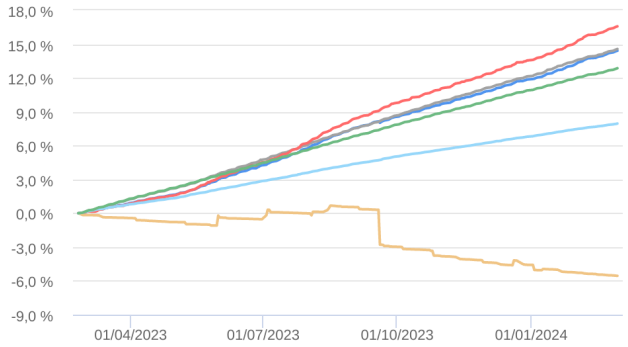
Nome	Retorno (%)				Sharpe	VaR	Volatilidade
	Mês	Ano	06 meses	12 meses			
FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO - Art 7º, V, b	1,06	2,25	6,68	14,41	3,93	0,17%	0,35%
BRADESCO PERFORMANCE INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	0,93	2,17	6,84	14,57	8,25	0,09%	0,18%
BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	1,28	2,67	8,01	16,57	7,26	0,21%	0,45%
PIATÃ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO LP	-0,32	-1,02	-6,08	-5,55	-5,13	1,64%	3,46%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	0,47	1,09	3,60	7,95	-29,39	0,07%	0,15%

Retorno Mensal (%)

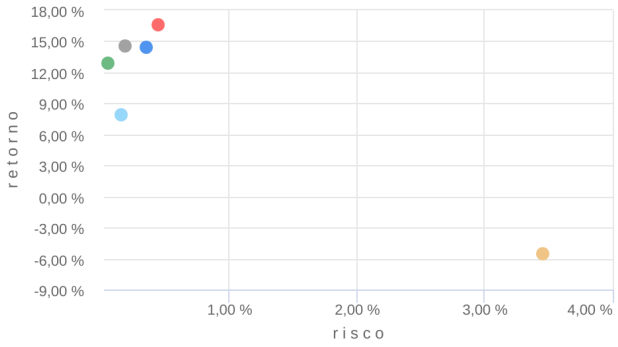
Nome	fev/24	jan/24	dez/23	nov/23	out/23	set/23	ago/23	jul/23	jun/23	mai/23	abr/23	mar/23
FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO - Art 7º, V, b	1,06	1,18	0,97	0,99	1,04	0,94	1,67	1,41	1,20	1,39	0,69	0,86
BRADESCO PERFORMANCE INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	0,93	1,22	0,96	1,06	1,17	1,09	1,37	1,22	1,22	1,28	0,92	1,14
BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	1,28	1,36	1,11	1,12	1,18	1,33	1,98	1,63	1,36	1,54	0,68	0,82
PIATÃ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO LP	-0,32	-0,71	-0,23	-0,57	-0,86	-3,51	0,57	0,53	-0,32	0,57	-0,35	-0,27
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	0,47	0,62	0,54	0,56	0,59	0,63	0,75	0,71	0,72	0,80	0,51	0,71
CDI	0,80	0,97	0,90	0,92	1,00	0,97	1,14	1,07	1,07	1,12	0,92	1,17

Gráficos

Retorno Acumulado - 27/02/2023 a 29/02/2024 (diária)



Risco x Retorno - 27/02/2023 a 29/02/2024 (diária)



- FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO - Art 7º, V, b
- BRADESCO PERFORMANCE INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP
- BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP
- PIATÃ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO LP
- SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP
- CDI

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, esultar 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 ɔr 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 ıdável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790

:: PORTFÓLIOS E ATIVOS

29/02/2024

Resumo — 12 meses

Nome	Retorno (%)				Sharpe	VaR	Volatilidade
	Mês	Ano	06 meses	12 meses			
FI RENDA VARIÁVEL - Art 8º, I - Fundo de Ações	2,11	-1,61	12,15	30,42	1,03	7,20%	15,17%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	1,03	-3,15	9,97	20,81	0,50	7,70%	16,22%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2,89	1,36	14,21	49,91	1,68	8,47%	17,84%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2,90	1,37	14,15	50,86	1,73	8,41%	17,72%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	2,81	0,46	16,88	16,33	0,28	6,90%	14,54%
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	2,80	-5,87	-3,16	0,43	-0,43	10,27%	21,63%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	2,24	-4,06	13,39	52,12	1,72	8,73%	18,38%
XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES	2,22	0,07	14,44	28,48	0,95	7,00%	14,74%
XP INVESTOR FI AÇÕES	1,98	-0,49	14,02	27,89	0,91	7,11%	14,98%

Retorno Mensal (%)

Nome	fev/24	jan/24	dez/23	nov/23	out/23	set/23	ago/23	jul/23	jun/23	mai/23	abr/23	mar/23
FI RENDA VARIÁVEL - Art 8º, I - Fundo de Ações	2,11	-3,65	5,88	11,78	-4,38	1,69	-4,18	3,76	8,29	6,53	3,38	-3,12
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	1,03	-4,13	5,87	12,42	-3,93	0,07	-5,14	3,47	8,37	3,70	3,05	-3,48
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2,89	-1,49	2,69	13,15	-3,10	1,50	-3,35	5,32	9,56	10,28	5,91	-1,04
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2,90	-1,49	2,67	13,02	-3,03	1,50	-3,34	5,29	9,55	11,17	5,81	-1,04
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	2,81	-2,29	7,35	13,20	-4,29	-0,20	-4,95	2,61	5,27	0,64	1,33	-3,93
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	2,80	-8,43	4,01	10,48	-7,35	-4,43	-5,61	8,29	5,56	6,33	0,56	-7,17
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	2,24	-6,16	9,85	8,07	-6,04	7,65	-2,13	5,91	10,12	13,28	4,57	-4,07
XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES	2,22	-2,10	5,13	12,28	-3,85	2,33	-4,23	0,79	8,40	5,24	3,06	-1,92
XP INVESTOR FI AÇÕES	1,98	-2,42	5,26	12,52	-3,93	2,31	-4,39	0,80	8,43	5,21	3,10	-1,90
CDI	0,80	0,97	0,90	0,92	1,00	0,97	1,14	1,07	1,07	1,12	0,92	1,17
Ibovespa	0,99	-4,79	5,38	12,54	-2,94	0,71	-5,09	3,27	9,00	3,74	2,50	-2,91

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, esultar 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 ɔr 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 ıdável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.

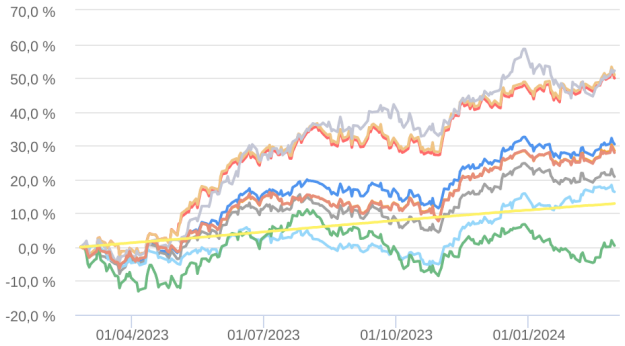
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790

:: PORTFÓLIOS E ATIVOS

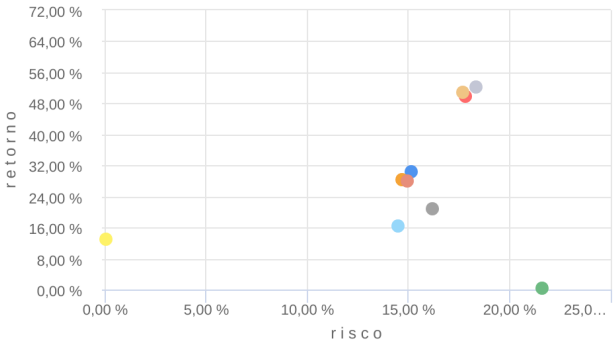
29/02/2024

Gráficos

Retorno Acumulado - 27/02/2023 a 29/02/2024 (diária)



Risco x Retorno - 27/02/2023 a 29/02/2024 (diária)



- FI RENDA VARIÁVEL - Art 8º, I - Fundo de Ações
- CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES
- GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES
- GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES
- ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES
- SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES
- TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES
- XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES
- XP INVESTOR FI AÇÕES
- CDI

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, esultar 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 or 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 ldável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790

:: PORTFÓLIOS E ATIVOS

29/02/2024

Resumo

12 meses

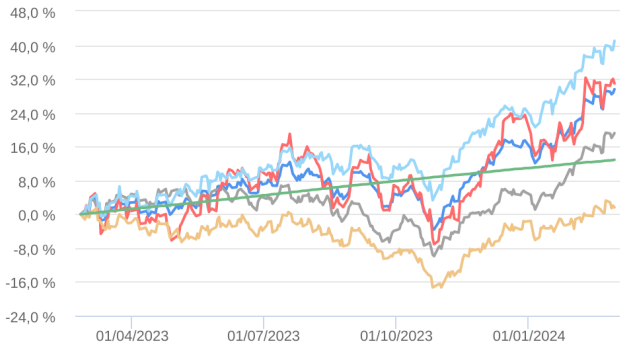
Nome	Retorno (%)				Sharpe	VaR	Volatilidade
	Mês	Ano	06 meses	12 meses			
FI EXTERIOR - Art 9º, II - Investimento no Exterior	8,23	10,15	24,67	29,54	0,87	8,41%	17,71%
FRANKLIN MARTIN CURRIE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	9,02	13,22	20,85	19,17	0,41	7,84%	16,51%
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	10,80	6,09	28,78	30,93	0,66	13,48%	28,39%
MAG GLOBAL SUSTAINABLE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO	3,51	3,42	9,92	1,60	-0,49	8,56%	18,03%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	8,42	12,80	28,86	40,99	1,24	9,26%	19,50%

Retorno Mensal (%)

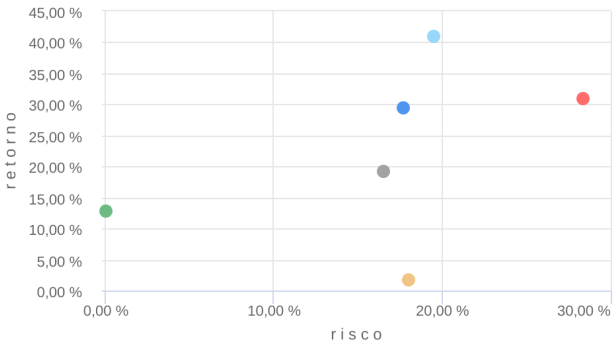
Nome	fev/24	jan/24	dez/23	nov/23	out/23	set/23	ago/23	jul/23	jun/23	mai/23	abr/23	mar/23
FI EXTERIOR - Art 9º, II - Investimento no Exterior	8,23	1,78	5,82	12,13	-5,69	-4,48	-0,66	3,13	0,30	6,58	-2,54	1,28
FRANKLIN MARTIN CURRIE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	9,02	3,84	4,57	8,85	-3,70	-6,76	-1,37	0,40	-1,62	0,24	0,67	3,81
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	10,80	-4,25	11,65	14,65	-9,79	-3,03	-4,99	5,48	4,02	12,68	-6,90	-1,26
MAG GLOBAL SUSTAINABLE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO	3,51	-0,10	5,62	11,34	-7,96	-6,19	-0,93	1,62	-3,24	4,72	-3,17	-1,89
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	8,42	4,04	4,02	12,46	-4,04	-3,77	1,35	3,57	0,56	6,84	-1,71	2,41
Dólar	0,60	2,32	-1,91	-2,41	1,00	1,74	3,80	-1,61	-5,43	1,90	-1,57	-2,45
MSCI World (Moeda Original)	4,11	1,14	4,81	9,21	-2,97	-4,45	-2,55	3,29	5,93	-1,25	1,59	2,83

Gráficos

Retorno Acumulado - 27/02/2023 a 29/02/2024 (diária)



Risco x Retorno - 27/02/2023 a 29/02/2024 (diária)



- FI EXTERIOR - Art 9º, II - Investimento no Exterior
- FRANKLIN MARTIN CURRIE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES
- GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES
- MAG GLOBAL SUSTAINABLE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO
- MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES
- CDI

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, esultar 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 ır 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 ıdável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790

:: PORTFÓLIOS E ATIVOS

29/02/2024

Resumo

12 meses

Nome	Retorno (%)				Sharpe	VaR	Volatilidade
	Mês	Ano	06 meses	12 meses			
FI EXTERIOR - Art 9º, III - BDR	7,85	14,61	27,12	42,66	1,55	7,57%	15,95%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	7,85	14,61	27,12	42,66	1,55	7,57%	15,95%

Retorno Mensal (%)

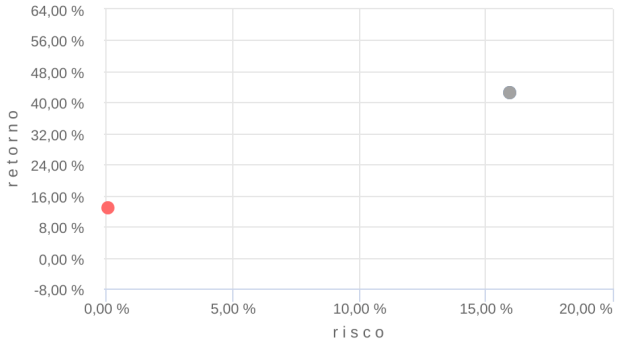
Nome	fev/24	jan/24	dez/23	nov/23	out/23	set/23	ago/23	jul/23	jun/23	mai/23	abr/23	mar/23
FI EXTERIOR - Art 9º, III - BDR	7,85	6,27	2,77	8,83	0,19	-5,03	3,20	0,59	0,74	7,09	-0,70	3,90
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	7,85	6,27	2,77	8,83	0,19	-5,03	3,20	0,59	0,74	7,09	-0,70	3,90
MSCI World (Moeda Original)	4,11	1,14	4,81	9,21	-2,97	-4,45	-2,55	3,29	5,93	-1,25	1,59	2,83

Gráficos

Retorno Acumulado - 27/02/2023 a 29/02/2024 (diária)



Risco x Retorno - 27/02/2023 a 29/02/2024 (diária)



- FI EXTERIOR - Art 9º, III - BDR
- WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I
- CDI

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, esultar 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 ɔr 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 ıdável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES EM 09/04/2024 10:42:58
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES EM 09/04/2024 09:25:22
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82132790



REGISTROS DE ASSINATURAS ELETRÔNICAS

O arquivo rmifevereiro2024comanexos.pdf do documento **2024.17848.17919.9.008469** foi assinado pelos signatários

DADOS DO SIGNATÁRIO	DADOS DA ASSINATURA
FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO 704.239.202-78	08/04/2024 15:38:05 (LOGIN E SENHA)
ELI CAMILO CUSTÓDIO 163.051.322-91	08/04/2024 15:42:24 (LOGIN E SENHA)
EDUARDO ALVES MARINHO 931.181.472-53	08/04/2024 16:10:09 (LOGIN E SENHA)
MARCELO MAGALDI ALVES 313.785.362-15	08/04/2024 16:12:37 (LOGIN E SENHA)
FERNANDO KRICHANA DOS SANTOS 664.106.492-15	08/04/2024 16:53:48 (LOGIN E SENHA)
CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES 892.972.102-87	09/04/2024 09:25:22 (LOGIN E SENHA)
JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES 077.200.092-15	09/04/2024 10:42:58 (LOGIN E SENHA)

Manaus Previdência
Autarquia Municipal

Manaus
Prefeitura Municipal

PARECER Nº 04/2024 – COMINV/MANAUS PREVIDÊNCIA

Os membros participantes do Comitê de Investimentos da Manaus Previdência, no desempenho de suas competências de que trata o artigo 9º, inciso I, do **Decreto** Municipal nº 02, de 29 de agosto de 2023, **APROVAM** por meio de votação virtual realizada em aplicativo de mensagem o Relatório Mensal de Investimentos referente ao mês de **fevereiro de 2024.**

Manaus/AM, 08 de abril de 2024.

(Assinaturas registradas eletronicamente)

FLÁVIO RODRIGUES DE CASTRO
Presidente do Comitê de Investimentos

FERNANDO KRICHANÃ DOS SANTOS
Membro do Cominv

CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES
Membro do Cominv

EDUARDO ALVES MARINHO
Membro do Cominv

ELI CAMILO CUSTÓDIO
Membro do Cominv

JÂNIO JOSÉ PAES GUIMARÃES
Membro do Cominv

MARCELO MAGALDI
Membro do Cominv

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 09/04/2024 11:21:22
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: JANIO JOSE PAES GUIMARAES EM 09/04/2024 10:42:59
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 5 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 821832B7



REGISTROS DE ASSINATURAS ELETRÔNICAS

O arquivo parecern04.2024aprovaarmidefevereiro2024.doc.pdf do documento **2024.17848.17919.9.008469** foi assinado pelos signatários

DADOS DO SIGNATÁRIO	DADOS DA ASSINATURA
FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO 704.239.202-78	08/04/2024 15:38:06 (LOGIN E SENHA)
EDUARDO ALVES MARINHO 931.181.472-53	08/04/2024 16:10:10 (LOGIN E SENHA)
MARCELO MAGALDI ALVES 313.785.362-15	08/04/2024 16:12:38 (LOGIN E SENHA)
FERNANDO KRICHANA DOS SANTOS 664.106.492-15	08/04/2024 16:53:49 (LOGIN E SENHA)
CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES 892.972.102-87	09/04/2024 09:25:23 (LOGIN E SENHA)
JANIO JOSÉ PAES GUIMARÃES 077.200.092-15	09/04/2024 10:42:59 (LOGIN E SENHA)
ELI CAMILO CUSTÓDIO 163.051.322-91	09/04/2024 11:21:22 (LOGIN E SENHA)

Manaus Previdência
Autarquia Municipal

Manaus
Prefeitura Municipal

PARECER 06/2024 – CONSELHO FISCAL – COFIS

Os membros participantes da 4ª Reunião Ordinária de 2024 do Conselho Fiscal (COFIS) da Autarquia **MANAUS PREVIDÊNCIA – MANAUSPREV**, ocorrida em 09 de abril de 2024, no desempenho de suas competências de que trata o artigo 3º, inciso VI, alínea f, da Resolução nº 01, de 21 de dezembro de 2023 – COFIS/MANAUS PREVIDÊNCIA, publicada no Diário Oficial do Município de Manaus Edição nº 5730, de 21 de dezembro de 2023, após examinarem o **Relatório Mensal de Investimentos, referente ao mês de fevereiro de 2024**, opinam **FAVORAVELMENTE** pela aprovação, submetendo-o assim, à apreciação dos membros conselheiros do Conselho Municipal de Previdência – CMP.

CONSELHO FISCAL DA MANAUS PREVIDÊNCIA, em Manaus, 09 de abril de 2024.

(Assinado Digital)
SUANI DOS SANTOS BRAGA
Presidente do Conselho Fiscal – COFIS

(Assinado Digital)
MARIA ERNESTINA DA SILVA RAMOS
Membro Conselheiro (a) Titular

(Assinado Digital)
RUTH FREIRE DE SOUZA
Membro Conselheiro (a) Titular

(Assinado Digital)
ELIZANGELA MACHADO DE MACÊDO
Membro Conselheiro (a) Titular

(Assinado Digital)
IZOMITEL PESSOA DE QUEIROZ FILHO
Membro Conselheiro Titular

(Assinado Digital)
ELI CAMILO CUSTÓDIO
Membro Conselheiro Titular

Endereço: Av. Constantino Nery, Nº 2480 Chapada, CEP 69.050-001
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: ELIZANGELA MACHADO DE MACÊDO EM 09/04/2024 15:00:29
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: IZOMITEL PESSOA DE QUEIROZ FILHO EM 09/04/2024 14:06:45
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 58659D6D

Manaus Previdência
Autarquia Municipal

Manaus
Prefeitura Municipal

PARECER Nº 07/2024 – CMP/MANAUS PREVIDÊNCIA

Os membros participantes da 4ª Reunião Ordinária do ano de 2024 do Conselho Municipal de Previdência (CMP) da Manaus Previdência – MANAUSPREV, realizada em 11 de abril de 2024, no desempenho de suas competências de que trata o artigo 2º da Resolução nº 004, DE 21 DE DEZEMBRO DE 2023 – CMP/MANAUS PREVIDÊNCIA, publicada no Diário Oficial do Município de Manaus Edição nº 5730, de mesma data, após examinarem o **Relatório Mensal de Investimentos,** referente ao mês de **fevereiro de 2024**, deliberam por sua **APROVAÇÃO** final.

Manaus/AM, 11 de abril de 2024.

MARCELO MAGALDI ALVES
Presidente do Conselho Municipal de Previdência – CMP

DANIELA CRISTINA DA EIRA CORRÊA BENAYON
Membro Conselheira Titular

VANESSA CARDOSO CARNEIRO
Membro Conselheira Titular

LUCILENE FLORÊNCIO VIANA
Membro Conselheira Titular

ROSIANE DE BRITO GUEDES
Membro Conselheira Titular

ROSSICLEIDE BRANDÃO DA FONSECA
Membro Conselheira Titular

DARLEN DA SILVA MONTEIRO
Membro Conselheiro Titular

CLÁUDIA SERIQUE E SILVA
Membro Conselheira Titular

Endereço: Av. Constantino Nery, Nº 2480 Chapada, CEP 69.050-001
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: LUCILENE FLORÊNCIO VIANA EM 12/04/2024 16:00:52
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: DARLEN DA SILVA MONTEIRO EM 12/04/2024 15:59:48
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 6 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/verifica/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 77766B26



REGISTROS DE ASSINATURAS ELETRÔNICAS

O arquivo do documento **2024.17848.17919.9.008469** foi assinado pelos signatários

DADOS DO SIGNATÁRIO	DADOS DA ASSINATURA
CLÁUDIA SERIQUE E SILVA 567.588.712-15	11/04/2024 14:57:32 (LOGIN E SENHA)
DANIELA CRISTINA DA EIRA CORREA BENAYON 474.482.292-49	11/04/2024 14:59:36 (CERTIFICADO DIGITAL)
ROSSICLEIDE BRANDÃO DA FONSECA 034.316.572-49	11/04/2024 15:01:23 (LOGIN E SENHA)
MARCELO MAGALDI ALVES 313.785.362-15	11/04/2024 17:14:23 (LOGIN E SENHA)
VANESSA CARDOSO CARNEIRO 343.958.222-15	12/04/2024 14:11:46 (LOGIN E SENHA)
ROSIANE DE BRITO GUEDES 618.356.252-15	12/04/2024 15:18:46 (LOGIN E SENHA)
DARLEN DA SILVA MONTEIRO 572.071.782-04	12/04/2024 15:59:48 (LOGIN E SENHA)
LUCILENE FLORÊNCIO VIANA 201.980.942-72	12/04/2024 16:00:52 (LOGIN E SENHA)

ERRATA

Informamos que o mês correto descrito na página 21 (Fundos Problemáticos), é fevereiro.

Assim, onde se lê janeiro, leia-se fevereiro.

Os demais dados do Relatório permanecem inalterados.

gov.br
Documento assinado digitalmente
FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO
Data: 17/04/2024 09:32:02-0300
Verifique em https://validar.iti.gov.br

(*Assinatura digital)*
Flávio Rodrigues de Castro
Superintendente de Investimentos
Presidente do Comitê de Investimentos