ELABORADO POR:

Superintendência de Investimentos

RELATÓRIO MENSAL

JULHO 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: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB



DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB

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 26
Volatilidade | Retorno diário e mensal | Liquidez Execução da Política de Investimentos
Gestores e Administradores da Carteira

COMITÊ DE INVESTIMENTOS 32

CONCEITOS IMPORTANTES 34

PARTICIPANTES DO PROCESSO DE INVESTIMENTOS 38

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB

APRESENTAÇÃO

É com satisfação que apresentamos nosso **Relatório Mensal de Investimentos de Julho 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: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB



CENÁRIO MACROECONÔMICO INTERNACIONAL

EUA

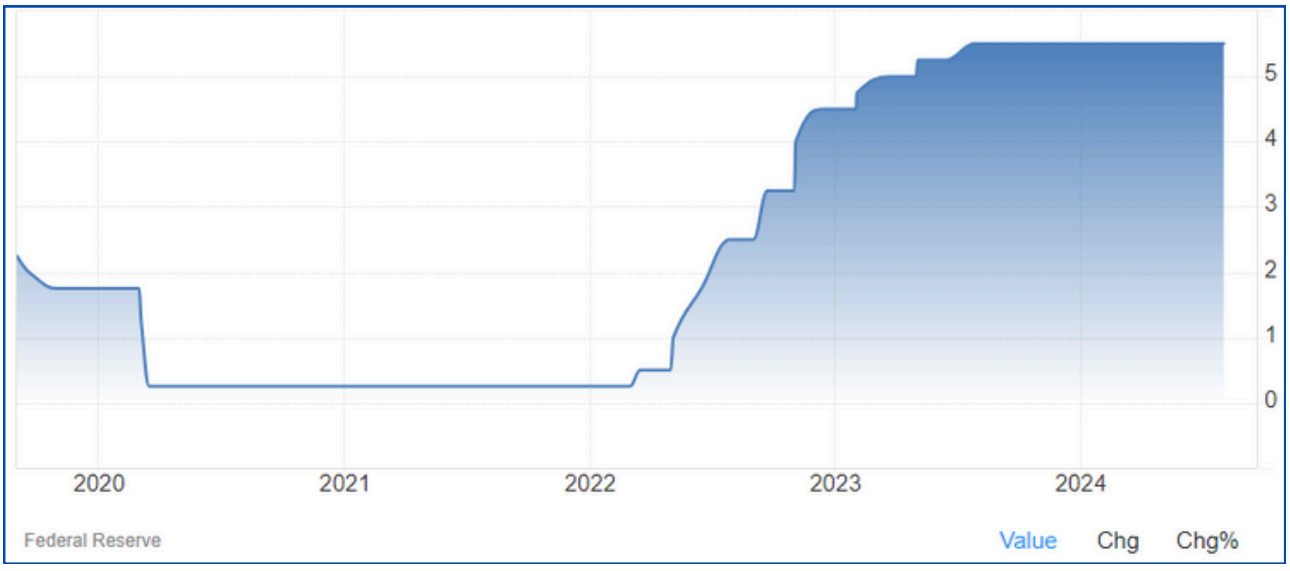
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB

O FOMC decidiu novamente por manter os juros básicos estáveis no intervalo [5,25% a 5,50%] ao ano, em linha com a nossa expectativa do mercado. Com relação à conjuntura econômica, o comunicado realizou uma necessária adequação, reconhecendo os avanços recentes obtidos na direção de um melhor equilíbrio entre os dois objetivos do mandato do FED. Especificamente, o documento novamente indicou que a atividade econômica continuou se expandindo a um ritmo sólido, mas avaliou que os ganhos de empregos "moderaram" e que a "taxa de desemprego subiu" apesar de permanecer baixa. No âmbito da inflação, a avaliação novamente foi de que ela diminuiu ao longo do ano passado, mas permanece "um pouco" elevada, inclusive houve o reconhecimento explícito que nos últimos meses foi observado "algum" progresso adicional em direção ao objetivo do Comitê.

Em conferência, Jerome Powell inclusive revelou que houve uma discussão sobre um possível corte, mas que foi constituída uma forte maioria pela manutenção. Ele também teve que esclarecer que um corte inicial de 50 bps não era algo com o que o comitê estaria considerando e, em linhas gerais, deixou claro que o momento para ajustar juros está próximo. A inflação medida pelo PCE de maio apresentou estabilidade ante o crescimento de 0,1% (M/M) em junho, com estabilidade do índice acumulado em 12 meses em 2,6%, abaixo da projeção de mercado.

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

ESTADOS UNIDOS - TAXA DE JUROS



DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB



CENÁRIO MACROECONÔMICO INTERNACIONAL

EUROPA

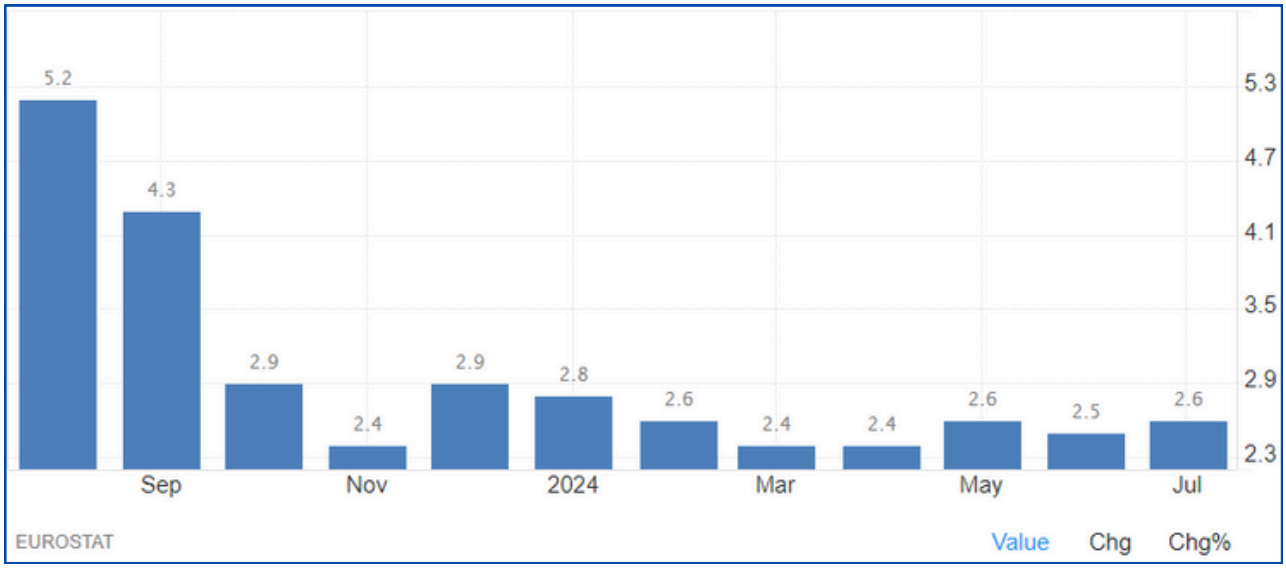
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB

A inflação medida pelo do CPI de junho desacelerou de 2,6% para 2,5% (A/A), em linha com as expectativas de mercado (2,5%). O Banco Central Europeu (BCE) manteve estáveis suas três taxas de juros diretoras, em linha com a expectativa do mercado. Assim, as taxas de juros das operações principais de refinanciamento, de cedência de liquidez e de depósito permaneceram, respetivamente, no patamar de 4,25%, 4,50% e 3,75%. No comunicado, a autoridade monetária justificou que a decisão pelo fato de o cenário seguir corroborando a avaliação da instituição de convergência da inflação para a meta no médio prazo. De acordo com o documento, o Conselho do BCE segue determinado a assegurar o retorno da inflação para o seu objetivo no horizonte de análise e avalia que as taxas diretoras permanecerão suficientemente restritivas durante o tempo que for necessário, sem se comprometer previamente com uma trajetória específica para as taxas.

Mais uma vez, a autoridade monetária apontou que seguirá com uma postura dependente dos dados. Na conferência de imprensa, a presidente do BCE, Christine Lagarde, foi questionada de forma reiterada sobre um eventual corte na reunião de setembro/24. Em suas respostas, indicou que há dados para serem divulgados até lá e que o conselho decide reunião a reunião (meeting by meeting), ressaltando mais de uma vez que não há compromisso prévio com uma trajetória específica para os juros.

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

ZONA DO EURO - TAXA DE INFLAÇÃO



DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB



CENÁRIO MACROECONÔMICO INTERNACIONAL

ÁSIA

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB

O Policy Board do Bank of Japan (BoJ) decidiu, com 7 votos favoráveis e 2 contrários, elevar sua taxa de juros de curto prazo do intervalo [0,0% a 0,1% a.a.] para em torno de 0,25% a.a., mantendo sua política monetária em terreno acomodatício, mas surpreendendo o mercado que esperava pela manutenção. O PBoC (People's Bank of China) informou que reduziu as suas taxas referenciais de empréstimos (Loan Prime Rate - LPR) em 10 bps, com a taxa de um ano passando de 3,45% a.a. para 3,35% a.a. e a de cinco anos passando de 3,95% a.a. para 3,85% a.a. A decisão surpreendeu o mercado cuja mediana das expectativas apontava para a manutenção dos respectivos patamares.

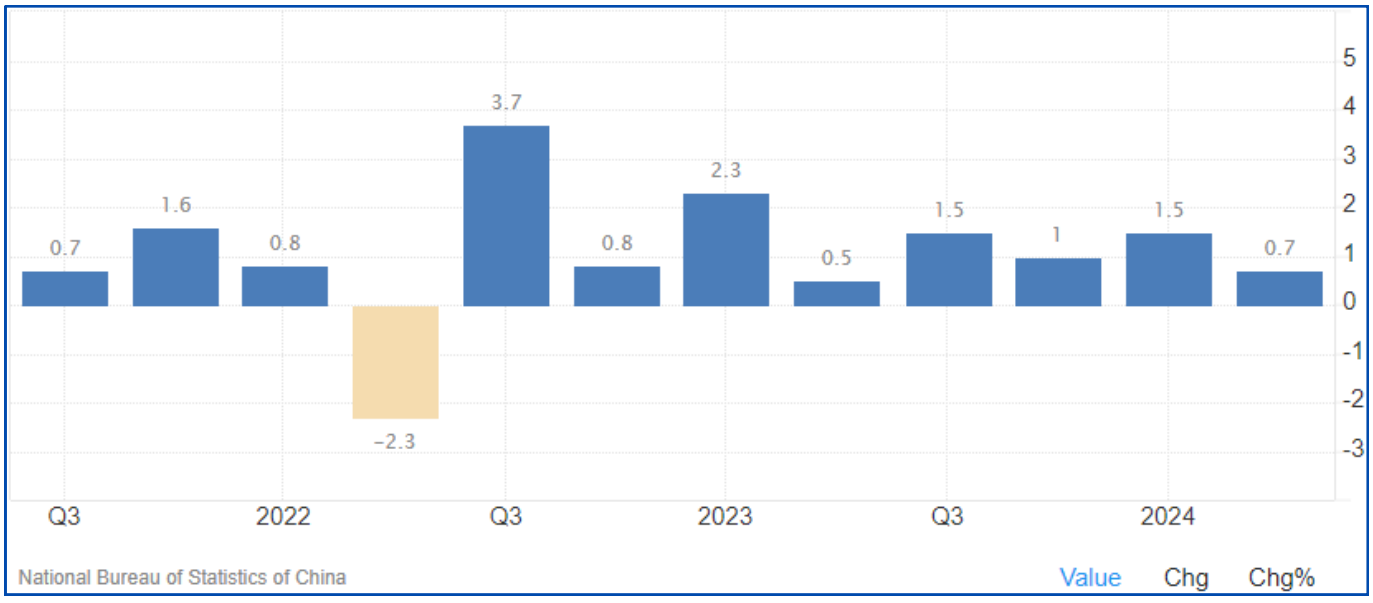
GLOBAL

A tensão no oriente médio aumentou neste mês com um ataque a lideranças do Hamas em solo iraniano, o que reduziu a probabilidade de um cessar-fogo e aumentou o risco de uma escalada para um conflito regional envolvendo Israel e Irã.

Já a guerra da Ucrânia, completou 29 meses, continuando sem perspectivas de novas negociações diplomáticas.

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

CHINA - TAXA DE CRESCIMENTO DO PIB



DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB



CENÁRIO MACROECONÔMICO NACIONAL

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB

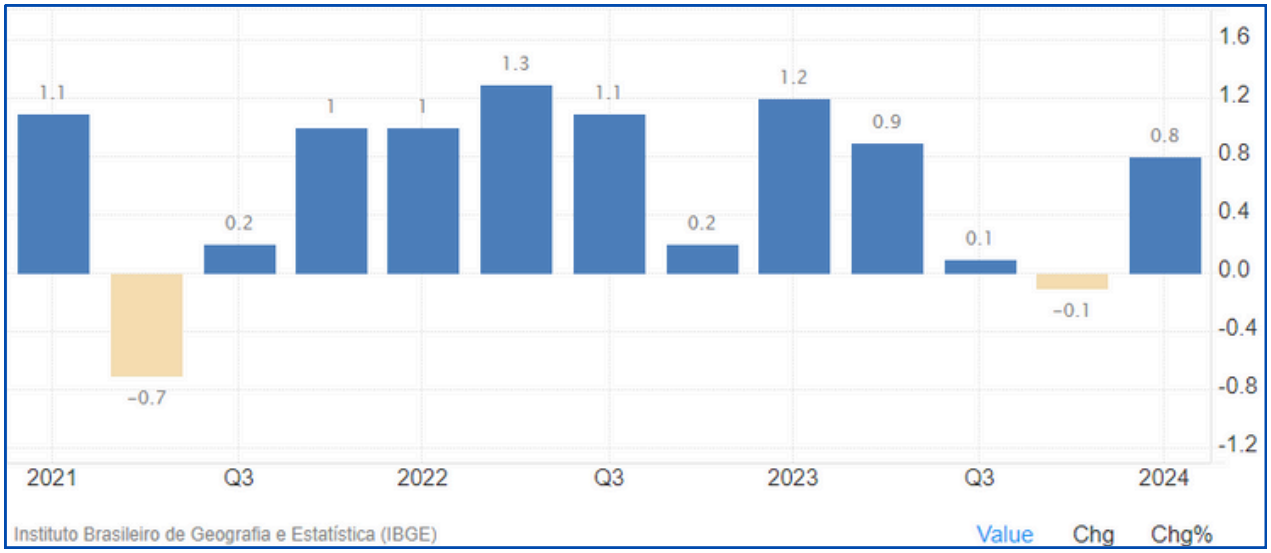
ATIVIDADE ECONÔMICA

Acerca dos indicadores de atividade divulgados em julho: houve melhora generalizada nos dados de confiança e o índice de incerteza recuou 0,3% (M/M). Destaque positivo para a confiança da indústria (3,4%, M/M) e do consumidor (2,0%, M/M). O mercado de trabalho continuou robusto. Nesse sentido, destaque para o saldo de empregos formais de junho, que foi de 201.705 vagas, número melhor que as expectativas. O resultado marcou o sexto mês consecutivo com mais contratações do que demissões e fez o mercado de trabalho fechar o primeiro semestre com 1,3 milhão de novas vagas formais. No mesmo período do ano passado, o saldo de contratações com carteira assinada ficou positivo em 1,0 milhão de postos. Dentre as unidades da federação, apenas o estado do Rio Grande do Sul registrou saldo negativo, refletindo os efeitos negativos do desastre natural ocorrido no sul do país.

Em maio, o IBC-Br avançou 0,2% (M/M), mesmo com as enchentes no estado do Rio Grande do Sul. Entre os setores da atividade econômica, destaque para o varejo restrito (1,2%, M/M) em maio, segmento que vem sendo beneficiado pelo aumento da massa salarial real (9,0% para 9,2%, A/A) e a melhora da confiança. Entre os vetores, destaque para itens mais ligados à renda, tais como (i) Vestuário (2,0%), se beneficiando de melhores preços, (ii) Outros artigos de uso pessoal e doméstico (1,6%) e (iii) Hiper mercados (0,7%).

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

BRASIL - PIB TAXA DE CRESCIMENTO ANUAL



DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB

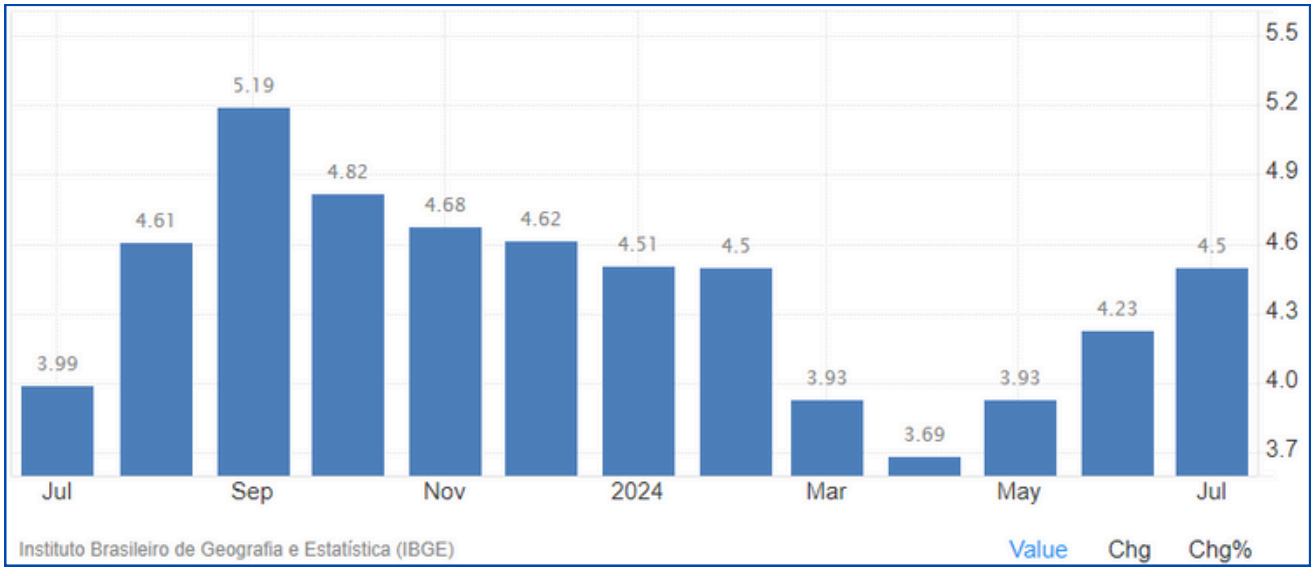
INFLAÇÃO

A inflação medida pelo IPCA avançou +0,38% (M/M) em julho, acelerando em relação ao avanço de +0,21% (M/M) observado no mês anterior. Sendo que a variação foi superior a projeção de mercado de +0,31%. Com isso, o índice acumulou alta de +4,5% em 12 meses (ante +4,23% em junho). Os grupos que mais contribuíram para a variação vieram dos grupos Transportes (variação de +1,82% ante projeção de +1,54%) e Saúde e cuidados pessoais (+0,22% ante projeção de -0,14%). A maior contribuição para a variação do índice partiu do grupo Transportes influenciado pelo expressivo aumento dos itens de Transporte público. Os preços administrados avançaram +1,08% em julho, influenciados principalmente pelo avanço dos preços do item Gasolina (+3,15% ante +0,64% na leitura anterior).

Já os preços livres desaceleraram (de +0,16% para +0,14%) deixando de ser os principais vetores do IPCA. Nas aberturas dos preços livres houve avanço de produtos industriais e de serviços +0,13% para +0,33% e +0,04% para +0,75% respectivamente, enquanto alimentos apresentaram recuo de +0,47% para -1,51%. Na margem, tivemos desaceleração da medida subjacente de industriais (de +0,13% para +0,11%), entretanto, o núcleo de serviços ganhou ritmo (de +0,36% para +0,63%). O índice de difusão passou de 52,25% em junho para 46,95% em julho.

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

BRASIL - TAXA DE INFLAÇÃO MENSAL



DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB

POLÍTICA MONETÁRIA

Em 31/07, houve a reunião do Copom, o principal evento do mês. Nela, apesar das pressões inflacionárias e da desvalorização cambial, o comitê decidiu manter, por unanimidade, a taxa básica de juro (Selic) em 10,5% a.a. O comitê avaliou que a decisão de manter os juros é compatível com a estratégia de convergência da inflação para o redor da meta. Entretanto, o comitê destacou que o cenário global está incerto e o cenário doméstico está sendo marcado por resiliência na atividade, elevação das projeções de inflação e expectativas "desancoradas" que "demandam acompanhamento diligente e ainda maior cautela". Em relação aos próximos passos, não foi fornecido um guidance, com o Comitê apenas afirmando que "se manterá vigilante" e que "eventuais ajustes futuros na taxa de juros serão ditados pelo firme compromisso de convergência da inflação à meta".

➤ **GERAL**

Em maio, o IBC-Br avançou 0,2% (M/M), mesmo com as enchentes no estado do Rio Grande do Sul.

➤ **COPOM**

SELIC em 10,50 % a.a.

Próximo COPOM: 17 e 18 de setembro de 2024

➤ **IPCA JULHO DE 2024**

O IPCA avançou 0,38% (M/M) em Julho. Acumulando alta de 4,5% em 12 meses.

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

BRASIL - TAXA SELIC META



DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB

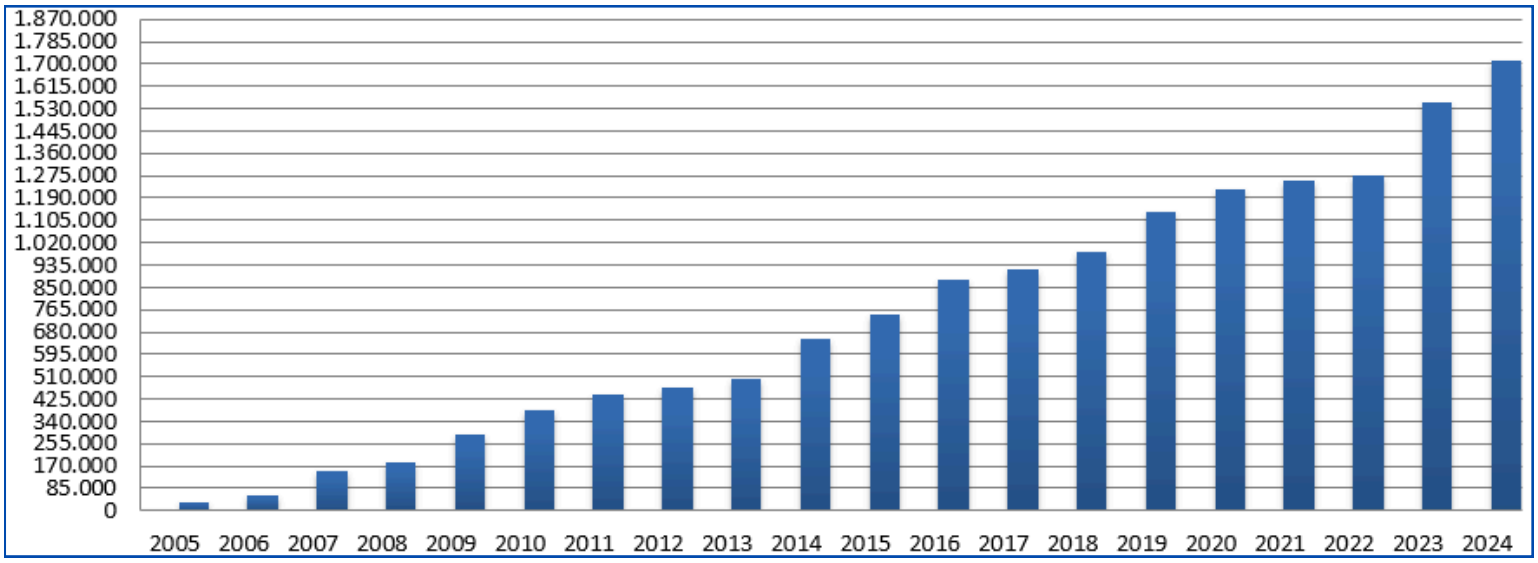


CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO RPPS

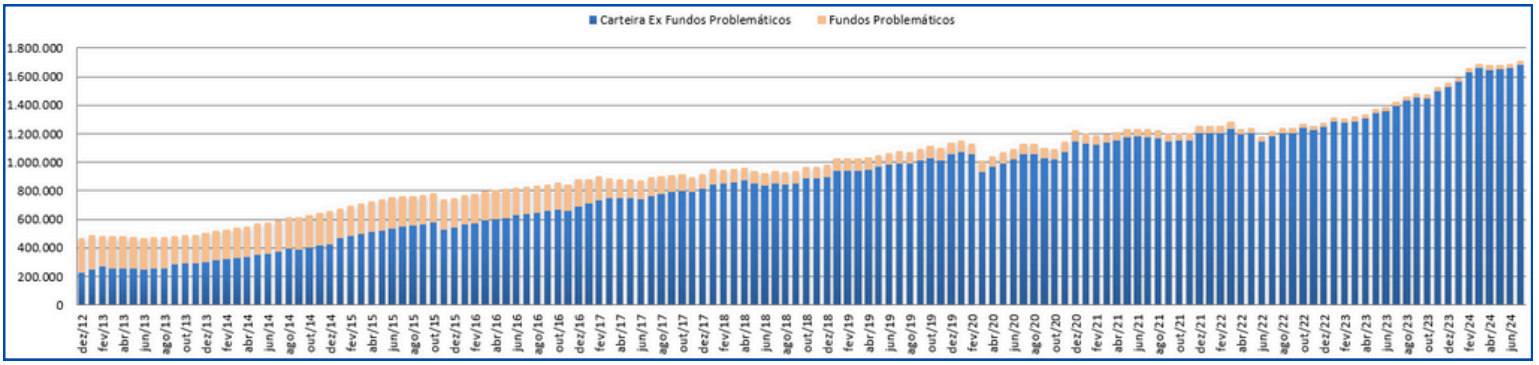
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB

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

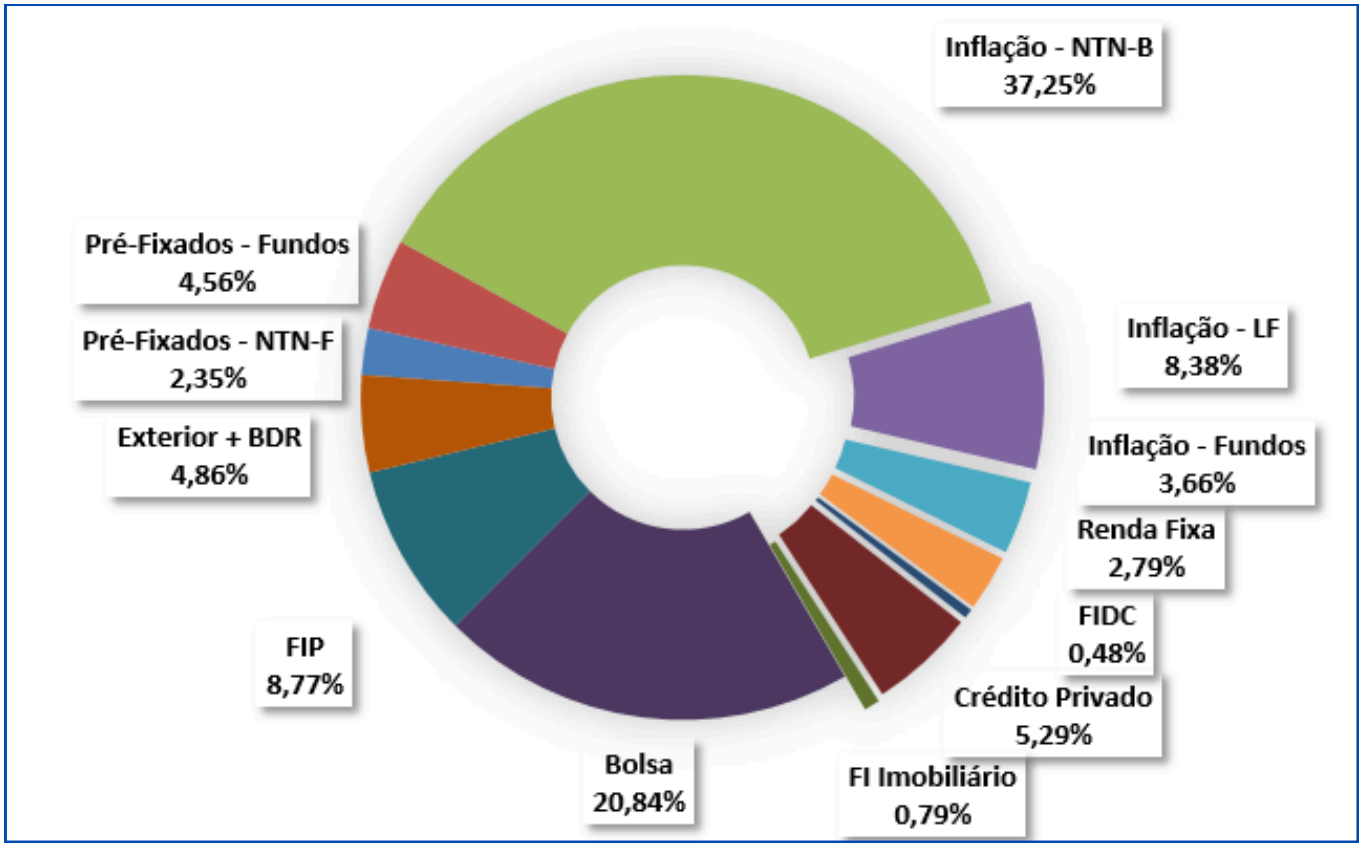


DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO RPPS

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS RESUMO		PPREV	%	PFIN	TX DE ADM	TOTAL	%
Renda Fixa		**1.054.842.110,80**	**63,63%**			**1.106.920.277,30**	**64,74%**
	Pré-Fixados - NTN-F	R$ 40.252.537,87	2,43%			R$ 40.252.537,87	2,35%
	Pré-Fixados - Fundos	R$ 77.916.261,79	4,70%			R$ 77.916.261,79	4,56%
	Inflação - NTN-B	R$ 636.797.710,64	38,42%			R$ 636.797.710,64	37,25%
	Inflação - LF	R$ 91.152.834,56	5,50%	R$ 44.942.517,57	R$ 7.135.648,93	R$ 143.231.001,06	8,38%
	Inflação - Fundos	R$ 62.515.854,75	3,77%			R$ 62.515.854,75	3,66%
	Renda Fixa	R$ 47.703.157,29	2,88%			R$ 47.703.157,29	2,79%
	FIDC	R$ 8.125.222,31	0,49%			R$ 8.125.222,31	0,48%
	Crédito Privado	R$ 90.378.531,59	5,45%			R$ 90.378.531,59	5,29%
Renda Variável		**R$ 519.756.243,05**	**31,35%**			**R$ 519.756.243,05**	**30,40%**
	Multimercado	R$ -	0,00%			R$ -	0,00%
	FI Imobiliário	R$ 13.477.141,43	0,81%			R$ 13.477.141,43	0,79%
	Bolsa	R$ 356.387.280,77	21,50%			R$ 356.387.280,77	20,84%
	FIP	R$ 149.891.820,85	9,04%			R$ 149.891.820,85	8,77%
Investimento no Exterior		**R$ 83.074.549,93**	**5,01%**			**R$ 83.074.549,93**	**4,86%**
	Exterior + BDR	R$ 83.074.549,93	5,01%			R$ 83.074.549,93	4,86%
Total		**R$ 1.657.672.903,78**	**100%**	**R$ 44.942.517,57**	**R$ 7.135.648,93**	**R$ 1.709.751.070,28**	**100%**

COMPOSIÇÃO DOS ATIVOS POR CLASSE



DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB



PLANO PREVIDENCIÁRIO

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB

RENTABILIDADE DO PLANO PREVIDENCIÁRIO

	jul/24	jun/24	mai/24	2024	12 m	24 m
Carteira PPREV	1,43%	1,61%	0,12%	5,72%	13,46%	24,98%
Carteira Ex Fundos Problemáticos	1,47%	1,64%	0,13%	5,74%	13,40%	24,92%
Meta Atuarial	0,84%	0,61%	0,88%	5,90%	10,30%	19,72%
CDI	0,91%	0,79%	0,83%	6,18%	12,71%	26,62%
Ibovespa	3,02%	1,48%	-3,04%	-4,87%	8,09%	23,71%

Em julho, a rentabilidade da carteira de investimentos do plano previdenciário foi de **1,43%**. Já no acumulado dos últimos 12 e 24 meses foi de **13,46%** e **24,98%**, 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.

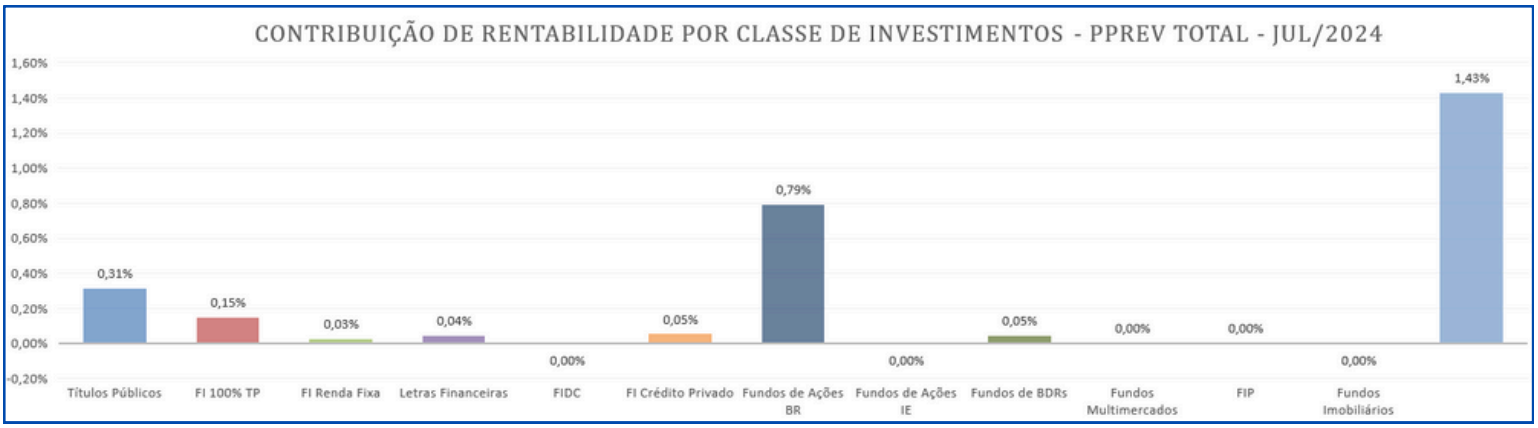


DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB

RESULTADO FINANCEIRO POR CLASSE DE ATIVO

RENTABILIDADE POR ARTIGO - PPREV TOTAL		Início	28/06/2024	Fim	31/07/2024	
ARTIGOS	Rentabilidade %	Rendimentos $			Posição $	Contribuição %
Títulos Públicos	0,80%	R$	5.114.153,32	R$	677.450.837,58	0,31%
FI 100% TP	1,60%	R$	2.333.188,01	R$	148.706.949,77	0,15%
FI Renda Fixa	0,91%	R$	461.538,39	R$	39.027.735,01	0,03%
Letras Financeiras	0,79%	R$	717.878,51	R$	91.152.834,58	0,04%
FIDC	-0,10%	-R$	7.755,61	R$	8.125.222,31	0,00%
FI Crédito Privado	1,00%	R$	896.329,08	R$	90.378.531,60	0,05%
Fundos de Ações BR	3,64%	R$	12.526.140,00	R$	356.387.280,80	0,79%
Fundos de Ações IE	-0,51%	R$	18.330,11	R$	45.892.089,44	0,00%
Fundos de BDRs	1,45%	R$	785.059,54	R$	37.182.460,49	0,05%
Fundos Multimercados	0,00%	R$	-	R$	-	0,00%
FIP	-0,08%	-R$	21.369,32	R$	149.891.820,84	0,00%
Fundos Imobiliários	-0,07%	-R$	9.547,47	R$	13.477.141,43	0,00%
Total		R$	22.813.944,54	R$	1.657.672.903,77	1,43%

CONTRIBUIÇÃO DE RENTABILIDADE POR CLASSE DE INVESTIMENTOS





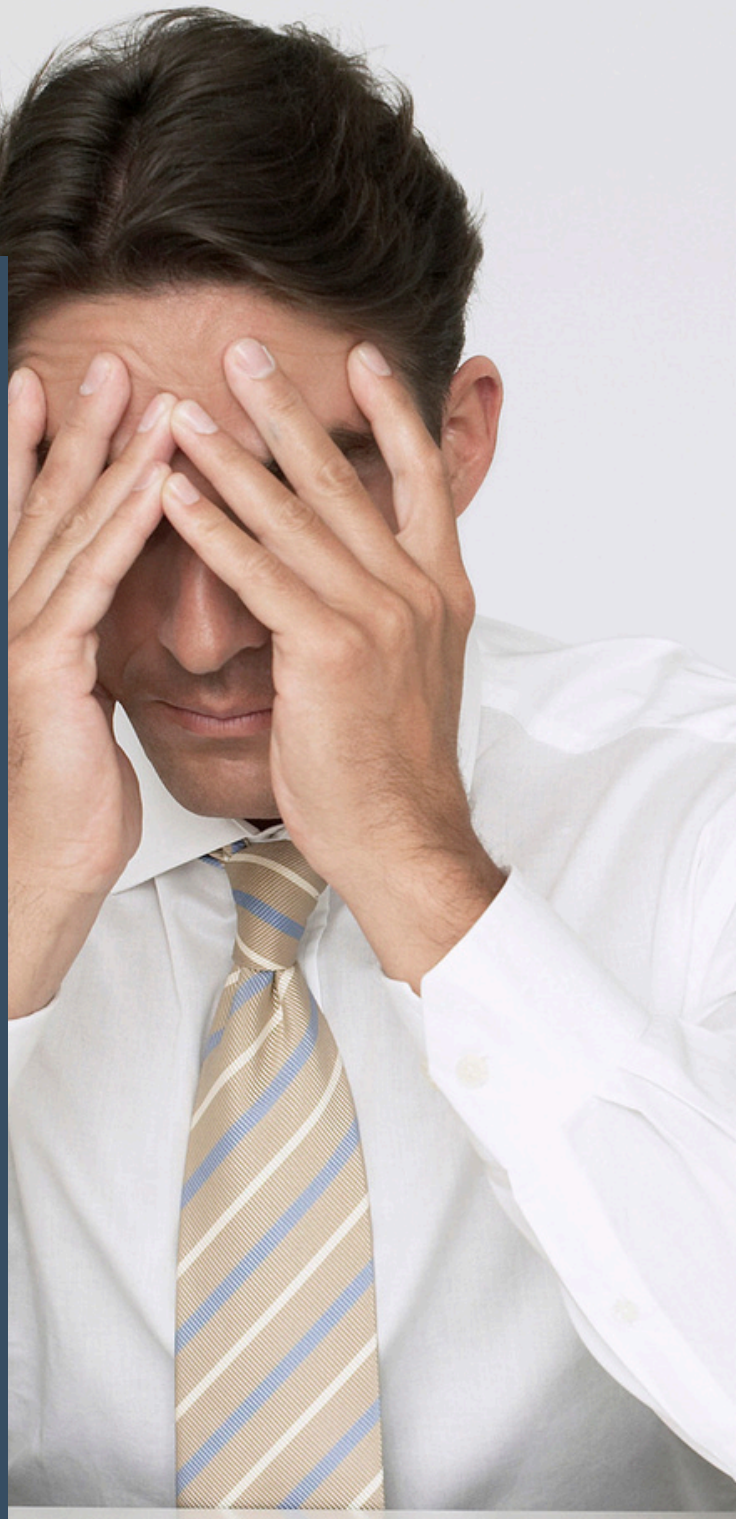
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB



ATIVOS DO PLANO PREVIDENCIÁRIO

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB

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 julho, **1,73% (R$ 29.611.024,32),** 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: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB

FUNDOS PROBLEMÁTICOS

31/07/2024

	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$ 849.840,99	R$ 4.127.041,84	-R$ 2.523.117,17	Fechado para resgate
FI VITORIA REGIA	R$ 10.000.000,00	03/08/12	R$ 1.129.837,83	R$ 4.993.300,25	-R$ 3.876.861,92	Fechado para resgate
DIFERENCIAL FI RF LP	R$ 28.000.000,00	21/12/10	R$ 550.368,79	R$ 24.503.776,42	-R$ 2.945.854,79	Fechado para resgate
BBIF MASTER FIDC LP	R$ 25.500.000,00	03/11/10	R$ 5.434.219,10	R$ -	-R$ 20.065.780,90	Fechado para resgate
BVA MASTER FIDC	R$ 15.000.000,00	28/04/10	R$ 104.009,64	R$ 16.959.117,91	R$ 2.063.127,55	Fechado para resgate
BVA MASTER II FIDC	R$ 9.999.963,06	06/08/10	R$ 988.240,57	R$ 13.061.652,77	R$ 4.049.930,28	Fechado para resgate
FIDC MULTIS. ITÁLIA	R$ 7.500.000,00	11/06/12	R$ 1.598.753,00	R$ 7.582.641,90	R$ 1.681.394,90	Fechado para resgate
SECURITY FI REF. DI LP	R$ 5.000.000,00	02/09/09	R$ 866.061,59	R$ 3.167.634,60	-R$ 966.303,81	Fechado para resgate
PIATÃ FI RF RPPS CP LP	R$ 43.337.555,64	19/11/08	R$ 4.910.146,93	R$ 37.335.302,31	-R$ 1.092.106,40	Fechado para resgate
ÁTICO GER ENER FIP	R$ 2.500.000,00	13/05/11	-R$ 297.595,55	R$ -	-R$ 2.797.595,55	Fechado para resgate
FII BR HOTÉIS	R$ 20.000.000,00	26/09/12	R$ 13.477.141,43	R$ 3.474.598,03	-R$ 3.048.260,54	Sem liquidez
SUB-TOTAL	**R$ 174.337.518,70**		**R$ 29.611.024,32**	**R$ 115.205.066,03**	**-R$ 29.521.428,35**	
Fundos Liquidados						
PATRIARCA FIP	R$ 19.999.999,99	02/09/10	R$ -	R$ 4.129.769,98	-R$ 15.870.230,01	Liquidado
ATICO FIDC IMOBILIARIOS	R$ 3.748.631,03	13/05/11	R$ -	R$ 3.873.549,50	R$ 124.918,47	Liquidado
ECOHEDGE MULTIM.	R$ 23.698.637,66	31/08/12	R$ -	R$ 11.825,29	-R$ 23.686.812,37	Liquidado
SUB-TOTAL	R$ 47.447.268,68		R$ -	R$ 8.015.144,77	-R$ 39.432.123,91	
TOTAL	**R$ 221.784.787,38**		**R$ 29.611.024,32**	**R$ 123.220.210,80**	**-R$ 68.953.552,26**	



DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB

DEMAIS ATIVOS DO PLANO PREVIDENCIÁRIO

ATIVOS PRÉ-FIXADOS			MÊS	CDI	ANO	CDI	12 MESES	CDI
NTN-F - 01.01.2031 (Curva) - 25.10.2021	R$	40.252.537,87	1,09%	0,91%	7,41%	6,18%	12,83%	11,52%
CAIXA BRASIL IRF-M	R$	77.916.261,79	1,33%	0,91%	2,71%	6,18%	8,10%	11,52%
TOTAL	R$	118.168.799,66						
% TOTAL DA CARTEIRA		7,13%						

ATIVOS DE INFLAÇÃO			MÊS	CDI	ANO	CDI	12 MESES	CDI
NTN-B - 15.08.2030 (Curva) - 18.08.2021	R$	57.270.437,64	0,68%	0,91%	5,86%	6,18%	9,31%	11,52%
NTN-B - 15.08.2030 (Curva) - 08.09.2021	R$	50.065.557,07	0,68%	0,91%	5,88%	6,18%	9,35%	11,52%
NTN-B - 15.08.2040 (Curva) - 17.06.2024	R$	40.470.531,57	0,82%	0,91%	1,17%	6,18%	-	-
NTN-B - 15.05.2045 (Curva) - 26.07.2022	R$	86.687.015,78	0,81%	0,91%	6,93%	6,18%	11,10%	11,52%
NTN-B - 15.05.2045 (Curva) - 06.07.2023	R$	19.177.343,72	0,75%	0,91%	6,51%	6,18%	10,37%	11,52%
NTN-B - 15.08.2050 (Curva) - 05.07.2023	R$	31.466.678,79	0,75%	0,91%	6,61%	6,18%	10,46%	11,52%
NTN-B - 15.08.2050 (Curva) - 18.04.2024	R$	51.447.131,16	0,80%	0,91%	2,90%	6,18%	-	-
NTN-B - 15.05.2055 (Curva) - 05.07.2023	R$	31.458.676,52	0,75%	0,91%	6,56%	6,18%	10,40%	11,52%
NTN-B - 15.05.2055 (Curva) - 11.10.2023	R$	51.697.877,82	0,78%	0,91%	6,68%	6,18%	-	-
NTN-B - 15.05.2055 (Curva) - 19.06.2024	R$	75.816.588,36	0,82%	0,91%	1,09%	6,18%	-	-
NTN-B - 15.05.2055 (Curva) - 11.07.2024	R$	85.453.236,22	0,53%	0,91%	0,53%	6,18%	-	-
NTN-B - 15.08.2060 (Curva) - 15.08.2022	R$	55.786.635,99	0,78%	0,91%	6,77%	6,18%	10,79%	11,52%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL	R$	62.515.854,75	2,04%	0,91%	0,02%	6,18%	3,30%	11,52%
TOTAL	R$	699.313.565,39						
% TOTAL DA CARTEIRA		42,19%						

FUNDOS RENDA FIXA			MÊS	CDI	ANO	CDI	12 MESES	CDI
TOP FI RF (ADINVEST TOP)	R$	849.840,99	0,23%	0,91%	0,59%	6,18%	1,13%	11,52%
BRASIL RF LP (DIFERENCIAL)	R$	550.368,78	1,39%	0,91%	-17,57%	6,18%	-18,09%	11,52%
FI VITORIA RÉGIA	R$	1.129.837,83	0,11%	0,91%	0,04%	6,18%	0,41%	11,52%
BB RPPS FLUXO - FPREV	R$	623.837,69	0,82%	0,91%	5,56%	6,18%	10,41%	11,52%
BB PERFIL - FPREV	R$	31.998.473,46	0,97%	0,91%	6,26%	6,18%	11,61%	11,52%
BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL	R$	2.740.457,88	0,94%	0,91%	3,52%	6,18%	7,77%	11,52%
ITAÚ ALOC DINÂMICA	R$	1.134.918,37	0,88%	0,91%	2,80%	6,18%	7,03%	11,52%
BTG PACTUAL TESOURO SELIC DI	R$	8.274.833,23	0,90%	0,91%	6,10%	6,18%	11,37%	11,52%
TOTAL	R$	47.302.568,23						
% TOTAL DA CARTEIRA		2,85%						

TÍTULOS DE INSTITUIÇÃO FINANCEIRA			MÊS	CDI	ANO	CDI	12 MESES	CDI
LF BTG PACTUAL 05 ANOS - VENC. 31.03.2027	R$	45.332.600,45	0,77%	0,91%	6,68%	6,18%	10,53%	11,52%
LF BTG PACTUAL 10 ANOS - VENC. 31.03.2032	R$	45.820.234,11	0,81%	0,91%	6,96%	6,18%	11,04%	11,52%
TOTAL	R$	91.152.834,56						
% TOTAL DA CARTEIRA		5,50%						

FUNDOS CRÉDITO PRIVADO			MÊS	CDI	ANO	CDI	12 MESES	CDI
SECURITY FI REFERENCIADO DI LP	R$	866.061,59	0,62%	0,91%	3,78%	6,18%	6,99%	11,52%
BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO	R$	54.424.087,28	1,13%	0,91%	8,01%	6,18%	15,47%	11,52%
BRADESCO PERFORMANCE INSTITUCIONAL CP	R$	30.178.235,80	1,02%	0,91%	7,13%	6,18%	13,31%	11,52%
PIATÃ FI RENDA FIXA	R$	4.910.146,92	-0,44%	0,91%	-3,48%	6,18%	-4,79%	11,52%
TOTAL	R$	90.378.531,59						
% TOTAL DA CARTEIRA		5,45%						

FIDC's			MÊS	CDI	ANO	CDI	12 MESES	CDI
BBIF MASTER FIDC LP	R$	5.434.219,10	-0,44%	0,91%	-3,24%	6,18%	-5,38%	11,52%
BVA MASTER FIDC MULTISETORIAL SÊNIOR	R$	104.009,64	11,37%	0,91%	-	-	-	-
BVA MASTER II FIDC MULTISETORIAL SÊNIOR	R$	988.240,57	2,17%	0,91%	-	-	-	-
RIAL ITALIA	R$	1.598.753,00	-1,05%	0,91%	-	-	-	-
	R$	8.125.222,31						
TEIRA		0,49%						

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB

FUNDOS DE AÇÕES			MÊS	IBOV	ANO	IBOV	12 MESES	IBOV
XP INVESTOR FI AÇÕES	R$	30.673.520,94	5,17%	3,02%	-5,98%	-4,87%	4,63%	4,67%
XP INVESTOR 30 FICFI AÇÕES	R$	26.209.703,39	5,04%	3,02%	-5,68%	-4,87%	4,90%	4,67%
TARPON GT 30 FIC FIA	R$	62.140.665,96	2,10%	3,02%	-0,99%	-4,87%	16,35%	4,67%
CAIXA AÇÕES VALOR RPPS	R$	98.285.308,85	3,16%	3,02%	-5,94%	-4,87%	2,09%	4,67%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIA	R$	26.424.014,40	3,43%	3,02%	-6,65%	-4,87%	-1,61%	4,67%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	R$	40.549.818,86	3,57%	3,02%	-2,23%	-4,87%	7,93%	4,67%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA (BTG)	R$	22.390.635,25	3,57%	3,02%	-2,15%	-4,87%	9,66%	4,67%
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FICFI	R$	49.713.613,12	5,13%	3,02%	4,28%	-4,87%	15,06%	4,67%
TOTAL	R$	356.387.280,77						
% TOTAL DA CARTEIRA		21,50%						

FIP's			MÊS	CDI	ANO	CDI	12 MESES	CDI
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP	-R$	297.595,55	-64,48%	0,91%	-	-	-	-
BTG - INFRAESTRUTURA II	R$	178.780,98	-5,49%	0,91%	-	-	-	-
BTG - INFRAESTRUTURA III	R$	310.411,82	-11,30%	0,91%	-11,30%	-11,30%	-	-
BTG - ECONOMIA REAL FIP	R$	31.543.366,52	-0,19%	0,91%	3,44%	6,18%	3,59%	11,52%
BTG - ECONOMIA REAL II FIP	R$	5.506.550,24	-1,72%	0,91%	-5,68%	6,18%	-16,48%	11,52%
BTG - FIP IMPACTO	R$	33.503.853,96	0,03%	0,91%	20,91%	6,18%	19,72%	11,52%
BTG PACTUAL - INFRAESTRUTURA DIVIDENDOS - FIP	R$	14.708.318,40	-2,26%	0,91%	23,34%	6,18%	36,27%	11,52%
CAIXA FIP LOGÍSTICA	R$	758,75	-	-	-	-	-	-
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII	R$	6.336.310,84	-1,12%	0,91%	7,80%	6,18%	-	-
VINCI CAPITAL PARTNERS III	R$	13.598.738,76	1,44%	0,91%	-0,74%	6,18%	9,56%	11,52%
VINCI STRATEGIC PARTNERS I	R$	12.136.178,87	1,52%	0,91%	20,68%	6,18%	16,00%	11,52%
XINEA PRIVATE EQUITY IV FIP	R$	8.786.566,15	0,24%	0,91%	2,60%	6,18%	4,21%	11,52%
XINEA PRIVATE EQUITY V FIP	R$	23.579.581,11	-0,24%	0,91%	4,56%	6,18%	1,08%	11,52%
TOTAL	R$	149.891.820,85						
% TOTAL DA CARTEIRA		9,04%						

FUNDO IMOBILIÁRIO			MÊS	CDI	ANO	CDI	12 MESES	CDI
BR HOTÉIS FII	R$	13.477.141,43	-0,07%	0,91%	-0,02%	6,18%	0,12%	11,52%
TOTAL	R$	13.477.141,43						
% TOTAL DA CARTEIRA		0,81%						

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR			MÊS	MSCI ACWI	ANO	MSCI ACWI	12 MESES	MSCI ACWI
MS GLOBAL OPPORTUNITIES IE	R$	28.790.062,49	-2,20%	3,40%	24,29%	30,97%	36,07%	37,50%
LEGG MASON MARTIN CURRIE GLOBAL IE	R$	-	0,74%	3,40%	24,56%	30,97%	25,55%	37,50%
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FIC FIM IE	R$	17.102.026,95	0,93%	3,40%	25,36%	30,97%	26,09%	37,50%
MS US GROWTH FIC FIA IE	R$	-	0,64%	3,40%	14,02%	30,97%	21,31%	37,50%
WESTERN ASSET BDR NÍVEL I	R$	37.182.460,49	1,45%	3,40%	36,19%	30,97%	49,59%	37,50%
TOTAL	R$	83.074.549,93						
% TOTAL DA CARTEIRA		5,01%						

TÍTULOS DA DÍVIDA AGRÁRIA			MÊS	CDI	ANO	CDI	12 MESES	CDI
TÍTULOS DA DÍVIDA AGRÁRIA	R$	400.589,06	0,61%	0,91%	5,05%	6,18%	8,77%	11,52%
TOTAL	R$	400.589,06						
% TOTAL DA CARTEIRA		0,02%						

TOTAL	R$	1.657.672.903,78

TOTAL	R$	1.657.672.903,78

TOTAL DA CARTEIRA **R$ 1.657.672.903,78**

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB

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$ 178.780,98
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP	R$ 15.000.000,00		R$ 15.000.000,01	R$ 269.894,35	R$ 31.543.366,52
BTG PACTUAL - INFRAESTRUTURA DIVIDENDOS - FIP	R$ 12.416.752,78		R$ 12.416.752,78	R$ 9.554.398,67	R$ 14.708.318,40
BTG PACTUAL - FIP IMPACTO	R$ 27.116.859,94		R$ 27.116.859,94	R$ 841.516,83	R$ 33.503.853,96
KINEA PRIVATE EQUITY IV FIP	R$ 7.500.000,00		R$ 6.955.926,00	R$ 2.467.248,04	R$ 8.786.566,15
VINCI CAPITAL PARTNERS III	R$ 10.000.000,00	15,03%	R$ 9.470.887,47	R$ -	R$ 13.598.738,76
VINCI STRATEGIC PARTNERS I	R$ 25.000.000,00		R$ 9.692.053,58	R$ 439.465,42	R$ 12.136.178,87
KINEA PRIVATE EQUITY V FIP	R$ 50.000.000,00		R$ 25.763.158,53	R$ -	R$ 23.579.581,11
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP	R$ 60.000.000,00		R$ 7.004.540,59	R$ -	R$ 5.506.550,24
PÁTRIA VII	R$ 20.000.000,00		R$ 6.103.994,09	R$ -	R$ 6.336.310,84
BTG INFRA III	R$ 20.000.000,00		R$ 349.966,58	R$ -	R$ 310.411,82
TOTAL	R$ 257.033.612,72		R$ 124.784.139,85	R$ 26.753.899,08	R$ 150.188.657,65

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%	24,17%	1021,78%	17,35%
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP	out/20	2,12%	28,65%	162,69%	20,33%
BTG PACTUAL - INFRAESTRUTURA DIVIDENDOS - FIP	nov/20	1,88%	25,02%	131,00%	17,02%
BTG PACTUAL - FIP IMPACTO	ago/21	1,12%	14,29%	49,31%	7,67%
KINEA PRIVATE EQUITY IV FIP	mai/18	1,18%	15,17%	141,75%	9,08%
VINCI CAPITAL PARTNERS III	dez/18	1,03%	13,10%	100,86%	7,01%
VINCI STRATEGIC PARTNERS I	jun/22	2,56%	35,46%	93,03%	30,37%
KINEA PRIVATE EQUITY V FIP	abr/22	-0,86%	-9,81%	-21,40%	-13,52%
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP	mai/23	-2,73%	-28,29%	-34,02%	-30,92%
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII	set/23	0,53%	6,58%	6,02%	1,84%



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.

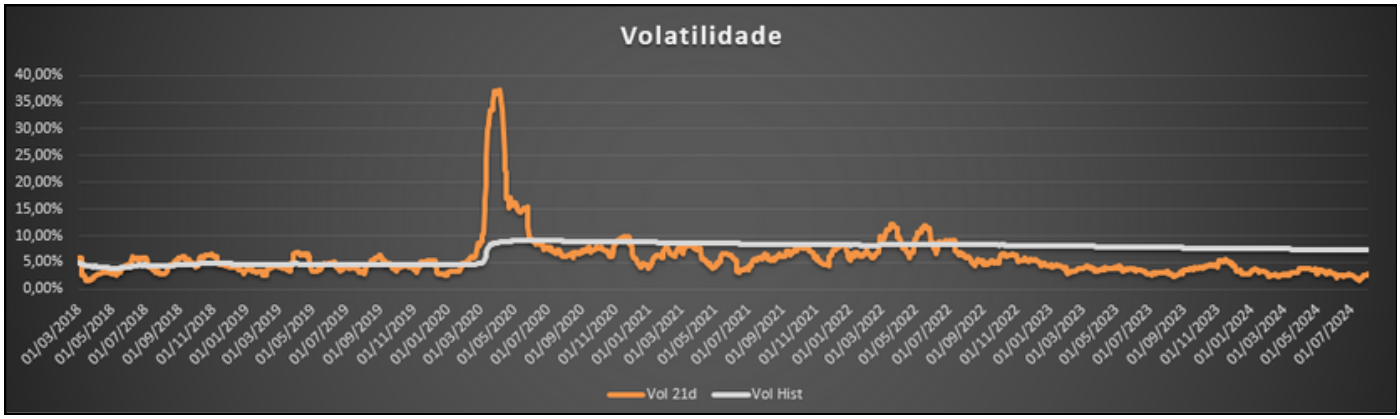
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB



GESTÃO DE RISCOS

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB

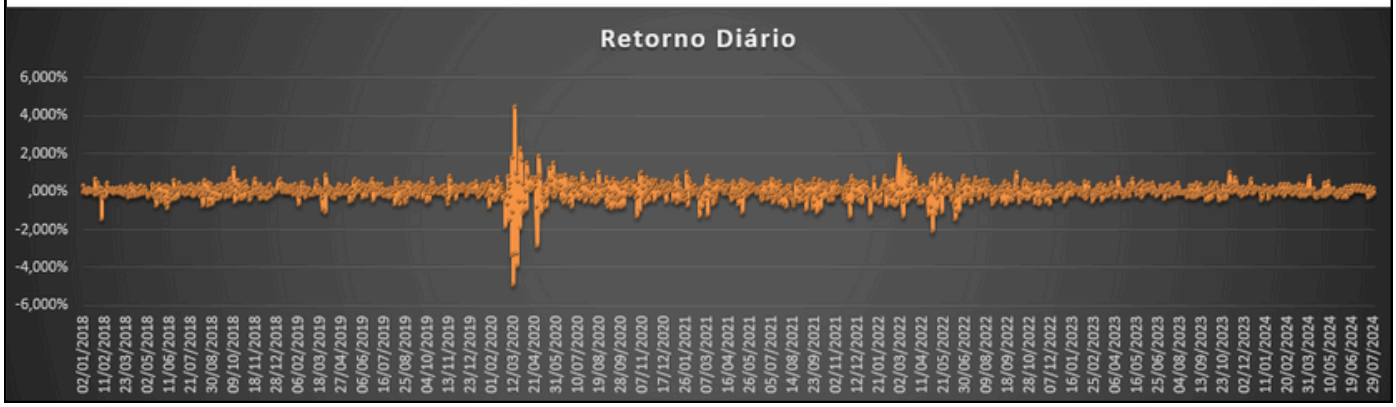
VOLATILIDADE



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

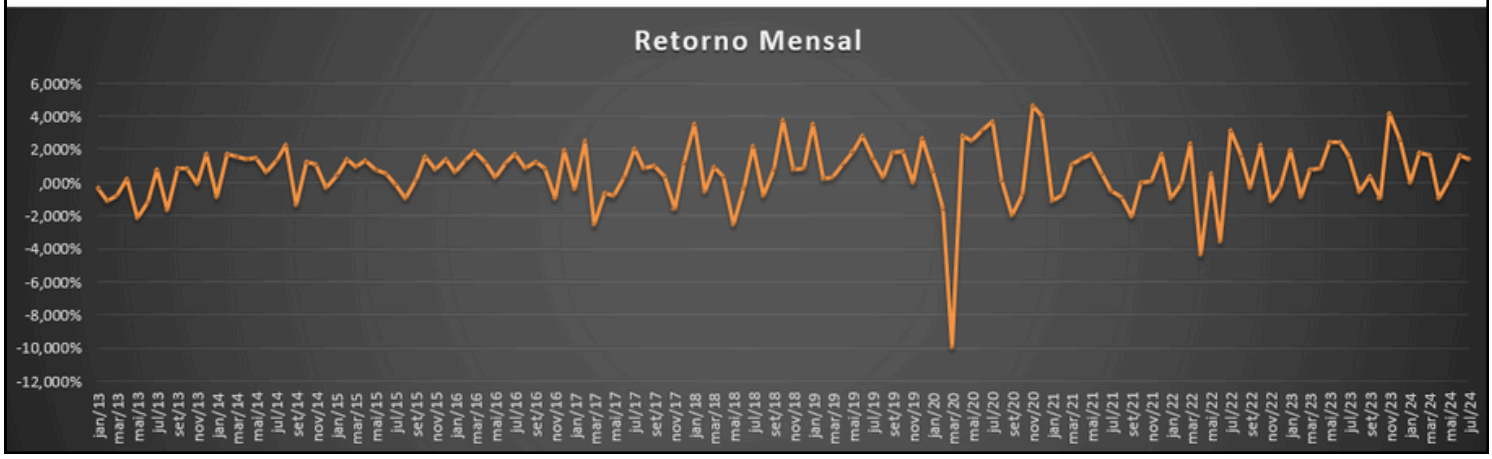
Retorno Diário		
Maior Retorno Diário	4,47%	13/03/2020
Menor Retorno Diário	-4,87%	12/03/2020
Retorno Médio Diário	0,03%	
VaR Histórico - 95%	-0,72%	-R$ 12.013.671,27



DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB

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$	761.346.957,45	44,5%
De 31 a 365 dias (Limite 50%)	R$	-	0,0%
Acima de 365 dias (Limite 60%)	R$	948.404.112,83	55,5%
Total	R$	1.709.751.070,28	100,00%

A tabela de liquidez mostra a relação entre o percentual da carteira e o seu respectivo nível de liquidez, ou seja, a capacidade de transformar o ativo em dinheiro, monetizar. Assim, considerando que parte da estratégia de longo prazo passa pela imunização de parte relevante da carteira através de investimentos em títulos públicos federais marcados na curva, que por esse modelo de precificação deve, obrigatoriamente, ser mantido na carteira até o vencimento, 44,5% possuem liquidez entre 0 e 30 dias. Todo o restante da carteira possui liquidez acima de 365 dias (TPF, FIPs e LFs).

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB

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%		39,62%	64,74%	20%	32,00%	75%
	FUNDOS DE INVESTIMENTO / ATIVOS FINANCEIROS	Fundos 100% Títulos Públicos	Art 7º, I, b		100%			8,70%		0%	8,00%	50%
		Fundos Renda fixa em geral	Art 7º, III, a		80%			5,33%		0%	8,00%	60%
		Títulos de Instituição Financeira	Art 7º, IV		20%			5,33%		0%	5,00%	20%
		FIDCs - Aberto ou Fechado- Cota Sênior	Art 7º, V, a	35%	20%		5,76%	0,48%		0%	0,50%	5%
		Fundos Renda fixa - Crédito Privado	Art 7º, V, b		20%			5,29%		0%	4,50%	20%
RENDA VARIÁVEL	FUNDOS DE INVESTIMENTO	Fundos de Ações em geral	Art 8º, I		50%	60%		20,84%	30,40%	0%	25,00%	35%
		Fundos Multimercado	Art 10º, I	20%	15%		8,77%	0,00%		0%	0,00%	10%
		FIPs (que atendam requisitos governança)	Art 10º, II		15%			8,77%		0%	8,00%	15%
		Fundo Imobiliário	Art 11		20%			0,79%		0%	0,00%	15%
INVESTIMENTO NO EXTERIOR	FUNDOS DE INVESTIMENTO	Fundo de Investimentos - Sufixo I.E.	Art 9º, II	10%	10%	10%	4,86%	2,68%	4,86%	0%	5,00%	10%
		Fundo de Ações - BDR Nível I	Art 8º, III		10%			2,17%		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: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB

RELAÇÃO DE GESTORES DOS RECURSOS DA MANAUS PREVIDÊNCIA

Gestor	Manausprev	% Manausprev	ANBIMA	% ANBIMA
Tesouro Nacional	R$ 677.450.837,57	39,62%	-	-
BTG PACTUAL	R$ 242.343.494,87	14,17%	R$ 417.683.680.000,00	0,06%
Caixa	R$ 176.202.329,39	10,31%	R$ 512.219.920.000,00	0,03%
XP	R$ 85.673.286,82	5,01%	R$ 172.603.180.000,00	0,05%
BRADESCO	R$ 70.393.662,45	4,12%	R$ 721.726.110.000,00	0,01%
GUEPARDO	R$ 62.940.454,11	3,68%	R$ 4.587.330.000,00	1,37%
J SAFRA	R$ 62.515.854,75	3,66%	R$ 149.491.550.000,00	0,04%
TARPON	R$ 62.140.665,96	3,63%	R$ 5.284.850.000,00	1,18%
ITAÚ UNIBANCO	R$ 50.848.531,49	2,97%	R$ 971.392.430.000,00	0,01%
Banco do Brasil	R$ 44.485.051,00	2,60%	R$ 1.610.066.820.000,00	0,00%
WESTERN ASSET	R$ 37.182.460,49	2,17%	R$ 40.655.790.000,00	0,09%
KINEA	R$ 32.366.147,26	1,89%	R$ 143.644.540.000,00	0,02%
CONSTÂNCIA	R$ 26.424.014,40	1,55%	R$ 2.302.380.000,00	1,15%
VINCI	R$ 25.734.917,63	1,51%	R$ 52.507.300.000,00	0,05%
MAG	R$ 17.102.026,95	1,00%	R$ 15.332.950.000,00	0,11%
GRAPHEN	R$ 13.477.141,43	0,79%	R$ 597.230.000,00	2,26%
BRASIL PLURAL	R$ 13.118.699,50	0,77%	R$ 64.474.020.000,00	0,02%
PÁTRIA	R$ 6.336.310,84	0,37%	R$ 50.794.180.000,00	0,01%
VILA RICA	R$ 1.598.753,00	0,09%	R$ 903.250.000,00	0,18%
SECURITY	R$ 866.061,59	0,05%	R$ 3.620.240.000,00	0,02%
BRZ Investimentos	R$ 550.368,78	0,03%	R$ 2.600.960.000,00	0,02%
TOTAL	**R$ 1.709.751.070,28**	**100,00%**		

RELAÇÃO DE ADMINISTRADORES DOS RECURSOS DA MANAUS PREVIDÊNCIA

Administrador	Manausprev	% Manausprev	ANBIMA	% ANBIMA
Tesouro Nacional	R$ 677.450.837,57	39,62%	-	-
BTG PACTUAL	R$ 276.870.308,99	16,19%	R$ 807.130.400.000,00	0,03%
Caixa	R$ 176.202.329,39	10,31%	R$ 637.779.800.000,00	0,03%
BANCO DAYCOVAL	R$ 102.690.484,82	6,01%	R$ 54.383.400.000,00	0,19%
BNP PARIBAS	R$ 83.074.549,93	4,86%	R$ 88.876.400.000,00	0,09%
BRADESCO	R$ 70.393.662,45	4,12%	R$ 639.073.200.000,00	0,01%
SAFRA	R$ 62.515.854,75	3,66%	R$ 146.915.500.000,00	0,04%
ITAÚ UNIBANCO	R$ 50.848.531,49	2,97%	R$ 870.083.500.000,00	0,01%
Banco do Brasil	R$ 44.485.051,00	2,60%	R$ 1.610.706.400.000,00	0,00%
BEM DTVM	R$ 40.022.753,16	2,34%	R$ 526.660.400.000,00	0,01%
XP	R$ 37.009.831,78	2,16%	R$ 124.880.500.000,00	0,03%
SANTANDER	R$ 31.643.922,49	1,85%	R$ 441.407.700.000,00	0,01%
INTRAG	R$ 23.579.581,11	1,38%	R$ 707.767.400.000,00	0,00%
RJI	R$ 13.179.545,88	0,77%	R$ 8.099.600.000,00	0,16%
LIONS TRUST	R$ 8.786.566,15	0,51%	R$ 30.466.200.000,00	0,03%
GENIAL	R$ 6.002.397,13	0,35%	R$ 93.554.000.000,00	0,01%
BNY MELLON	R$ 2.845.740,41	0,17%	R$ 392.420.900.000,00	0,00%
BRL DTVM	R$ 1.598.753,00	0,09%	R$ 533.149.400.000,00	0,00%
CM CAPITAL	R$ 550.368,78	0,03%	R$ 7.940.300.000,00	0,01%
TOTAL	**R$ 1.709.751.070,28**	**100,00%**		

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB

RELAÇÃO ANALÍTICA DOS ATIVOS DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO RPPS

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS	%		JULHO	Gestor	Credenciamento	Administrador	Credenciamento
FI RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS - Art 7º, I, a	**39,62%**	**R$**	**677.450.837,57**				
TÍTULOS DA DÍVIDA AGRÁRIA	0,02%	R$	400.589,06	Tesouro Nacional		Tesouro Nacional	
NTN-B - 15.08.2030 (Curva) - 18.08.2021	3,35%	R$	57.270.437,64	Tesouro Nacional		Tesouro Nacional	
NTN-B - 15.08.2030 (Curva) - 08.09.2021	2,93%	R$	50.065.557,07	Tesouro Nacional		Tesouro Nacional	
NTN-B - 15.08.2040 (Curva) - 17.06.2024	2,37%	R$	40.470.531,57	Tesouro Nacional		Tesouro Nacional	
NTN-B - 15.05.2045 (Curva) - 26.07.2022	5,07%	R$	86.687.015,78	Tesouro Nacional		Tesouro Nacional	
NTN-B - 15.05.2045 (Curva) - 06.07.2023	1,12%	R$	19.177.343,72	Tesouro Nacional		Tesouro Nacional	
NTN-B - 15.08.2050 (Curva) - 05.07.2023	1,84%	R$	31.466.678,79	Tesouro Nacional		Tesouro Nacional	
NTN-B - 15.08.2050 (Curva) - 18.04.2024	3,01%	R$	51.447.131,16	Tesouro Nacional		Tesouro Nacional	
NTN-B - 15.05.2055 (Curva) - 05.07.2023	1,84%	R$	31.458.676,52	Tesouro Nacional		Tesouro Nacional	
NTN-B - 15.05.2055 (Curva) - 11.10.2023	3,02%	R$	51.697.877,82	Tesouro Nacional		Tesouro Nacional	
NTN-B - 15.05.2055 (Curva) - 19.06.2024	4,43%	R$	75.816.588,36	Tesouro Nacional		Tesouro Nacional	
NTN-B - 15.05.2055 (Curva) - 11.07.2024	5,00%	R$	85.453.236,22	Tesouro Nacional		Tesouro Nacional	
NTN-B - 15.08.2060 (Curva) - 15.08.2022	3,26%	R$	55.786.635,99	Tesouro Nacional		Tesouro Nacional	
NTN-F - 01.01.2031 (Curva) - 25.10.2021	2,35%	R$	40.252.537,87	Tesouro Nacional		Tesouro Nacional	
FI RENDA FIXA TITULOS PUBLICOS - Art 7º, I, b	**8,70%**	**R$**	**148.706.949,77**				
BTG PACTUAL TESOURO SELIC DI	0,48%	R$	8.274.833,23	BTG PACTUAL	16.01.2026	BTG PACTUAL	16.01.2026
CAIXA BRASIL IRF-M	4,56%	R$	77.916.261,79	Caixa DTVM	20.05.2026	Caixa	16.01.2026
SAFRA IMA INSTITUCIONAL	3,66%	R$	62.515.854,75	J SAFRA	16.01.2026	SAFRA	16.01.2026
FI RENDA FIXA - Art 7º, III, a	**5,33%**	**R$**	**91.105.901,50**				
BB RPPS FLUXO - ADM PREV	0,15%	R$	2.546.576,39	Banco do Brasil	16.01.2026	Banco do Brasil	16.01.2026
BB RPPS FLUXO - ADIANTAMENTO	0,00%	R$	3.549,21	Banco do Brasil	16.01.2026	Banco do Brasil	16.01.2026
BB RPPS FLUXO - ADM FIN	0,03%	R$	553.868,92	Banco do Brasil	16.01.2026	Banco do Brasil	16.01.2026
BB RPPS FLUXO - FFIN	0,18%	R$	2.997.049,29	Banco do Brasil	16.01.2026	Banco do Brasil	16.01.2026
BB RPPS FLUXO - FPREV	0,04%	R$	623.837,69	Banco do Brasil	16.01.2026	Banco do Brasil	16.01.2026
BB PERFIL - ADM PREV	0,14%	R$	2.331.725,31	Banco do Brasil	16.01.2026	Banco do Brasil	16.01.2026
BB PERFIL - ADM FIN	0,01%	R$	150.963,35	Banco do Brasil	16.01.2026	Banco do Brasil	16.01.2026
BB PERFIL - FFIN	0,19%	R$	3.279.007,38	Banco do Brasil	16.01.2026	Banco do Brasil	16.01.2026
BB PERFIL - FPREV	1,87%	R$	31.998.473,46	Banco do Brasil	16.01.2026	Banco do Brasil	16.01.2026
BRADESCO DI PREMIUM - ADM PFIN	0,09%	R$	1.548.965,75	BRADESCO	16.01.2026	BRADESCO	16.01.2026
BRADESCO DI PREMIUM - PFIN	2,26%	R$	38.666.460,90	BRADESCO	16.01.2026	BRADESCO	16.01.2026
BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL	0,16%	R$	2.740.457,88	BTG PACTUAL	16.01.2026	BTG PACTUAL	16.01.2026
ITAÚ ALOC DINÂMICA	0,07%	R$	1.134.918,37	ITAÚ UNIBANCO	16.01.2026	ITAÚ UNIBANCO	16.01.2026
TOP FI RF (ADINVEST TOP)	0,05%	R$	849.840,99	BRPP	16.01.2026	BNY MELLON	16.01.2026
BRASIL RF LP (DIFERENCIAL)	0,03%	R$	550.368,78	BRZ Investimentos	16.01.2026	INTRADER	16.01.2026
FI VITORIA RÉGIA	0,07%	R$	1.129.837,83	BRPP	16.01.2026	BNY MELLON	16.01.2026
TÍTULOS DE INSTITUIÇÃO FINANCEIRA - Art 7º, IV	**5,33%**	**R$**	**91.152.834,56**				
LF BTG PACTUAL 05 ANOS - VENC. 31.03.2027	2,65%	R$	45.332.600,45	BTG PACTUAL	16.01.2026	BTG PACTUAL	16.01.2026
LF BTG PACTUAL 10 ANOS - VENC. 31.03.2032	2,68%	R$	45.820.234,11	BTG PACTUAL	16.01.2026	BTG PACTUAL	16.01.2026
FIDCs - Art 7º, V, a	**0,48%**	**R$**	**8.125.222,31**				
BBIF MASTER FIDC LP	0,32%	R$	5.434.219,10	BRPP	16.01.2026	SANTANDER	16.01.2026
BVA MASTER FIDC MULTISETORIAL SÊNIOR	0,01%	R$	104.009,64	BRASIL PLURAL	16.01.2026	GENIAL	16.01.2026
BVA MASTER II FIDC MULTISETORIAL SÊNIOR	0,06%	R$	988.240,57	BRASIL PLURAL	16.01.2026	GENIAL	16.01.2026
FIDC MULTISETORIAL ITALIA	0,09%	R$	1.598.753,00	VILA RICA	16.01.2024	BRL DTVM	16.01.2026
FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO - Art 7º, V, b	**5,29%**	**R$**	**90.378.531,59**				
BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO	3,18%	R$	54.424.087,28	BTG PACTUAL	16.01.2026	BTG PACTUAL	16.01.2026
BRADESCO PERFORMANCE INSTITUCIONAL CP	1,77%	R$	30.178.235,80	BRAM	16.01.2026	BRADESCO	16.01.2026
SECURITY FI REFERENCIADO DI LP	0,05%	R$	866.061,59	SECURITY	16.01.2026	BNY MELLON	16.01.2026
PIATÃ FI RENDA FIXA	0,29%	R$	4.910.146,92	BRPP	16.01.2026	GENIAL	16.01.2026
FI DE RENDA VARIÁVEL - Art 8º, I	**20,84%**	**R$**	**356.387.280,77**				
CAIXA AÇÕES VALOR RPPS	5,75%	R$	98.285.308,85	Caixa DTVM	20.05.2026	Caixa	16.01.2026
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIA	1,55%	R$	26.424.014,40	CONSTÂNCIA	15.04.2026	BEM DTVM	16.01.2026
XP INVESTOR FI AÇÕES	1,79%	R$	30.673.520,94	XP	16.01.2026	XP CCTVM	08.11.2025
XP INVESTOR 30 FICFI AÇÕES	1,53%	R$	26.209.703,39	XP	16.01.2026	SANTANDER	16.01.2026
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	2,37%	R$	40.549.818,86	GUEPARDO	17.11.2024	Banco Daycoval	16.01.2026
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA (BTG)	1,31%	R$	22.390.635,25	GUEPARDO	17.11.2024	BTG PACTUAL	16.01.2026
TARPON GT 30 FIC FIA	3,63%	R$	62.140.665,96	TARPON	16.01.2026	Banco Daycoval	16.01.2026
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FICFI	2,91%	R$	49.713.613,12	ITAÚ UNIBANCO	16.01.2026	ITAÚ UNIBANCO	16.01.2026
FI DE RENDA VARIÁVEL - Art 8º, III	**2,17%**	**R$**	**37.182.460,49**				
WESTERN ASSET BDR NÍVEL I	2,17%	R$	37.182.460,49	WESTERN ASSET	16.01.2026	BNP PARIBAS	16.01.2026
FI DE RENDA VARIÁVEL - Art 9º, II	**2,68%**	**R$**	**45.892.089,44**				
MS GLOBAL OPPORTUNITIES IE	1,68%	R$	28.790.062,49	XP ALLOCATION ASSET	25.07.2024	BNP PARIBAS	16.01.2026
LEGG MASON MARTIN CURRIE GLOBAL IE	0,00%	R$	-	WESTERN ASSET	16.01.2026	BNP PARIBAS	16.01.2026
MAG GLOBAL SUSTAINABLE FIC FIM IE	1,00%	R$	17.102.026,95	MAG	15.05.2026	BNP PARIBAS	16.01.2026
MS US GROWTH FIC FIA IE	0,00%	R$	-	PLURAL INVESTIMENTOS	18.05.2026	BNP PARIBAS	16.01.2026
FI DE RENDA VARIÁVEL - Art 10º, II	**8,77%**	**R$**	**149.891.820,85**				
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP	-0,02%	-R$	297.595,55	BRPP	16.01.2026	RJI	16.01.2026
BTG - INFRAESTRUTURA II	0,01%	R$	178.780,98	BTG PACTUAL	16.01.2026	BTG PACTUAL	16.01.2026
BTG - INFRAESTRUTURA III	0,02%	R$	310.411,82	BTG PACTUAL	16.01.2026	BTG PACTUAL	16.01.2026
BTG - ECONOMIA REAL FIP	1,84%	R$	31.543.366,52	BTG PACTUAL	16.01.2026	BTG PACTUAL	16.01.2026
BTG - ECONOMIA REAL II FIP	0,32%	R$	5.506.550,24	BTG PACTUAL	16.01.2026	BTG PACTUAL	16.01.2026
BTG - FIP IMPACTO	1,96%	R$	33.503.853,96	BTG PACTUAL	16.01.2026	BTG PACTUAL	16.01.2026
BTG PACTUAL - INFRAESTRUTURA DIVIDENDOS - FIP	0,86%	R$	14.708.318,40	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	0,37%	R$	6.336.310,84	PÁTRIA	12.09.2025	XP CCTVM	08.11.2025
VINCI CAPITAL PARTNERS III	0,80%	R$	13.598.738,76	Vinci	16.01.2026	BEM DTVM	16.01.2026
VINCI STRATEGIC PARTNERS I	0,71%	R$	12.136.178,87	Vinci	16.01.2026	BTG PACTUAL	16.01.2026
KINEA PRIVATE EQUITY IV FIP	0,51%	R$	8.786.566,15	KINEA	16.01.2026	LIONS TRUST	16.01.2026
KINEA PRIVATE EQUITY V FIP	1,38%	R$	23.579.581,11	KINEA	16.01.2026	INTRAG	16.01.2026
FI DE RENDA VARIÁVEL - Art 11	**0,79%**	**R$**	**13.477.141,43**				
BR HOTÉIS FII	0,79%	R$	13.477.141,43	GRAPHEN	16.01.2026	RJI	16.01.2026
TOTAL	**100%**	**R$**	**1.709.751.070,28**				

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB



COMITÊ DE INVESTIMENTOS

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB

ÚLTIMAS DELIBERAÇÕES

No mês de julho foram efetivados os resgates nos fundos de investimentos no exterior, seguindo decisão do Comitê de Investimentos de reduzir significativamente a exposição da carteira aos ativos de renda variável no exterior. Além dos resgates totais nos fundos LEGG MASON MARTIN CURRIE GLOBAL IE e MS US GROWTH FIC FIA IE, foram realizados resgates parciais nos fundos MS GLOBAL OPPORTUNITIES IE e WESTERN ASSET BDR NÍVEL I, totalizando R$ 85.090.016,96.

Conforme orientação do estudo de ALM (Asset Liability Management), os valores oriundos desses resgates foram utilizados na compra de NTN-B com vencimento em 2055 e taxa de juros de 6,20%, significativamente acima da meta atuarial. Diante do compromisso da Manaus Previdência em não negociar o papel até o seu vencimento, o Título será marcado na curva.

No mês de julho, a Carteira da Manaus Previdência recebeu R$ 73.250,53 em amortizações dos fundos BVA MASTER I FIDC MULTISETORIAL SÊNIOR, BVA MASTER II FIDC MULTISETORIAL SÊNIOR e PIATÃ FI RENDA FIXA.

Adicionalmente, foram recebidos dividendos dos fundos de participação BTG Impacto e BTG Infraestrutura Dividendos, no valor de R$ 1.323.984,67.

A carteira também recebeu o valor de R$ 2.181.755,59 referente aos juros semestrais da NTN-F 2031.

Todos os recursos recebidos foram aplicados em fundos DI conforme orientação do Comitê de Investimentos.



DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB



CONCEITOS IMPORTANTES

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB

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: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB

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: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB

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

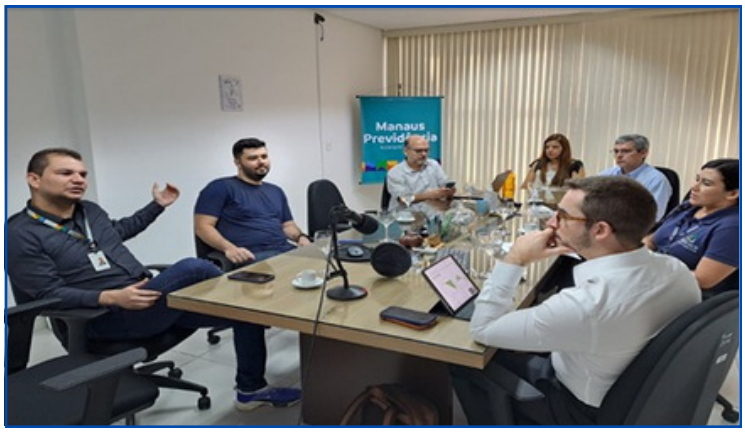
Índice de Treynor

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: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB

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: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB

Manaus Previdência
Autarquia Municipal

Prefeitura de Manaus

O Relatório de Investimentos do mês de julho de 2024 foi deliberado e aprovado pelo Comitê de Investimentos em sua 16º Reunião Ordinária, realizada em 20/08/2024.



DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB

:: PORTFÓLIOS E ATIVOS

31/07/2024

Resumo — 12 meses

Nome	Retorno (%)				VaR	Volatilidade	Taxa de Administração
	Mês	Ano	06 meses	12 meses			
TÍTULOS PÚBLICOS - 7, I, A	0,87	6,53	5,45	10,72	0,09%	0,20%	-
NTN-B 2030 (CURVA) - COMPRA 08.09.2021	0,68	5,88	4,92	9,45	0,11%	0,24%	-
NTN-B 2030 (CURVA) - COMPRA 18.08.2021	0,68	5,86	4,91	9,42	0,11%	0,24%	-
NTN-B 2045 (CURVA) - COMPRA 26.07.2022	0,81	6,80	5,71	11,10	0,12%	0,25%	-
NTN-B 2050 (Curva) - COMPRA 05.07.2023	0,75	6,35	5,32	10,28	0,11%	0,24%	-
NTN-B 2055 (CURVA) - COMPRA 05.07.2023	0,75	6,34	5,32	10,28	0,11%	0,24%	-
NTN-B 2055 (CURVA) - COMPRA 11.10.2023	0,78	6,58	5,52	10,70	0,12%	0,25%	-
NTN-B 2060 (CURVA) - COMPRA 15.08.2022	0,78	6,59	5,53	10,73	0,12%	0,25%	-
NTN-F 2027 (Curva) - Compra 06.08.2021	1,06	5,90	4,87	9,97	0,16%	0,33%	-
NTN-F 2027 (Curva) - Compra 20.08.2021	1,15	6,47	5,34	10,97	0,16%	0,34%	-
NTN-F 2031 (Curva) - Compra 08.09.2021	1,21	6,80	5,61	11,53	0,17%	0,36%	-
NTN-F 2031 (CURVA) - COMPRA 25.10.2021	1,40	7,85	6,46	13,35	0,20%	0,43%	-
TÍTULO DA DÍVIDA AGRÁRIA - T.D.A.	1,58	6,07	5,37	9,70	3,45%	7,27%	-

Retorno Mensal (%)

Nome	jul/24	jun/24	mai/24	abr/24	mar/24	fev/24	jan/24	dez/23	nov/23	out/23	set/23	ago/23
TÍTULOS PÚBLICOS - 7, I, A	0,87	0,82	0,90	0,77	0,95	0,98	1,06	0,82	0,75	0,74	0,72	0,81
NTN-B 2030 (CURVA) - COMPRA 08.09.2021	0,68	0,75	0,79	0,64	0,92	1,01	0,94	0,74	0,61	0,63	0,61	0,72
NTN-B 2030 (CURVA) - COMPRA 18.08.2021	0,68	0,75	0,79	0,63	0,92	1,01	0,94	0,74	0,61	0,62	0,61	0,72
NTN-B 2045 (CURVA) - COMPRA 26.07.2022	0,81	0,87	1,01	0,77	1,04	1,04	1,07	0,86	0,82	0,75	0,73	0,78
NTN-B 2050 (Curva) - COMPRA 05.07.2023	0,75	0,81	0,86	0,70	0,98	1,07	1,01	0,80	0,67	0,69	0,68	0,79
NTN-B 2055 (CURVA) - COMPRA 05.07.2023	0,75	0,81	0,93	0,70	0,98	0,99	1,01	0,80	0,74	0,69	0,68	0,71
NTN-B 2055 (CURVA) - COMPRA 11.10.2023	0,78	0,84	0,97	0,74	1,01	1,02	1,04	0,83	0,78	0,72	0,70	0,75
NTN-B 2060 (CURVA) - COMPRA 15.08.2022	0,78	0,84	0,89	0,74	1,01	1,10	1,05	0,83	0,70	0,72	0,71	0,83
NTN-F 2027 (Curva) - Compra 06.08.2021	1,06	0,72	0,76	0,79	0,72	0,68	1,03	0,72	0,72	0,76	0,72	0,83
NTN-F 2027 (Curva) - Compra 20.08.2021	1,15	0,79	0,83	0,87	0,79	0,75	1,11	0,79	0,79	0,83	0,79	0,91
NTN-F 2031 (Curva) - Compra 08.09.2021	1,21	0,83	0,87	0,91	0,83	0,79	1,17	0,83	0,83	0,87	0,83	0,95
NTN-F 2031 (CURVA) - COMPRA 25.10.2021	1,40	0,95	1,00	1,05	0,95	0,90	1,35	0,95	0,95	1,00	0,95	1,09
TÍTULO DA DÍVIDA AGRÁRIA - T.D.A.	1,58	0,35	0,49	6,35	-3,80	0,51	0,69	0,58	0,60	0,68	0,64	0,83
CDI	0,91	0,79	0,83	0,89	0,83	0,80	0,97	0,90	0,92	1,00	0,97	1,14
IPCA	0,38	0,21	0,46	0,38	0,16	0,83	0,42	0,56	0,28	0,24	0,26	0,23

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. ade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, ultar 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 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 ável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.

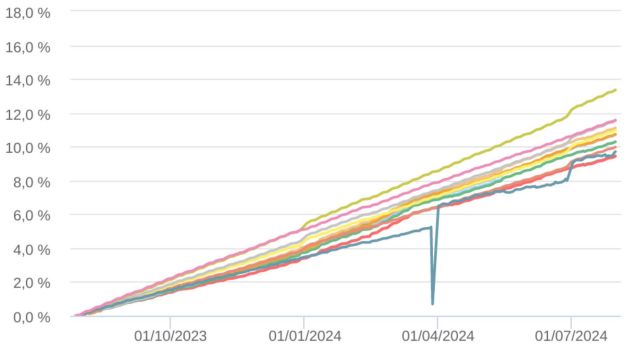
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB

:: PORTFÓLIOS E ATIVOS

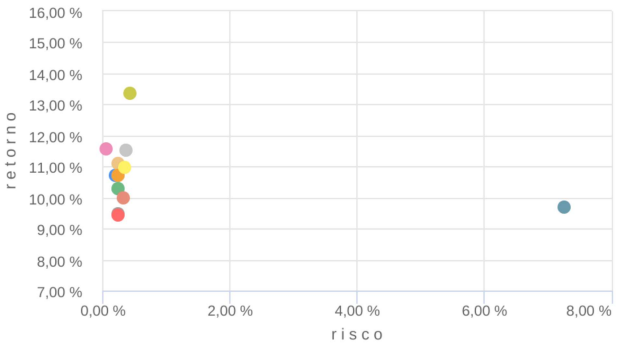
31/07/2024

Gráficos

Retorno Acumulado - 31/07/2023 a 31/07/2024 (diária)



Risco x Retorno - 31/07/2023 a 31/07/2024 (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. ade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, ultar 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 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 ável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB

:: PORTFÓLIOS E ATIVOS

31/07/2024

Resumo

12 meses

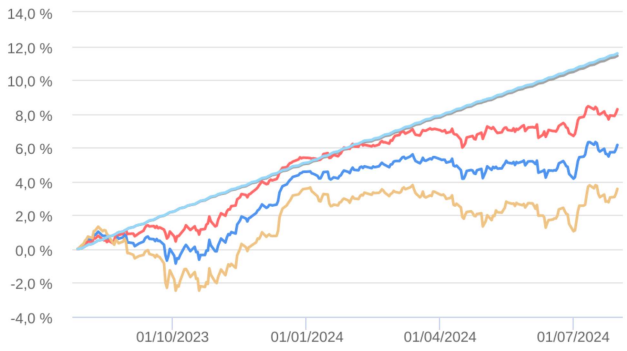
Nome	Retorno (%)				Sharpe	VaR	Volatilidade	Taxa de Administração
	Mês	Ano	06 meses	12 meses				
FI RENDA FIXA TITULOS PUBLICOS - Art 7º, I, b	1,65	1,51	1,58	6,15	-1,57	1,49%	3,14%	-
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,90	6,10	5,14	11,42	-2,12	0,03%	0,06%	0,2%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,33	2,71	2,20	8,26	-1,16	1,22%	2,57%	0,2%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	2,04	0,02	0,80	3,55	-1,75	2,00%	4,21%	0,15%

Retorno Mensal (%)

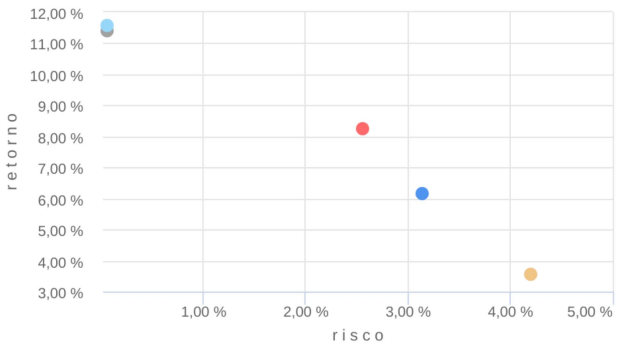
Nome	jul/24	jun/24	mai/24	abr/24	mar/24	fev/24	jan/24	dez/23	nov/23	out/23	set/23	ago/23
FI RENDA FIXA TITULOS PUBLICOS - Art 7º, I, b	1,65	-0,71	0,96	-1,19	0,25	0,46	0,11	2,05	2,62	-0,15	-0,38	0,18
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,90	0,77	0,82	0,88	0,83	0,79	0,96	0,89	0,90	0,97	0,97	1,14
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,33	-0,32	0,63	-0,55	0,50	0,43	0,67	1,46	2,47	0,35	0,15	0,73
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	2,04	-1,20	1,36	-1,99	-0,05	0,48	-0,57	2,76	2,82	-0,76	-1,02	-0,49
CDI	0,91	0,79	0,83	0,89	0,83	0,80	0,97	0,90	0,92	1,00	0,97	1,14
IMA-B	2,09	-0,97	1,33	-1,61	0,08	0,55	-0,45	2,75	2,62	-0,66	-0,95	-0,38
IMA-B 5	0,91	0,39	1,05	-0,20	0,77	0,59	0,68	1,46	1,80	-0,31	0,13	0,61
IMA-B 5+	3,24	-2,25	1,59	-2,91	-0,55	0,51	-1,47	3,94	3,39	-0,98	-1,92	-1,27
IRF-M	1,34	-0,29	0,66	-0,52	0,54	0,46	0,67	1,48	2,47	0,37	0,17	0,76
IRF-M 1	0,94	0,63	0,78	0,58	0,84	0,76	0,83	0,91	1,00	0,96	0,93	1,15
IRF-M 1+	1,55	-0,72	0,60	-1,02	0,43	0,34	0,60	1,73	3,14	0,12	-0,15	0,59

Gráficos

Retorno Acumulado - 31/07/2023 a 31/07/2024 (diária)



Risco x Retorno - 31/07/2023 a 31/07/2024 (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. ade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, ultar 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 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 ável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB

:: PORTFÓLIOS E ATIVOS

31/07/2024

Resumo

12 meses

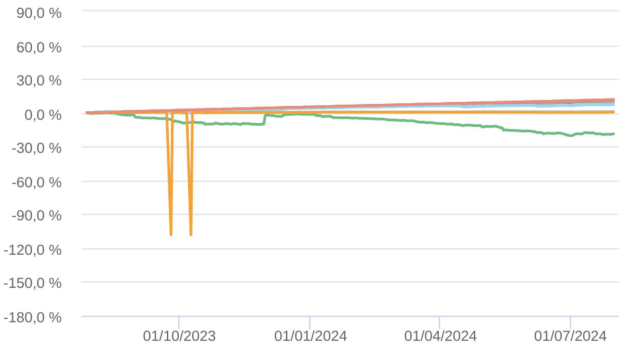
Nome	Retorno (%)				Sharpe	VaR	Volatilidade	Taxa de Administração
	Mês	Ano	06 meses	12 meses				
FI RENDA FIXA - Art 7º, III, a	0,93	3,87	3,10	8,23	-0,84	1,68%	3,54%	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,82	5,56	4,69	10,46	-16,91	0,03%	0,06%	1%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,97	6,26	5,29	11,66	1,36	0,03%	0,06%	0,2%
BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	0,94	3,52	2,73	7,77	-2,21	0,74%	1,56%	0,4%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,88	2,80	2,45	7,21	-1,51	1,24%	2,62%	0,4%
RECUPERAÇÃO BRASIL FI RENDA FIXA LP	1,39	-17,57	-14,47	-18,67	-2,77	5,31%	11,18%	2,3%
TOP FI RENDA FIXA	0,23	0,59	0,40	1,14	-30,76	0,15%	0,32%	0,9%
VITÓRIA RÉGIA FI RENDA FIXA LP	0,11	0,04	-0,07	0,43	-1,54	879,90%	1.853,10%	0%

Retorno Mensal (%)

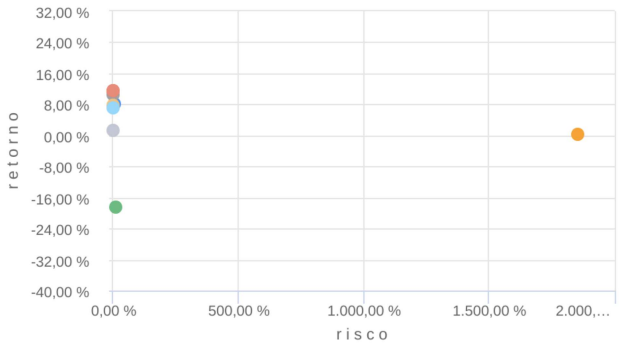
Nome	jul/24	jun/24	mai/24	abr/24	mar/24	fev/24	jan/24	dez/23	nov/23	out/23	set/23	ago/23
FI RENDA FIXA - Art 7º, III, a	0,93	0,33	0,79	-0,44	0,68	0,70	0,80	1,04	1,23	0,50	0,17	1,07
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,82	0,71	0,75	0,80	0,75	0,73	0,88	0,82	0,83	0,90	0,90	1,05
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,97	0,79	0,83	0,88	0,85	0,80	0,97	0,90	0,91	0,99	0,97	1,16
BTG PACTUAL EXPLORER INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	0,94	0,26	0,87	-0,87	0,71	0,74	0,84	1,11	1,26	0,43	-0,03	1,15
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,88	-0,20	0,75	-0,23	0,55	0,56	0,48	1,61	2,60	-0,21	-0,30	0,37
RECUPERAÇÃO BRASIL FI RENDA FIXA LP	1,39	-4,36	-3,97	-3,67	-3,09	-1,80	-3,45	1,00	8,88	-2,86	-3,79	-3,32
TOP FI RENDA FIXA	0,23	-0,05	0,07	0,13	0,08	-0,07	0,20	0,12	0,14	-0,05	0,12	0,19
VITÓRIA RÉGIA FI RENDA FIXA LP	0,11	-0,13	-0,01	0,04	0,00	-0,08	0,12	0,06	0,06	-0,11	0,14	0,22
CDI	0,91	0,79	0,83	0,89	0,83	0,80	0,97	0,90	0,92	1,00	0,97	1,14

Gráficos

Retorno Acumulado - 31/07/2023 a 31/07/2024 (diária)



Risco x Retorno - 31/07/2023 a 31/07/2024 (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 RESP LIMITADA FIF CIC 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. ade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, ultar 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 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 ável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB

:: PORTFÓLIOS E ATIVOS

31/07/2024

Resumo

12 meses

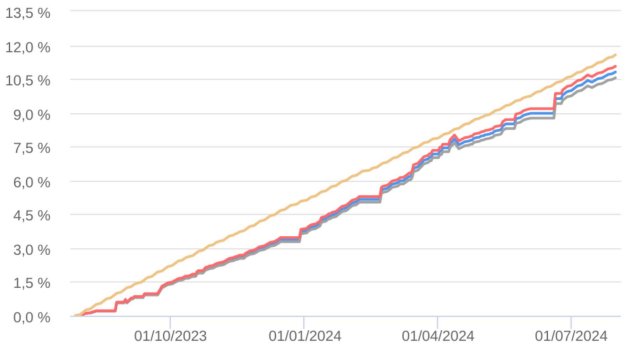
Nome	Retorno (%)				Sharpe	VaR	Volatilidade	Taxa de Administração
	Mês	Ano	06 meses	12 meses				
TÍTULOS PRIVADOS - Art 7º, IV	0,79	6,82	5,70	10,81	-0,62	0,52%	1,09%	-
LF BTG PACTUAL 05 ANOS - VENC. 31.03.2027	0,77	6,68	5,58	10,55	-0,85	0,51%	1,07%	-
LF BTG PACTUAL 10 ANOS - VENC. 31.03.2032	0,81	6,96	5,82	11,06	-0,41	0,53%	1,11%	-

Retorno Mensal (%)

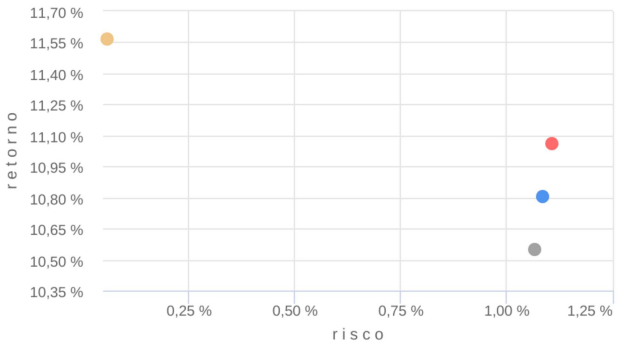
Nome	jul/24	jun/24	mai/24	abr/24	mar/24	fev/24	jan/24	dez/23	nov/23	out/23	set/23	ago/23
TÍTULOS PRIVADOS - Art 7º, IV	0,79	0,93	0,89	0,74	1,28	0,88	1,11	0,75	0,73	0,78	0,71	0,68
LF BTG PACTUAL 05 ANOS - VENC. 31.03.2027	0,77	0,91	0,87	0,72	1,26	0,87	1,09	0,74	0,71	0,76	0,69	0,66
LF BTG PACTUAL 10 ANOS - VENC. 31.03.2032	0,81	0,95	0,91	0,76	1,30	0,90	1,13	0,77	0,75	0,80	0,73	0,70
CDI	0,91	0,79	0,83	0,89	0,83	0,80	0,97	0,90	0,92	1,00	0,97	1,14
IPCA	0,38	0,21	0,46	0,38	0,16	0,83	0,42	0,56	0,28	0,24	0,26	0,23

Gráficos

Retorno Acumulado - 31/07/2023 a 31/07/2024 (diária)



Risco x Retorno - 31/07/2023 a 31/07/2024 (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. ade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, ultar 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 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 ável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB

:: PORTFÓLIOS E ATIVOS

31/07/2024

Resumo

12 meses

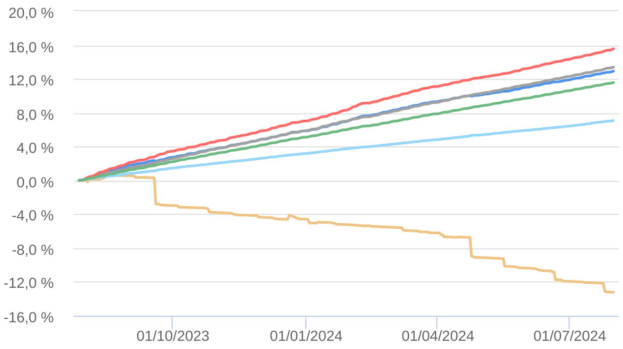
Nome	Retorno (%)				Sharpe	VaR	Volatilidade	Taxa de Administração
	Mês	Ano	06 meses	12 meses				
FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO - Art 7º, V, b	0,92	6,59	5,39	12,92	3,52	0,16%	0,34%	-
BRADESCO PERFORMANCE INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	1,02	7,13	5,90	13,39	10,46	0,07%	0,15%	0%
BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	1,13	8,01	6,63	15,56	10,20	0,16%	0,35%	0,5%
PIATÃ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO LP	-1,47	-9,07	-8,43	-13,23	-5,72	2,08%	4,37%	0,9%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	0,64	3,80	3,19	7,07	-29,47	0,07%	0,14%	1%

Retorno Mensal (%)

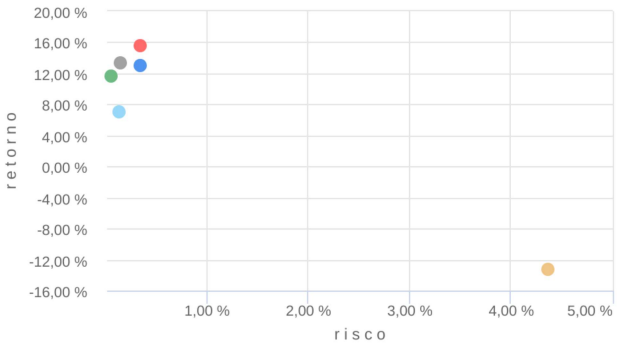
Nome	jul/24	jun/24	mai/24	abr/24	mar/24	fev/24	jan/24	dez/23	nov/23	out/23	set/23	ago/23
FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO - Art 7º, V, b	0,92	0,74	0,78	0,72	0,95	1,06	1,18	0,97	0,99	1,04	0,94	1,67
BRADESCO PERFORMANCE INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	1,02	0,87	0,91	0,99	0,98	0,93	1,22	0,96	1,06	1,17	1,09	1,37
BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	1,13	0,94	0,94	0,98	1,11	1,28	1,36	1,11	1,12	1,18	1,33	1,98
PIATÃ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO LP	-1,47	-1,74	-1,38	-3,11	-0,69	-0,32	-0,71	-0,23	-0,57	-0,86	-3,51	0,57
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	0,64	0,45	0,51	0,57	0,49	0,47	0,62	0,54	0,56	0,59	0,63	0,75
CDI	0,91	0,79	0,83	0,89	0,83	0,80	0,97	0,90	0,92	1,00	0,97	1,14

Gráficos

Retorno Acumulado - 31/07/2023 a 31/07/2024 (diária)



Risco x Retorno - 31/07/2023 a 31/07/2024 (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. ade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, ultar 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 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 ável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB

:: PORTFÓLIOS E ATIVOS

31/07/2024

Resumo — 12 meses

Nome	Retorno (%)				Sharpe	VaR	Volatilidade	Taxa de Administração
	Mês	Ano	06 meses	12 meses				
FI RENDA VARIÁVEL - Art 8º, I - Fundo de Ações	3,90	-3,17	0,70	8,60	-0,14	6,34%	13,36%	-
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	3,16	-5,94	-1,29	3,44	-0,49	6,47%	13,63%	1,72%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	3,43	-6,65	-2,46	-0,98	-0,80	6,51%	13,70%	2%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3,57	-2,15	-0,11	9,66	-0,04	7,16%	15,07%	1,9%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3,57	-2,23	-0,20	9,52	-0,05	7,13%	15,02%	1,9%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	5,13	4,28	6,04	16,73	0,42	6,00%	12,63%	1,9%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	2,10	-0,99	8,99	18,45	0,46	7,54%	15,89%	2%
XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES	5,04	-5,68	-2,63	6,11	-0,26	7,04%	14,82%	2%
XP INVESTOR FI AÇÕES	5,17	-5,98	-2,74	5,88	-0,27	7,16%	15,08%	2%

Retorno Mensal (%)

Nome	jul/24	jun/24	mai/24	abr/24	mar/24	fev/24	jan/24	dez/23	nov/23	out/23	set/23	ago/23
FI RENDA VARIÁVEL - Art 8º, I - Fundo de Ações	3,90	1,06	-3,06	-5,10	1,17	2,11	-2,94	5,66	11,86	-4,11	1,77	-4,05
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	3,16	1,37	-3,81	-3,03	-0,44	1,03	-4,13	5,87	12,42	-3,93	0,07	-5,14
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	3,43	0,26	-2,99	-5,67	1,06	0,80	-3,43	6,50	10,25	-4,68	-1,00	-4,87
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3,57	1,13	-2,01	-7,33	1,49	2,89	-1,49	2,69	13,15	-3,10	1,50	-3,35
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3,57	1,13	-2,02	-7,40	1,49	2,90	-1,49	2,67	13,02	-3,03	1,50	-3,34
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	5,13	1,80	-2,96	-1,02	0,97	2,81	-2,29	7,35	13,20	-4,29	-0,20	-4,95
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	2,10	0,20	-3,22	-2,34	6,72	2,24	-6,16	9,85	8,07	-6,04	7,65	-2,13
XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES	5,04	1,27	-3,67	-7,09	-1,00	2,22	-2,10	5,13	12,28	-3,85	2,33	-4,23
XP INVESTOR FI AÇÕES	5,17	1,28	-3,77	-6,93	-0,96	1,98	-2,42	5,26	12,52	-3,93	2,31	-4,39
CDI	0,91	0,79	0,83	0,89	0,83	0,80	0,97	0,90	0,92	1,00	0,97	1,14
Ibovespa	3,02	1,48	-3,04	-1,70	-0,71	0,99	-4,79	5,38	12,54	-2,94	0,71	-5,09

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. ade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, ultar 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 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 ável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.

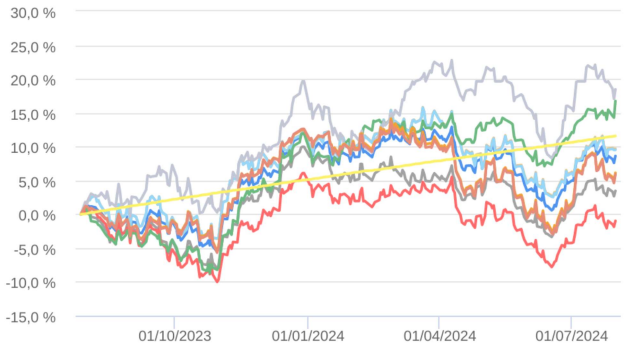
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB

:: PORTFÓLIOS E ATIVOS

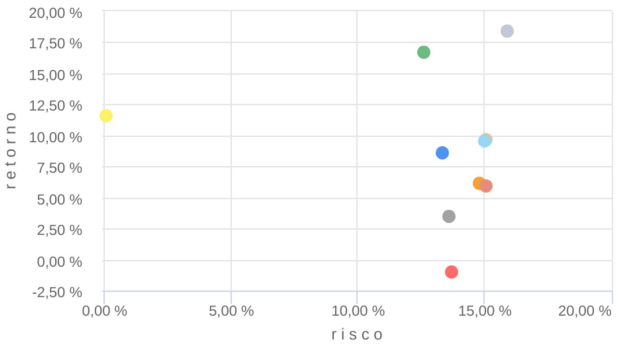
31/07/2024

Gráficos

Retorno Acumulado - 31/07/2023 a 31/07/2024 (diária)



Risco x Retorno - 31/07/2023 a 31/07/2024 (diária)



- FI RENDA VARIÁVEL - Art 8º, I - Fundo de Ações
- CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES
- CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES
- GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES
- GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES
- ITAÚ DUNAMIS 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. ade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, ultar 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 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 ável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB

:: PORTFÓLIOS E ATIVOS

31/07/2024

Resumo

12 meses

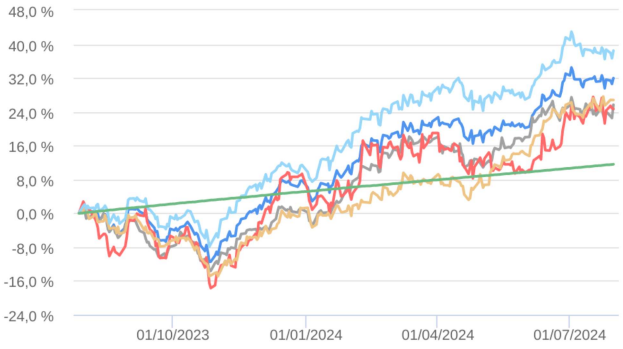
Nome	Retorno (%)				Sharpe	VaR	Volatilidade	Taxa de Administração
	Mês	Ano	06 meses	12 meses				
FI EXTERIOR - Art 9º, II - Investimento no Exterior	-0,70	22,51	18,71	31,94	1,11	7,78%	16,39%	-
FRANKLIN MARTIN CURRIE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	0,74	24,56	18,66	25,66	0,82	7,63%	16,07%	1%
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	0,64	14,02	15,76	24,63	0,54	12,89%	27,15%	0,8%
MAG GLOBAL SUSTAINABLE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO	0,93	25,36	24,57	26,77	0,83	8,15%	17,16%	0,7%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-2,20	24,29	18,07	38,45	1,29	8,56%	18,04%	0,8%

Retorno Mensal (%)

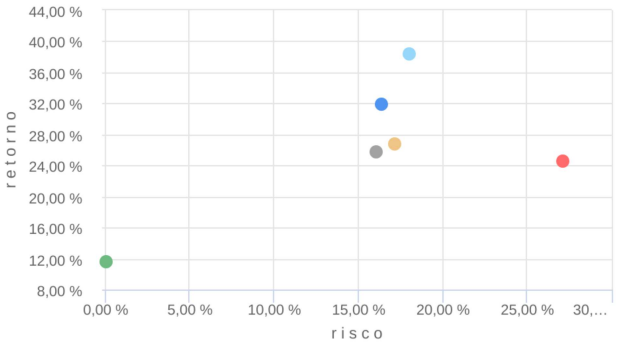
Nome	jul/24	jun/24	mai/24	abr/24	mar/24	fev/24	jan/24	dez/23	nov/23	out/23	set/23	ago/23
FI EXTERIOR - Art 9º, II - Investimento no Exterior	-0,70	10,67	0,68	-1,82	2,51	8,23	1,78	5,82	12,13	-5,69	-4,48	-0,66
FRANKLIN MARTIN CURRIE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	0,74	5,71	5,47	-4,72	2,80	9,02	3,84	4,57	8,85	-3,70	-6,76	-1,37
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	0,64	12,97	-3,10	-4,89	2,58	10,80	-4,25	11,65	14,65	-9,79	-3,03	-4,99
MAG GLOBAL SUSTAINABLE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO	0,93	10,13	4,45	1,11	3,25	3,51	-0,10	5,62	11,34	-7,96	-6,19	-0,93
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-2,20	11,56	-0,58	-0,58	2,16	8,42	4,04	4,02	12,46	-4,04	-3,77	1,35
Dólar	1,86	6,05	1,35	3,51	0,26	0,60	2,32	-1,91	-2,41	1,00	1,74	3,80
MSCI World (Moeda Original)	1,70	1,93	4,23	-3,83	2,98	4,11	1,14	4,81	9,21	-2,97	-4,45	-2,55

Gráficos

Retorno Acumulado - 31/07/2023 a 31/07/2024 (diária)



Risco x Retorno - 31/07/2023 a 31/07/2024 (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. ade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, ultar 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 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 ável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB

:: PORTFÓLIOS E ATIVOS

31/07/2024

Resumo

12 meses

Nome	Retorno (%)				Sharpe	VaR	Volatilidade	Taxa de Administração
	Mês	Ano	06 meses	12 meses				
FI EXTERIOR - Art 9º, III - BDR	1,45	36,20	26,73	49,74	1,94	7,53%	15,86%	-
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1,45	36,20	26,73	49,74	1,94	7,53%	15,86%	1,5%

Retorno Mensal (%)

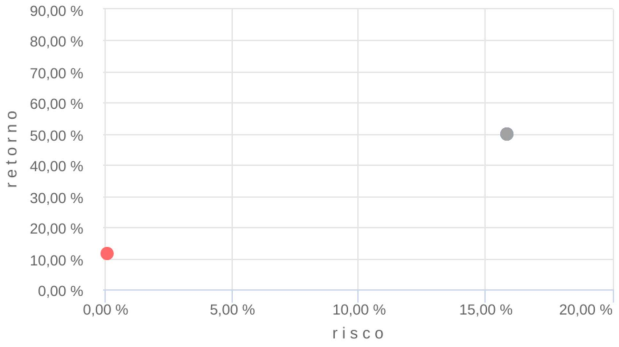
Nome	jul/24	jun/24	mai/24	abr/24	mar/24	fev/24	jan/24	dez/23	nov/23	out/23	set/23	ago/23
FI EXTERIOR - Art 9º, III - BDR	1,45	11,90	5,25	-2,08	1,57	7,85	6,27	2,77	8,83	0,19	-5,03	3,20
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1,45	11,90	5,25	-2,08	1,57	7,85	6,27	2,77	8,83	0,19	-5,03	3,20
MSCI World (Moeda Original)	1,70	1,93	4,23	-3,83	2,98	4,11	1,14	4,81	9,21	-2,97	-4,45	-2,55

Gráficos

Retorno Acumulado - 31/07/2023 a 31/07/2024 (diária)



Risco x Retorno - 31/07/2023 a 31/07/2024 (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. ade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, ultar 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 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 ável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:31
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:19
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 979002CB



REGISTROS DE ASSINATURAS ELETRÔNICAS

O arquivo rmijulho2024comanexos.pdf do documento **2024.17848.17920.9.021815** foi assinado pelos signatários

DADOS DO SIGNATÁRIO	DADOS DA ASSINATURA
MARCELO MAGALDI ALVES 313.785.362-15	20/08/2024 14:57:22 (LOGIN E SENHA)
FERNANDO KRICHANA DOS SANTOS 664.106.492-15	20/08/2024 15:45:29 (LOGIN E SENHA)
CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES 892.972.102-87	21/08/2024 09:24:59 (LOGIN E SENHA)
EDUARDO ALVES MARINHO 931.181.472-53	21/08/2024 12:08:42 (LOGIN E SENHA)
FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO 704.239.202-78	29/08/2024 09:54:19 (LOGIN E SENHA)
ELI CAMILO CUSTÓDIO 163.051.322-91	30/08/2024 10:46:31 (LOGIN E SENHA)

Manaus Previdência
Autarquia Municipal

Prefeitura de Manaus

PARECER Nº 10/2024 – COMINV/MANAUS PREVIDÊNCIA

Os membros participantes da 16ª reunião ordinária de 2024 do Comitê de Investimentos da Manaus Previdência, ocorrida em 20 de agosto, no desempenho de suas competências de que trata o artigo 9º, inciso I, da **Resolução** Municipal Nº 02, de 29 de agosto de 2023, do Conselho Municipal de Previdência, **APROVAM** o Relatório Mensal de Investimentos referente ao mês de **julho de 2024.**

Manaus/AM, 20 de agosto 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

ELI CAMILO CUSTÓDIO
Membro do Cominv

EDUARDO ALVES MARINHO
Membro do Cominv

MARCELO MAGALDI
Membro do Cominv

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: ELI CAMILO CUSTÓDIO EM 30/08/2024 10:46:32
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO EM 29/08/2024 09:54:20
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 9799C95D



REGISTROS DE ASSINATURAS ELETRÔNICAS

O arquivo parecern10.2024aprovaormidejulhode2024.pdf do documento **2024.17848.17920.9.021815** foi assinado pelos signatários

DADOS DO SIGNATÁRIO	DADOS DA ASSINATURA
MARCELO MAGALDI ALVES 313.785.362-15	20/08/2024 14:57:23 (LOGIN E SENHA)
FERNANDO KRICHANA DOS SANTOS 664.106.492-15	20/08/2024 15:45:30 (LOGIN E SENHA)
CARLOS MICHAEL MAIA RODRIGUES 892.972.102-87	21/08/2024 09:25:00 (LOGIN E SENHA)
EDUARDO ALVES MARINHO 931.181.472-53	21/08/2024 12:08:43 (LOGIN E SENHA)
FLAVIO RODRIGUES DE CASTRO 704.239.202-78	29/08/2024 09:54:20 (LOGIN E SENHA)
ELI CAMILO CUSTÓDIO 163.051.322-91	30/08/2024 10:46:32 (LOGIN E SENHA)

Manaus Previdência
Autarquia Municipal

Prefeitura de Manaus

PARECER 14/2024 – CONSELHO FISCAL – COFIS

Os membros participantes da 9ª Reunião Ordinária de 2024 do Conselho Fiscal (COFIS) da Autarquia **MANAUS PREVIDÊNCIA – MANAUSPREV**, ocorrida em 03 de setembro 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 julho 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, 03 de setembro 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: SUANI DOS SANTOS BRAGA EM 03/09/2024 11:39:10
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: IZOMITEL PESSOA DE QUEIROZ FILHO EM 03/09/2024 11:36:20
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 4 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 82883573



REGISTROS DE ASSINATURAS ELETRÔNICAS

O arquivo parecern14.2024cofisaprovarmidejulhode2024.pdf do documento **2024.17848.17920.9.021815** foi assinado pelos signatários

DADOS DO SIGNATÁRIO	DADOS DA ASSINATURA
ELIZANGELA MACHADO DE MACÊDO 601.961.652-53	03/09/2024 10:35:58 (LOGIN E SENHA)
RUTH FREIRE DE SOUZA 830.999.052-91	03/09/2024 10:42:01 (LOGIN E SENHA)
MARIA ERNESTINA DA SILVA RAMOS 202.549.112-34	03/09/2024 11:29:52 (LOGIN E SENHA)
ELI CAMILO CUSTÓDIO 163.051.322-91	03/09/2024 11:31:21 (LOGIN E SENHA)
IZOMITEL PESSOA DE QUEIROZ FILHO 031.534.102-59	03/09/2024 11:36:20 (LOGIN E SENHA)
SUANI DOS SANTOS BRAGA 313.636.602-68	03/09/2024 11:39:10 (LOGIN E SENHA)

Manaus Previdência
Autarquia Municipal

Prefeitura de Manaus

PARECER Nº 20/2024 – CMP/MANAUS PREVIDÊNCIA

Os membros participantes da 9ª Reunião Ordinária do ano de 2024 do Conselho Municipal de Previdência (CMP) da Manaus Previdência – MANAUSPREV, realizada em 12 de setembro 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 **Julho de 2024**, deliberam por sua **APROVAÇÃO** final.

Manaus/AM, 12 de setembro 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

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: ROSIANE DE BRITO GUEDES EM 13/09/2024 09:20:25
DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: VANESSA CARDOSO CARNEIRO EM 12/09/2024 15:14:09
DOCUMENTO ASSINADO ELETRONICAMENTE POR MAIS 6 USUARIOS
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CODIGO: 97594C4F



REGISTROS DE ASSINATURAS ELETRÔNICAS

O arquivo do documento **2024.17848.17920.9.021815** foi assinado pelos signatários

DADOS DO SIGNATÁRIO	DADOS DA ASSINATURA
DARLEN DA SILVA MONTEIRO 572.071.782-04	12/09/2024 12:00:12 (LOGIN E SENHA)
CLÁUDIA SERIQUE E SILVA 567.588.712-15	12/09/2024 12:18:18 (LOGIN E SENHA)
MARCELO MAGALDI ALVES 313.785.362-15	12/09/2024 12:26:29 (LOGIN E SENHA)
LUCILENE FLORÊNCIO VIANA 201.980.942-72	12/09/2024 12:30:50 (LOGIN E SENHA)
ROSSICLEIDE BRANDÃO DA FONSECA 034.316.572-49	12/09/2024 12:30:55 (LOGIN E SENHA)
DANIELA CRISTINA DA EIRA CORREA BENAYON 474.482.292-49	12/09/2024 13:05:21 (CERTIFICADO DIGITAL)
VANESSA CARDOSO CARNEIRO 343.958.222-15	12/09/2024 15:14:09 (LOGIN E SENHA)
ROSIANE DE BRITO GUEDES 618.356.252-15	13/09/2024 09:20:25 (LOGIN E SENHA)

Manaus Previdência
Autarquia Municipal

Prefeitura de Manaus

ERRATA

Informamos que a tabela de rentabilidade localizada na página 18, contêm erros na coluna do período de 12 meses.

Segue abaixo a tabela com os valores corretos:

Rentabilidade (%)						
	jul/24	jun/24	mai/24	2024	12 m	24 m
Carteira PPREV	1,43%	1,61%	0,12%	5,72%	11,68%	24,98%
Carteira Ex Fundos Problemáticos	1,47%	1,64%	0,13%	5,74%	11,59%	24,92%
Meta Atuarial	0,84%	0,61%	0,88%	5,90%	9,73%	19,72%
CDI	0,91%	0,79%	0,83%	6,18%	11,52%	26,62%
Ibovespa	3,02%	1,48%	-3,04%	-4,87%	4,67%	23,71%

Os demais dados do Relatório permanecem inalterados.

(*Assinatura digital)*
Fernando Krichanã dos Santos
Superintendente de Investimentos e.e.

DOCUMENTO ASSINADO POR LOGIN E SENHA POR: FERNANDO KRICHANA DOS SANTOS EM 16/09/2024 14:20:16
VERIFIQUE A AUTENCIDADE DESTE DOCUMENTO EM https://siged.manaus.am.gov.br/cadastrousuarioexterno/verificacao.aspx INFORMANDO O CÓDIGO: 6293AC12