



## **1. Cenário Econômico**

Seguindo o melhor momento do mercado, o mês de maio, foi de mais um mês com retornos positivos para as carteiras de investimentos dos RPPS. Mais uma vez, seguindo o fechamento da curva de juros, os fundos atrelados a índices de inflação e os demais ativos de renda fixa fecharam no positivo. A renda variável, em mais um mês fechou no positivo, reduzindo o acumulado negativo no ano. E depois de um mês negativo, os fundos ligados ativos no exterior também fecharam no positivo. Com isso, o mês de maio foi de bom resultado para as carteiras, principalmente para aqueles que possuem uma boa diversificação.

## **2. Análise da Carteira de Investimentos**

### **2.1 - Carteira de Investimentos**

No final do período, a carteira apresentou números de fechamento que evidenciam que suas posições estão em conformidade com os limites definidos nos artigos da Resolução 4.963/2021.

### **2.2 - Enquadramento na Resolução e Política de Investimentos**

A situação da carteira ao término do período evidencia que, apesar de alguns objetivos ainda não terem sido alcançados (estratégias alvo), fica demonstrado o cumprimento da legislação em vigor, bem como da própria Política de Investimentos definida para o ano de 2023. As diferenças verificadas entre os percentuais da carteira em relação à Política de Investimentos demonstram apenas que os objetivos pretendidos para o ano de 2023 ainda não foram integralmente atingidos.

### **2.3 - Rentabilidade e Risco (por ativo)**

As séries históricas da rentabilidade e risco por ativo da carteira em relação aos respectivos benchmarks, demonstra a qualidade e consistência de seus resultados.



## **2.4 - Distribuição por Benchmarks**

A carteira mantém a totalidade dos recursos aplicados em ativos financeiros indexados, e/ou que buscam replicar indexadores adequados, e em conformidade, com os objetivos de rentabilidade e liquidez pretendidos.

## **2.5 - Distribuição por Classificação ANBIMA**

Os fundos de investimentos presentes na carteira seguem as características de estratégias e fatores de riscos definidas pela ANBIMA. Esse agrupamento facilita a comparação de performance entre os diferentes fundos, assim como auxilia o processo de decisão de investimento.

## **2.6 - Distribuição por Gestoras e Administradoras**

As gestoras e administradoras dos fundos de investimento presentes na carteira são instituições regulares junto aos órgãos de controle e fiscalização do Mercado de Capitais, assim como apresentam histórico de regularidade no ambiente de gestão e administração de investimentos.

## **2.7 - Retorno da Carteira de Investimentos**

Os ativos de renda fixa, seguem apresentando bons resultados, e por mais um mês, o fechamento da curva de juros tem beneficiado os ativos atrelados a inflação. Destacamos os fundos de investimentos atrelados ao CDI, que apresentaram bons retornos, dados os níveis inflacionários atuais, assim como os fundos IMA que por terem carteiras formadas por maior número de vértices, tem maior chance de capturar bons retornos ao longo de toda a curva de juros. Os segmentos de renda variável, investimentos no exterior e investimentos estruturados se mantem atrativos devido a redução da volatilidade geral observada nos mercados.

## **2.8 - Retorno dos Fundos de Investimentos**

Os fundos de investimento presentes na carteira são regulados, e estão em conformidade com a legislação normativa dos investimentos dos RPPS. Além de estarem adequados à execução da Política de Investimentos aprovada para o ano de 2023, assim como também atendem os objetivos de rentabilidade e liquidez pretendidos.

Rio de Janeiro, 09 de junho de 2023.

# GESTOR RECEITAS PREVIDENCIÁRIAS

## RECEITA E DESPESAS DE APLICAÇÕES DE RECURSOS

### MAIO de 2023

NITERÓI PREV 28.543.098/0001-42	SALDO 30.04.2023	APLICAÇÕES	RESGATE	RENTABILIDADE	SALDO 31.05.2023	Rentabilidade	QUANTIDADE COTAS
						%	
BB - FLUXO	76.193,59	113,70	-113,70	795,78	76.989,37	1,04	30.203,913563
ITAÚ - Referenciado DI	14.689.729,98			170.454,71	14.860.184,69	1,16	3.724,304190
ITAÚ - Soberano RF	1.557.830,31	2.500.000,00		28.944,05	4.086.774,36	0,71	67.806,048870
CAIXA - DISPONIB.	166.026,71			1.610,53	167.637,24	0,97	74.571,925074
CAIXA- ALIANÇA	15.522.409,96			171.099,19	15.693.509,15	1,10	2.994.018,862673
<b>TOTAL CARTEIRA</b>	<b>32.012.190,55</b>	<b>2.500.113,70</b>	<b>-113,70</b>	<b>372.904,26</b>	<b>34.885.094,81</b>		<b>3.170.325,054370</b>

FINANCEIRO 18.531.246/0001-55	SALDO 30.04.2023	APLICAÇÕES	RESGATE	RENTABILIDADE	SALDO 31.05.2023	Rentabilidade	QUANTIDADE COTAS
						%	
BB - FLUXO	265.352,86	14.428,18	-37.657,16	2.818,14	244.942,02	1,16	96.093,883112
ITAÚ - Referenciado DI	20.416.650,45	3.000.000,00	-2.500.000,02	264.312,67	21.180.963,10	1,26	5.308,436680
ITAÚ - Global comprev	22.371.538,23		-200.000,00	332.830,75	22.504.368,98	1,50	1.701.159,151110
ITAÚ - Soberano RF	4.429.493,72		-2.700.000,00	33.957,00	1.763.450,72	1,96	29.258,436050
CAIXA - DISPONIB.	372.756,58			3.615,90	376.372,48	0,97	167.425,925692
<b>TOTAL CARTEIRA</b>	<b>47.855.791,84</b>	<b>3.014.428,18</b>	<b>-5.437.657,18</b>	<b>637.534,46</b>	<b>46.070.097,30</b>		<b>1.999.245,832644</b>

PREVIDENCIÁRIO 18.531.204/0001-14	SALDO 30.04.2023	APLICAÇÕES	RESGATE	RENTABILIDADE	SALDO 31.05.2023	Rentabilidade	QUANTIDADE COTAS
						%	
BB - FLUXO	63.496,84	2.559.793,87	-2.600.301,10	2.386,94	25.376,55		9.955,543256
BB - PERFIL	207.859.942,45		-20.000.000,00	2.339.263,54	190.199.205,99	1,25	66.628.018,816221
BB - IRF-M1	42.012.314,33			471.186,62	42.483.500,95	1,12	12.912.841,758523
BB - IPCA I	2.547.009,86		-2.559.793,87	12.784,01	0,00	0,50	0,000000
BB - IPCA 2023	56.412.692,89		-56.772.191,29	359.498,40	0,00	0,64	0,000000
BB - IPCA 2024	52.332.910,18			-4.704,83	52.328.205,35	-0,01	46.075.121,242438
BB - Vert IPCA 2024	0,00	59.372.191,29		-106.748,82	59.265.442,47	-0,18	59.400.322,903059
BB - IRF-M	0,00	20.000.000,00		103.272,28	20.103.272,28	0,52	2.874.816,805389
BB - MULT MACRO	30.680.627,50			306.592,14	30.987.219,64	1,00	7.292.167,672961
ITAÚ - Global PI Amort	51.178.055,65	2.035.963,98		779.220,16	53.993.239,79	1,46	4.081.478,310590
ITAÚ - Vert. 2024	0,00	100.000.000,00		-108.265,16	99.891.734,84	-0,11	101.371.865,455210
ITAÚ - LEGEND	10.134.214,28			197.508,60	10.331.722,88	1,95	677.545,561520
ITAÚ - Referenciado DI	186.243.754,69	8.000.000,03	-100.000.000,02	1.229.040,65	95.472.795,35	1,30	23.927,679120
ITAÚ - Soberano RF	1.925.181,60	900.000,00	-1.700.000,00	27.424,97	1.152.606,57	2,44	19.123,565620
ITAÚ - Alocação Din.	29.321.654,77	4.000.000,00		754.104,57	34.075.759,34	2,26	1.554.645,677800
ITAÚ - Juros Moedas	9.734.723,01			126.279,96	9.861.002,97	1,24	24.319,771610
ITAÚ - High Grade	20.238.808,89			228.284,95	20.467.093,84	1,13	549.008,687960
BRADESCO - PREMIUM	26.349.492,41			305.894,80	26.655.387,21	1,16	1.736.937,199000
BTG - Tesouro IPCA	10.014.314,39			55.471,43	10.069.785,82	0,55	1.348.531,280869
XP - TREND	301.771,06	1.960,00		3.477,63	307.208,69	1,14	196.813,25894496
CAIXA- ALIANÇA	183.457.920,06			2.022.205,50	185.480.125,56	1,10	35.386.030,569430
CAIXA - DISPONIB.	27.447,69	38.033,34	-38.033,34	315,71	27.763,40	0,78	12.350,301219
CAIXA - REFERNC. DI	126.000.573,27		-20.000.000,00	1.432.397,80	107.432.971,07	1,13	23.163.047,576110
CAIXA- IPCA-2023	75.866.045,71		-76.347.438,01	481.392,30	0,00	0,63	0,000000
CAIXA- IMA-B	0,00	20.000.000,00		106.601,14	20.106.601,14	0,53	4.789.125,237540
CAIXA- Vert IPCA-2024	0,00	76.347.438,01		-136.424,22	76.211.013,79	-0,18	76.347.533,866419
CAIXA- Juros Moedas	45.896.707,33			622.412,74	46.519.120,07	1,36	17.745.196,014213
CAIXA- RIO BRAVO	220.990,00			17.465,00	238.455,00	7,90	3.500,000000
<b>TOTAL CARTEIRA</b>	<b>1.168.820.648,86</b>	<b>293.255.380,52</b>	<b>-280.017.757,63</b>	<b>11.628.338,81</b>	<b>1.193.686.610,56</b>		<b>464.224.224,755022</b>

Carteira - CEF	452.253.568,90	35,48%
Carteira - BB	395.714.154,62	31,05%
Carteira - Itaú	389.641.697,43	30,57%
Carteira - Bradesco	26.655.387,21	2,09%
Carteira - XP	307.208,69	0,02%
Carteira - BTG	10.069.785,82	0,79%

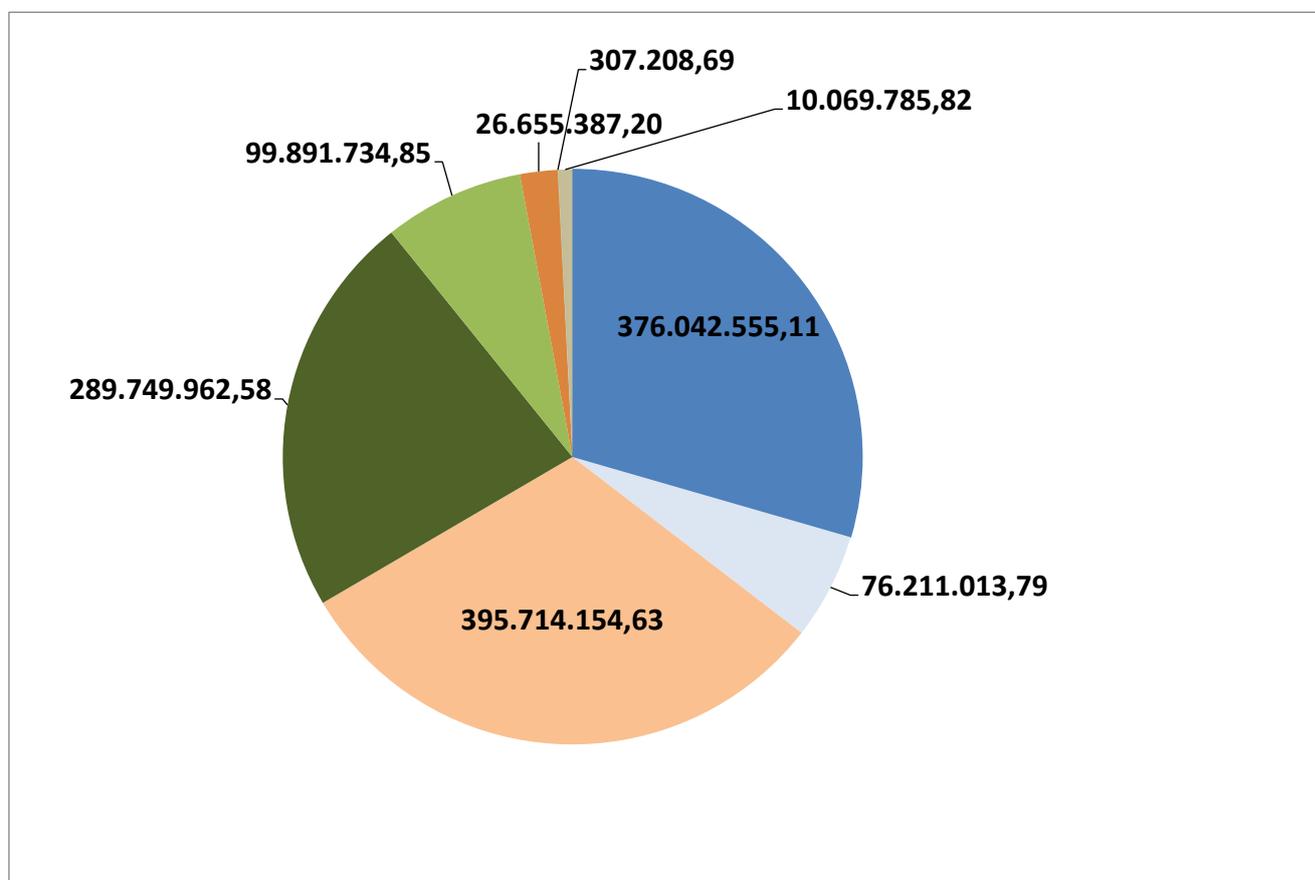
100,00%

<b>1.248.688.631,25</b>	<b>298.769.922,40</b>	<b>-285.455.528,51</b>	<b>12.638.777,53</b>	<b>1.274.641.802,67</b>	<b>1,00%</b>	<b>469.393.795,642035</b>
-------------------------	-----------------------	------------------------	----------------------	-------------------------	--------------	---------------------------

## NITERÓI PREV

### Enquadramento na Resolução nº 4.604 por Gestores - Base MAIO/2023

CAIXA ECONOMICA FEDERAL	376.042.555,11	29,50%
CAIXA DTVM	76.211.013,79	5,98%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.	395.714.154,63	31,05%
ITAÚ UNIBANCO S.A.	289.749.962,58	22,73%
ITAÚ UNIBANCO ASSET MANAGEMENT S.A.	99.891.734,85	7,84%
BRAM - BRADESCOASSET MANAGEMENT S.A.	26.655.387,20	2,09%
XP VISTA ASSET MANAGEMENT LTDA	307.208,69	0,02%
BTG PACTUAL	10.069.785,82	0,79%
	<b>1.274.641.802,67</b>	<b>100,00%</b>



Niterói Previdência  
NITERÓI PREV

Alocação adequada à Resolução CMN nº 4.963/2021

MAIO DE 2023

RENTA FIXA

	PL	R\$	%
<i>ARTIGO 7º inciso I alinea "b" = 100% Títulos Públicos</i>			
BB IRF M1 TP FI RF	11.328.882/0001-35	42.483.500,95	3,33%
BB IRF M TP RF	07.111.384/0001-69	20.103.272,28	1,58%
BB TP IPCA FI RF	15.486.093/0001-83	0,00	0,00%
BB TP IPCA I FI RF	19.303.793/0001-46	0,00	0,00%
BB TP XXI FI RF	44.345.590/0001-60	52.328.205,35	4,11%
BB Vert 2024	49.964.484/0001-88	59.265.442,47	4,65%
CAIXA BR DIPONIBILIDADE FIC RF	14.508.643/0001-55	571.773,12	0,04%
CAIXA ALIANÇA TP FI RF	05.164.358/0001-73	201.173.634,71	15,78%
CAIXA FI BR 2024 X TP RF	50.635.944/0001-03	76.211.013,79	5,98%
CAIXA FI BR IMA-B TP RF LP	10.740.658/0001-93	20.106.601,14	1,58%
CAIXA BR 2023 TP FI RF	44.683.378/0001-02	0,00	0,00%
ITAÚ SOBERANO RF SIMPLES FICFI	06.175.696/0001-73	7.002.831,65	0,55%
ITAÚ INST LEGEND FIC RF	29.241.799/0001-90	10.331.722,88	0,81%
ITAÚ ALOCAÇÃO DINAMICA	21.838.150/0001-49	34.075.759,34	2,67%
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 RF FI	50.236.636/0001-05	99.891.734,84	7,84%
XP TREND PÓS FIXADO	26.559.284/0001-44	307.208,69	0,02%
BTG TESOIRO IPCA	07.539.298/0001-51	10.069.785,82	0,79%
<i>ARTIGO 7º inciso III alinea "a" = Referenciado</i>			
BB FLUXO FIC RF	13.077.415/0001-05	347.307,94	0,03%
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI	13.077.418/0001-49	190.199.205,99	14,92%
CAIXA BR FI RF REFERENCIADO DI LP	03.737.206/0001-97	107.432.971,07	8,43%
ITAÚ INST FI REFERENCIADO DI	00.832.435/0001-00	131.513.943,14	10,32%
ITAÚ INST GLOBAL DINÂMICO FIC RF	29.241.799/0001-91	76.497.608,77	6,00%
BRANCO PREMIUM RF REFERENCIADO DI	29.241.799/0001-92	26.655.387,21	2,09%
<i>ARTIGO 7º inciso V alinea "b" = Crédito Privado</i>			
ITAÚ - High Grade	09.093.883/0001-04	20.467.093,84	1,61%
		<b>1.187.036.004,99</b>	<b>93,13%</b>

RENTA VARIÁVEL

<i>ARTIGO 10º inciso I = Fundos Multimercado</i>			
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	05.862.491/0001-75	30.987.219,64	2,43%
ITAÚ INST MM JUROS E MOEDAS FICFI	00.973.117/0001-51	9.861.002,97	0,77%
CAIXA FI JUROS E MOEDAS MM	14.120.520/0001-42	46.519.120,07	3,65%
<i>ARTIGO 11º = Fundos Imobiliários</i>			
CAIXA RIO BRAVO FDO DE FUNDOS FII	17.098.794/0001-70	238.455,00	0,02%
		<b>87.605.797,68</b>	<b>6,87%</b>

**TOTAL 1.274.641.802,67 100,00%**

**NITERÓI PREV**

**Enquadramentos na Portaria nº 1.467/2022 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (MAIO / 2023)**

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira (R\$)	Carteira %	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior	
				Inferior	Alvo	Superior	%	(R\$)
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%			0,00%	1,00%	100,00%	100,00%	1.274.641.802,67
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	633.922.487,03	49,73%	0,00%	38,00%	100,00%	50,27%	640.719.315,64
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%			0,00%		100,00%	100,00%	1.274.641.802,67
Artigo 7º, Inciso II	5,00%			0,00%		5,00%	5,00%	63.732.090,13
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	532.646.424,12	41,79%	0,00%	47,00%	60,00%	18,21%	232.138.657,48
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%			0,00%		60,00%	60,00%	764.785.081,60
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%			0,00%	1,00%	20,00%	20,00%	254.928.360,53
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%			0,00%	1,00%	5,00%	5,00%	63.732.090,13
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	20.467.093,84	1,61%	0,00%	1,00%	5,00%	3,39%	43.264.996,29
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' c '	5,00%			0,00%	1,00%	5,00%	5,00%	63.732.090,13
<b>Total Renda Fixa</b>		1.187.036.004,99	93,13%					

**Enquadramentos na Portaria nº 1.467/2022 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL) - base (MAIO / 2023)**

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira (R\$)	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior	
				Inferior	Alvo	Superior	%	(R\$)
Artigo 8º - Inciso I	30,00%			0,00%	3,00%	30,00%	30,00%	382.392.540,80
Artigo 8º - Inciso II	30,00%			0,00%		30,00%	30,00%	382.392.540,80
<b>Total Investimentos Renda Variável</b>		0,00	0,00%					

**Enquadramentos na Portaria nº 1.467/2022 e Política de Investimento (EXTERIOR) - base (MAIO / 2023)**

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira (R\$)	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior	
				Inferior	Alvo	Superior	%	(R\$)
Artigo 9º - Inciso I	10,00%			0,00%		10,00%	10,00%	127.464.180,27
Artigo 9º - Inciso II	10,00%			0,00%		10,00%	10,00%	127.464.180,27
Artigo 9º - Inciso III	10,00%			0,00%	2,00%	10,00%	10,00%	127.464.180,27
<b>Total Investimentos no Exterior</b>		0,00	0,00%					

**Enquadramentos na Portaria nº 1.467/2022 e Política de Investimento (ESTRUTURADO) - base (MAIO / 2023)**

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira (R\$)	Carteira %	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior	
				Inferior	Alvo	Superior	%	(R\$)
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	87.367.342,68	6,85%	0,00%	4,00%	10,00%	3,15%	40.096.837,59
Artigo 10º, Inciso II	5,00%			0,00%		5,00%	5,00%	63.732.090,13
Artigo 10º, Inciso III	5,00%			0,00%		5,00%	5,00%	63.732.090,13
<b>Total Investimentos Estruturados</b>		87.367.342,68	6,85%					

**Enquadramentos na Portaria nº 1.467/2022 e Política de Investimento (FDO IMOBILIÁRIO) - base (MAIO / 2023)**

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira (R\$)	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior	
				Inferior	Alvo	Superior	%	(R\$)
Artigo 11º	5,00%	238.455,00	0,02%	0,00%	1,00%	5,00%	4,98%	63.493.635,13
<b>Total Exterior</b>	10,00%	238.455,00	0,02%	0,00%	1,00%	5,00%		

**Enquadramentos na Portaria nº 1.467/2022 e Política de Investimento (EMPREST. CONSIGNADO) - base (MAIO / 2023)**

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira (R\$)	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior	
				Inferior	Alvo	Superior	%	(R\$)
Artigo 12º	5,00%			0,00%		5,00%	5,00%	63.732.090,13
<b>Total Exterior</b>	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%		

<b>Total Carteira Nitprev</b>		1.274.641.802,67	100,00%					
-------------------------------	--	------------------	---------	--	--	--	--	--

Niterói Previdência  
NITERÓI PREV

Retorno dos Fundos **MAIO / 2023**

FUNDOS	ATIVO		RETORNO				
	CARTEIRA		REAL (\$)				%
	REAL (\$)	%	NIT PREV	FINANCEIRO	PREVIDENCIARIO	TOTAL	RENTAB.
<b>BBrasil - IRF M1</b>	42.483.500,95	3,33 %	0,00	0,00	471.186,62	471.186,62	1,12 %
<b>BBrasil - IRF M</b>	20.103.272,28	1,58	0,00	0,00	103.272,28	103.272,28	0,52 %
<b>BBrasil - IPCA I 2022</b>	0,00	0,00 %	0,00	0,00	12.784,01	12.784,01	0,50 %
<b>BBrasil - IPCA 2023</b>	0,00	0,00 %	0,00	0,00	359.498,40	359.498,40	0,64 %
<b>BBrasil - IPCA XXI 2024</b>	52.328.205,35	4,11 %	0,00	0,00	-4.704,83	-4.704,83	-0,01 %
<b>BBrasil - Vert IPCA 2024</b>	59.265.442,47	4,65	0,00	0,00	-106.748,82	-106.748,82	-0,18 %
<b>BBrasil - FLUXO</b>	347.307,94	0,03 %	795,78	2.818,14	2.386,94	6.000,86	0,20 %
<b>BBrasil - PERFIL</b>	190.199.205,99	14,92 %	0,00	0,00	2.339.263,54	2.339.263,54	1,13 %
<b>BBrasil - MM MACRO</b>	30.987.219,64	2,43 %	0,00	0,00	306.592,14	306.592,14	0,43 %
<b>TOTAL BB</b>	<b>395.714.154,62</b>	<b>31,05 %</b>	<b>795,78</b>	<b>2.818,14</b>	<b>3.483.530,28</b>	<b>3.487.144,20</b>	<b>0,89%</b>
<b>Caixa - DISPONIBILIDADE</b>	571.773,12	0,04 %	1.610,53	3.615,90	315,71	5.542,14	0,92 %
<b>Caixa - ALIANÇA</b>	201.173.634,71	15,78 %	171.099,19	0,00	2.022.205,50	2.193.304,69	1,10 %
<b>Caixa - FI BR 2024 X TP RF</b>	76.211.013,79	5,98	0,00	0,00	-136.424,22	-136.424,22	-0,18 %
<b>Caixa - FI BR IMA-B TP RF LP</b>	20.106.601,14	1,58	0,00	0,00	106.601,14	106.601,14	0,53 %
<b>Caixa - IPCA 2023</b>	0,00	0,00 %	0,00	0,00	481.392,30	481.392,30	0,63 %
<b>Caixa - REFERENCIADO DI</b>	107.432.971,07	8,43 %	0,00	0,00	1.432.397,80	1.432.397,80	1,14 %
<b>Caixa - JUROS MOEDAS</b>	46.519.120,07	3,65 %	0,00	0,00	622.412,74	622.412,74	1,36 %
<b>Caixa - RIO BRAVO</b>	238.455,00	0,02 %	0,00	0,00	17.465,00	17.465,00	7,90 %
<b>TOTAL CAIXA</b>	<b>452.253.568,90</b>	<b>35,48 %</b>	<b>172.709,72</b>	<b>3.615,90</b>	<b>4.546.365,97</b>	<b>4.722.691,59</b>	<b>1,06%</b>
<b>ITAÚ - ASSETNTN-B 2024 RF FI</b>	99.891.734,84	7,84 %	0,00	0,00	-108.265,16	-108.265,16	-0,11 %
<b>ITAÚ - Global</b>	76.497.608,77	6,00	0,00	332.830,75	779.220,16	1.112.050,91	1,47 %
<b>ITAÚ - LEGEND</b>	10.331.722,88	0,81 %	0,00	0,00	197.508,60	197.508,60	1,95 %
<b>ITAÚ - REFERENC. DI</b>	131.513.943,14	10,32 %	170.454,71	264.312,67	1.229.040,65	1.663.808,03	0,72 %
<b>ITAÚ - SOBERANO</b>	7.002.831,65	0,55 %	28.944,05	33.957,00	27.424,97	90.326,02	0,80 %
<b>ITAÚ - ALOCAÇÃO DIN.</b>	34.075.759,34	2,67 %	0,00	0,00	754.104,57	754.104,57	2,26 %
<b>ITAÚ - HIGH GRADE</b>	20.467.093,84	1,61 %	0,00	0,00	228.284,95	228.284,95	1,13 %
<b>ITAÚ - JUROS MOEDA</b>	9.861.002,97	0,77 %	0,00	0,00	126.279,96	126.279,96	1,30 %
<b>TOTAL ITAÚ</b>	<b>389.641.697,43</b>	<b>30,57 %</b>	<b>199.398,76</b>	<b>631.100,42</b>	<b>3.233.598,70</b>	<b>4.064.097,88</b>	<b>1,05%</b>
<b>Bradesco - PREMIUM</b>	26.655.387,21	2,09 %	0,00	0,00	305.894,80	305.894,80	1,16 %
<b>TOTAL BRADESCO</b>	<b>26.655.387,21</b>	<b>2,09 %</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>305.894,80</b>	<b>305.894,80</b>	<b>1,16%</b>
<b>XP - TREND PÓS</b>	307.208,69	0,02 %	0,00	0,00	3.477,63	3.477,63	1,14 %
<b>TOTAL XP INVEST</b>	<b>307.208,69</b>	<b>0,02 %</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>3.477,63</b>	<b>3.477,63</b>	<b>1,14%</b>
<b>BTG - TESOURO IPCA</b>	0,00	0,00 %	0,00	0,00	55.471,43	55.471,43	0,55 %
<b>TOTAL BTG PACTUAL</b>	<b>10.069.785,82</b>	<b>0,79 %</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>55.471,43</b>	<b>55.471,43</b>	<b>0,55%</b>

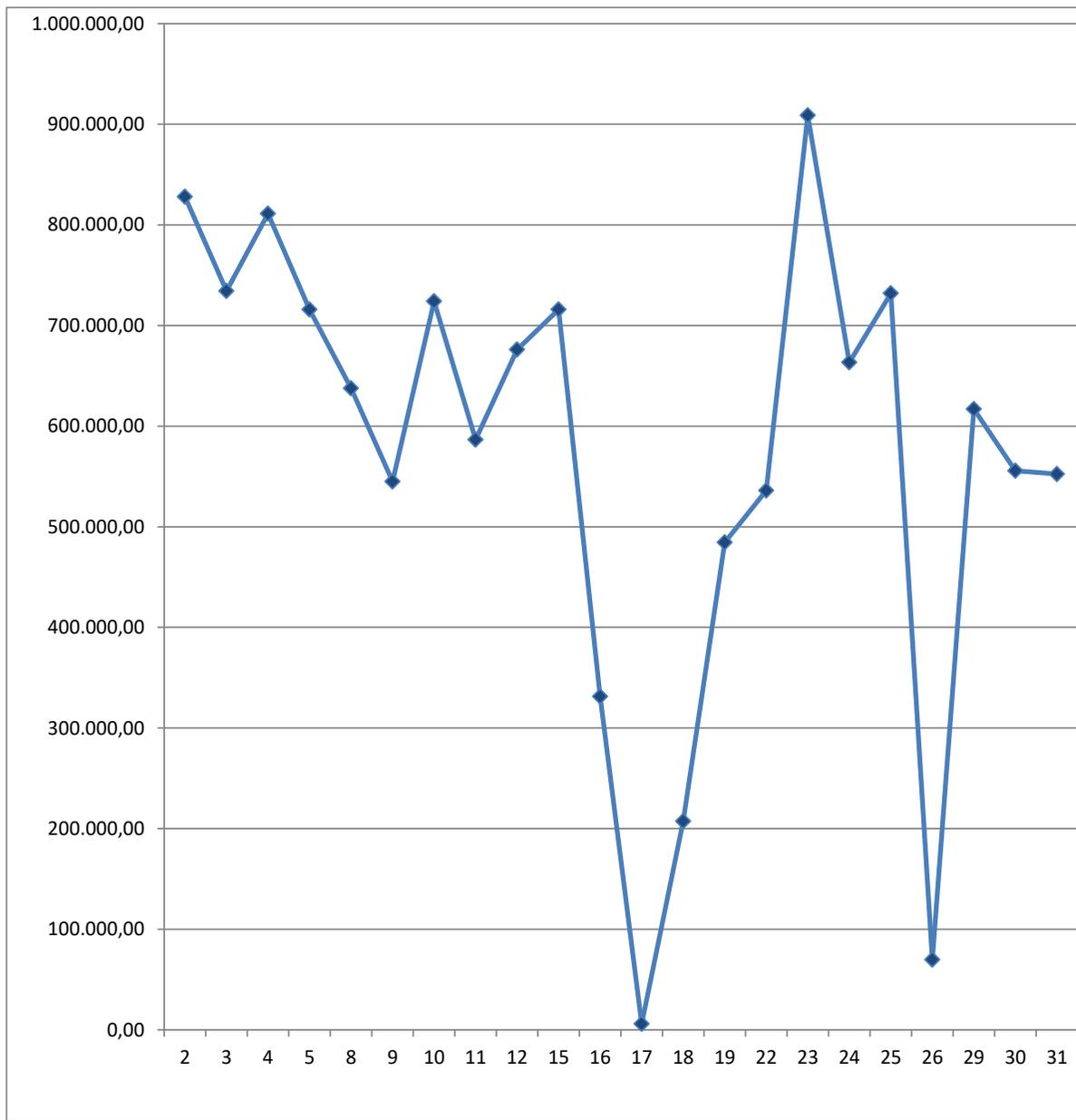
INSTITUIÇÃO	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÃO	RESGATE	RETORNO	RETORNO	SALDO FINAL
<b>BB</b>	392.250.540,50	81.946.527,04	-81.970.057,12	3.487.144,20	0,89%	395.714.154,62
<b>CX</b>	447.530.877,31	96.385.471,35	-96.385.471,35	4.722.691,59	1,06%	452.253.568,90
<b>ITAÚ</b>	372.241.635,58	120.435.964,01	-107.100.000,04	4.064.097,88	1,05%	389.641.697,43
<b>BRADESCO</b>	26.349.492,41	0,00	0,00	305.894,80	1,16%	26.655.387,21
<b>XP-INVEST.</b>	301.771,06	1.960,00	0,00	3.477,63	1,14%	307.208,69
<b>BTG</b>	10.014.314,39	0,00	0,00	55.471,43	0,55%	10.069.785,82
<b>TOTAL</b>	<b>1.248.688.631,25</b>	<b>298.769.922,40</b>	<b>-285.455.528,51</b>	<b>12.638.777,53</b>	<b>1,00%</b>	<b>1.274.641.802,67</b>

**MAIO**

COTA/DIA	VALOR (R\$)
2	828.056,18
3	734.353,25
4	811.115,88
5	715.827,11
8	637.680,17
9	545.020,81
10	724.008,26
11	586.567,89
12	676.084,47
15	715.954,66
16	331.244,84
17	5.953,95
18	207.429,37
19	484.418,64
22	536.069,28
23	908.951,34
24	663.255,54
25	731.905,63
26	69.737,49
29	617.016,46
30	555.677,08
31	552.449,23

**12.638.777,53**

**RETORNO DIÁRIO**



# NITERÓI PREV

## RETORNO E META ATUARIAL

Ano 2023

MÊS	VALOR APLICADO	RETORNO DA CARTEIRA		IPCA	META ATUARIAL
		REAL	%	%	%
JANEIRO	1.148.162.163,79	13.337.614,78	1,15%	0,53%	0,97%
FEVEREIRO	1.173.224.816,72	10.030.564,72	0,84%	0,84%	1,20%
MARÇO	1.198.463.196,77	14.293.866,38	1,18%	0,71%	1,17%
ABRIL	1.225.814.585,77	10.809.846,45	0,87%	0,61%	0,97%
MAIO	1.248.688.631,25	12.638.777,53	1,00%	0,23%	0,67%
JUNHO					
JULHO					
AGOSTO					
SETEMBRO					
OUTUBRO					
NOVEMBRO					
DEZEMBRO					

**61.110.669,86 5,15% 2,95% 5,06%**

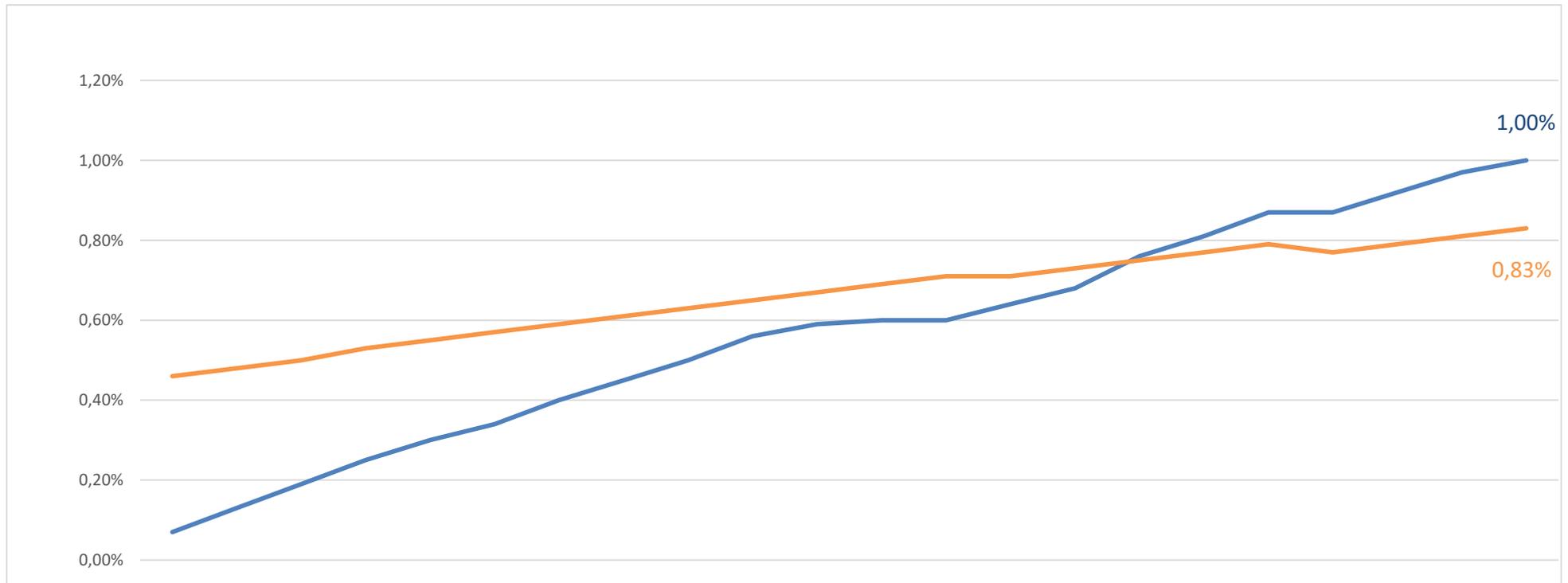
# META vs RETORNO

MAIO - 2023

BOLETIM FOCUS: **28/04** 0,44%  
**05/05** 0,45%  
**12/05** 0,45%  
**19/05** 0,43%  
**26/05** 0,39%

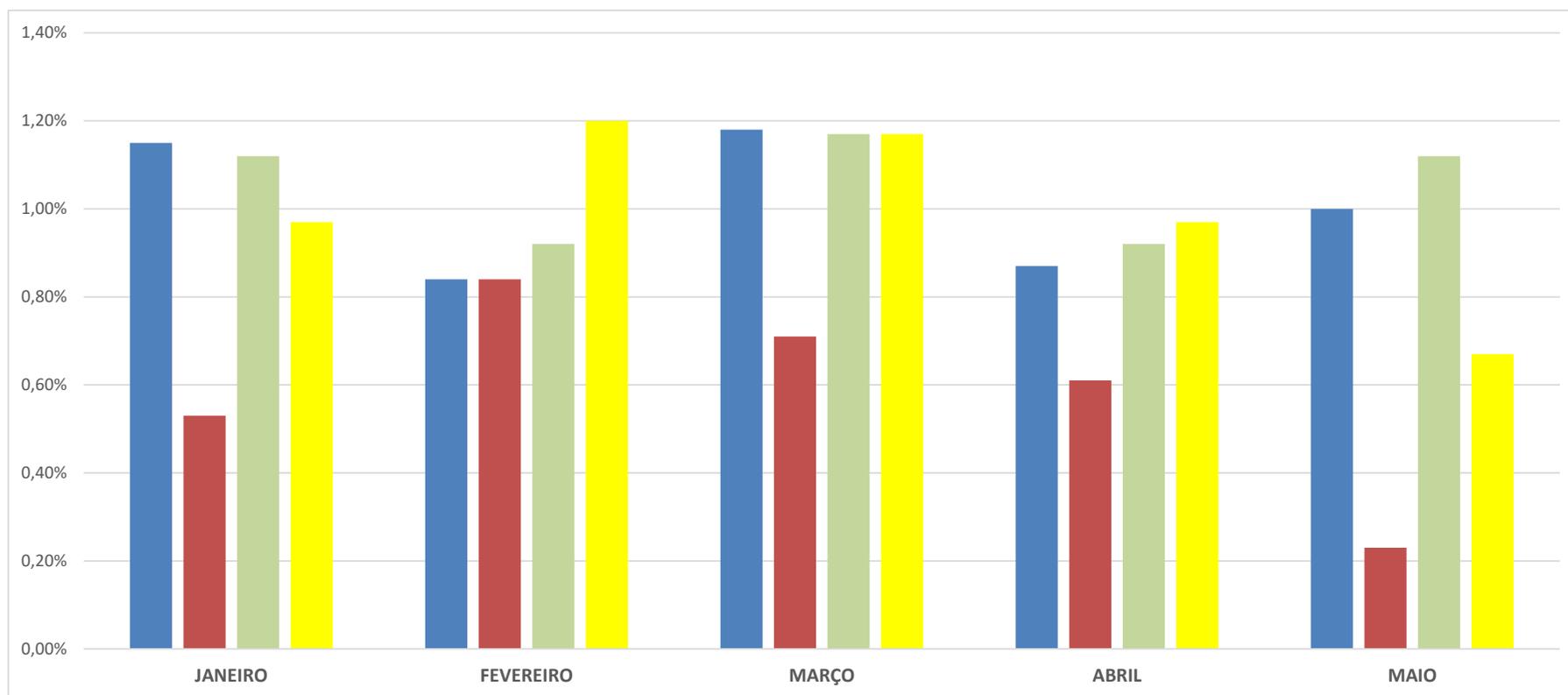
IPCA

Nitprev Retorno	0,07%	0,13%	0,19%	0,25%	0,30%	0,34%	0,40%	0,45%	0,50%	0,56%	0,59%	0,60%	0,60%	0,64%	0,68%	0,76%	0,81%	0,87%	0,87%	0,92%	0,97%	1,00%
Meta Atuarial	0,46%	0,48%	0,50%	0,53%	0,55%	0,57%	0,59%	0,61%	0,63%	0,65%	0,67%	0,69%	0,71%	0,71%	0,73%	0,75%	0,77%	0,79%	0,77%	0,79%	0,81%	0,83%
Dias	02	03	04	05	08	09	10	11	12	15	16	17	18	19	22	23	24	25	26	29	30	31



## Niterói Previdência NITERÓI PREV

	JANEIRO	FEVEREIRO	MARÇO	ABRIL	MAIO	JUNHO	JULHO	AGOSTO	SETEMBRO	OUTUBRO	NOVEMBRO	DEZEMBRO	acumulado até mai/23	ANO
<b>RETORNO</b>	1,15%	0,84%	1,18%	0,87%	1,00%									<b>5,15%</b>
<b>INFLAÇÃO</b>	0,53%	0,84%	0,71%	0,61%	0,23%									<b>2,95%</b>
<b>CDI</b>	1,12%	0,92%	1,17%	0,92%	1,12%									<b>5,36%</b>
<b>META ATUARIAL</b>	0,97%	1,20%	1,17%	0,97%	0,67%									<b>5,06%</b>



EXTRATO DE MOVIMENTAÇÕES NA CARTEIRA INVESTIMENTOS DA NITERÓI PREV

Período de: 01.05.2023 até 31.05.2023

DATA	BANCO	CONTA	PLANO CONSTITUÍDO	FUNDO INVESTIMENTO	ATIVO				ANÁLISE/PARECER DO COMIN	
					ANBIMA	ARTIGO	HISTÓRICO	VALOR	DESCRIÇÃO DA OPERAÇÃO	DATA
02/mai	BB	40,200-5	Financeiro	Fluxo	RF	7º,III,a	Aplicação	2.440,85	Repasso referente contribuição Patronal e Servidores.	S/D
03/mai	Itaú	46.758-4	Niterói Prev	Soberano	RF	7º, I, b	Aplicação	1.000.000,00	Repasso referente contribuição Patronal e Servidores.	S/D
03/mai	Itaú	46.760-0	Previdenciário	Global	RF	7º,III,a	Aplicação	1.013.336,83	Pagto acordo de atraso de contribuição Previdenciária.	S/D
04/mai	Itaú	46.761-8	Previdenciário	Vert NTN-B 2024	RF	7º, I, b	Aplicação	100.000.000,00	Troca de posição, de Fundo DI para Fundo Vert 2024.	03/mai
05/mai	Itaú	46.763-4	Financeiro	Referenciado DI	RF	7º,III,a	Aplicação	3.000.000,00	Repasso referente contribuição Patronal e Servidores.	S/D
05/mai	Itaú	46.761-8	Previdenciário	Referenciado DI	RF	7º,III,a	Resgate	-100.000.000,02	Troca de posição, de Fundo DI para Fundo Vert 2024.	03/mai
05/mai	Itaú	46.761-8	Previdenciário	Referenciado DI	RF	7º,III,a	Aplicação	8.000.000,03	Repasso referente contribuição Patronal e Servidores.	S/D
09/mai	Itaú	46.761-8	Previdenciário	Soberano	RF	7º, I, b	Aplicação	900.000,00	Repasso referente contribuição Patronal e Servidores.	S/D
09/mai	Itaú	46.761-9	Previdenciário	Alocação Dinamica	RF	7º, I, b	Aplicação	4.000.000,00	Repasso referente contribuição Patronal e Servidores.	S/D
12/mai	XP inv.	802488	Previdenciário	Trend	RF	7º, I, b	Aplicação	1.960,00	Aplicação com distribuição dos rendimentos FII Rio Bravo.	S/D
15/mai	Itaú	46.763-4	Financeiro	Soberano	RF	7º, I, b	Resgate	-2.700.000,00	Pagamento despesas Administrativas e Previdenciárias	S/D
15/mai	Itaú	48.544-6	Financeiro	Global	RF	7º,III,a	Resgate	-200.000,00	Pagamento despesas Administrativas e Previdenciárias	S/D
15/mai	Itaú	46.761-8	Previdenciário	Soberano	RF	7º, I, b	Resgate	-200.000,00	Pagamento despesas Administrativas e Previdenciárias	S/D
15/mai	BB	40.100-9	Previdenciário	IPCA-2022	RF	7º, I, b	Resgate	-2.559.793,87	Troca de posição, de Fundo DI para Fundo Vert 2024.	15/mai
15/mai	BB	40.100-9	Previdenciário	Fluxo	RF	7º,III,a	Aplicação	2.559.793,87	Troca de posição, de Fundo DI para Fundo Vert 2024.	15/mai
16/mai	BB	40.100-9	Previdenciário	IPCA-2023	RF	7º, I, b	Resgate	-56.772.191,29	Final de vencimento TPF 15.05.2023	15/mai
16/mai	BB	40.100-9	Previdenciário	Fluxo	RF	7º,III,a	Resgate	-869.263,94	Troca de posição, de Fundo DI para Fundo Vert 2024. (cupom)	15/mai
16/mai	BB	40.100-9	Previdenciário	Vertice 2024	RF	7º, I, b	Aplicação	57.641.455,23	Aplicação com saldo venc. IPCA 2023 no Fundo Vertice 2024	15/mai
16/mai	Caixa	00.194-1	Previdenciário	Disponibilidade	RF	7º, I, b	Aplicação	38.033,34	Pagamento de Cupom de Fdo 2023, aplicado em Fdo Vert 2024.	15/mai
16/mai	Caixa	00.194-1	Previdenciário	IPCA - 2023	RF	7º, I, b	Resgate	-76.347.438,01	Final de vencimento TPF 15.05.2023	15/mai
16/mai	Caixa	00.194-1	Previdenciário	Vert 2024 X	RF	7º, I, b	Aplicação	76.309.404,67	Aplicação com saldo venc. IPCA 2023 no Fundo Vertice 2024	15/mai
17/mai	BB	18.253-6	Niterói Prev	Fluxo	RF	7º,III,a	Aplicação	113,70	Repasso referente contribuição Patronal e Servidores.	S/D
17/mai	BB	40.100-9	Previdenciário	Fluxo	RF	7º,III,a	Resgate	-1.730.736,06	Troca de posição, de Fundo DI para Fundo Vert 2024.	15/mai
17/mai	BB	40.100-9	Previdenciário	Vertice 2024	RF	7º, I, b	Aplicação	1.730.736,06	Aplicação com o Cupom do IPCA 2023 no Fundo Vertice 2024	15/mai
19/mai	Caixa	00.194-1	Previdenciário	Disponibilidade	RF	7º, I, b	Resgate	-38.033,34	Pagamento de Cupom de Fdo 2023, aplicado em Fdo Vert 2024.	15/mai
19/mai	Caixa	00.194-1	Previdenciário	Vert 2024 X	RF	7º, I, b	Aplicação	38.033,34	Aplicação com o Cupom do IPCA 2023 no Fundo Vertice 2024	15/mai
22/mai	BB	18.253-6	Niterói Prev	Fluxo	RF	7º,III,a	Resgate	-113,70	Pagamento despesas Administrativas e Previdenciárias	S/D
22/mai	BB	40,200-5	Financeiro	Fluxo	RF	7º,III,a	Aplicação	113,70	Repasso referente contribuição Patronal e Servidores.	S/D
24/mai	BB	40.100-9	Previdenciário	Perfil	RF	7º,III,a	Resgate	-20.000.000,00	Troca posição, Fdo DI para FdoTP préfixado LTN's e NTN's.	23/mai
24/mai	BB	40.100-9	Previdenciário	IRF-M	RF	7º, I, b	Aplicação	20.000.000,00	Troca posição, Fdo DI para FdoTP préfixado LTN's e NTN's.	23/mai
24/mai	Caixa	00.194-1	Previdenciário	Referenciado DI	RF	7º,III,a	Resgate	-20.000.000,00	Troca de posição, de Fdo DI para Fdo IMA-B.	23/mai
24/mai	Caixa	00.194-1	Previdenciário	IMA-B	RF	7º, I, b	Aplicação	20.000.000,00	Troca de posição, de Fdo DI para Fdo IMA-B.	23/mai
25/mai	BB	40,200-5	Financeiro	Fluxo	RF	7º,III,a	Aplicação	11.873,63	Repasso referente contribuição Patronal e Servidores.	S/D
29/mai	Itaú	46.760-0	Previdenciário	Global	RF	7º,III,a	Aplicação	1.022.627,15	Pagto acordo de atraso de contribuição Previdenciária.	S/D
30/mai	Itaú	46.758-4	Niterói Prev	Soberano	RF	7º, I, b	Aplicação	1.500.000,00	Repasso referente contribuição Patronal e Servidores.	S/D
30/mai	Itaú	46.763-4	Financeiro	Referenciado DI	RF	7º,III,a	Resgate	-2.500.000,02	Pagamento despesas Administrativas e Previdenciárias	S/D
30/mai	Itaú	46.761-8	Previdenciário	Soberano	RF	7º, I, b	Resgate	-1.500.000,00	Pagamento despesas Administrativas e Previdenciárias	S/D
31/mai	BB	40,200-5	Financeiro	Fluxo	RF	7º,III,a	Resgate	-37.657,16	Pagamento despesas Administrativas e Previdenciárias	S/D
31/mai	BB	40.100-9	Previdenciário	Fluxo	RF	7º,III,a	Resgate	-301,10	Pagamento despesas Administrativas e Previdenciárias	S/D

13.314.393,89

# Niterói Previdência NITERÓI PREV

FUNDO NITERÓI PREV

FUNDO FINANCEIRO

FUNDO PREVIDENCIÁRIO

## APORTE e RETORNO

ano 2023

MÊS	SALDO ANTERIOR	APORTE	RETORNO	SALDO DO MÊS
JANEIRO	1.148.162.163,79	11.725.038,15	13.337.614,78	1.173.224.816,72
FEVEREIRO	1.173.224.816,72	15.207.815,33	10.030.564,72	1.198.463.196,77
MARÇO	1.198.463.196,77	13.057.522,62	14.293.866,38	1.225.814.585,77
ABRIL	1.225.814.585,77	12.064.199,03	10.809.846,45	1.248.688.631,25
MAIO	1.248.688.631,75	13.314.393,39	12.638.777,53	1.274.641.802,67
JUNHO				
JULHO				
AGOSTO				
SETEMBRO				
OUTUBRO				
NOVEMBRO				
DEZEMBRO				
ACUMULADO ANO		65.368.968,52	61.110.669,86	
		APORTE	RETORNO	

Niterói Previdência  
NITERÓI PREV

FUNDO NITERÓI PREV  
FUNDO FINANCEIRO  
FUNDO PREVIDENCIÁRIO

APORTE E RENTABILIDADE

ANO	SALDO JANEIRO	APORTE NO ANO	RENTABILIDADE NO ANO	SALDO DEZEMBRO
2013	13.373.879,87	8.870.840,09	120.946,96	22.365.666,92
2014	22.365.666,92	23.378.303,14	3.804.555,48	49.548.525,54
2015	49.548.525,54	67.655.400,39	8.509.068,42	125.712.994,35
2016	125.712.994,35	63.955.742,65	24.988.184,45	214.656.921,45
2017	214.656.921,45	124.107.670,47	25.337.615,64	364.102.207,56
2018	364.102.207,56	89.172.474,72	28.495.128,12	481.769.810,40
2019	481.769.810,40	77.885.316,88	66.960.889,12	626.616.016,40
2020	626.616.016,40	116.290.515,79	30.567.948,83	773.474.481,02
2021	773.474.481,02	101.593.383,13	6.619.832,01	881.687.696,16
2022	881.687.696,16	162.512.974,94	103.965.402,33	1.148.162.163,79
2023	1.148.162.163,79	65.368.969,02	61.110.669,86	1.274.641.802,67
		900.791.591,22	360.480.241,22	

APORTES EFETUADOS

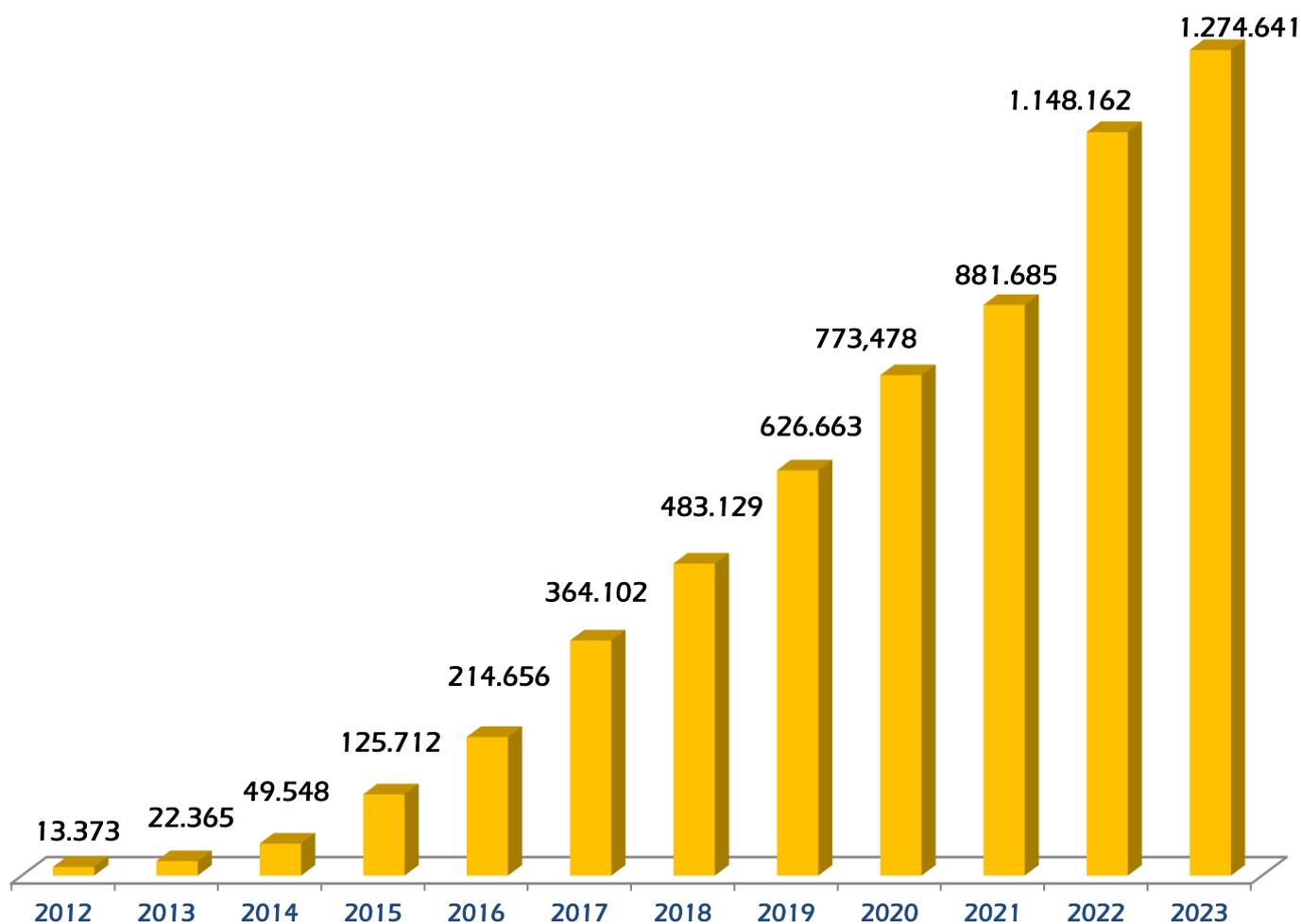
RENTABILIDADE

Base MAIO/2023

FUNDO NITERÓI PREV  
FUNDO FINANCEIRO  
FUNDO PREVIDENCIÁRIO

## Evolução da Carteira de Investimentos

Posição em 31.05.2023



9530,83%

<b>PATRIMÔNIO LÍQUIDO</b>	<b>1.291.900.230,60</b>
Carteira de Investimentos	1.274.641.802,67
Imóveis	17.258.427,93