



Cenário Econômico

A Taxa SELIC iniciou 2024 no patamar de 11,75% aa, no momento está em 11,25% aa, e pelo Boletim FOCUS, deve terminar o ano no patamar de 9% aa. Assim, ao longo de 2024 sua taxa média deve acumular algo, em torno de 10,20% aa. Esse percentual é superior à meta atuarial dos RPPS que estimamos que serão próximo de 9,5% em 2024. A curva de juros apresentou estabilidade em relação ao fechamento do mês anterior e entendemos que os níveis atuais são bastantes interessantes considerando a marcação dos títulos públicos federais na curva. Destacamos que os níveis atuais superam a grande maioria das metas atuariais dos RPPS, contribuindo para a redução da volatilidade da carteira e necessidade de correr risco adicionais em outros ativos para atingimento da meta.

Já o segmento de renda variável, o resultado do mês de fevereiro, apesar da melhora em relação ao mês anterior não foi suficiente para trazer o resultado para o campo positivo, mas seguimos com o entendimento que o cenário de redução da taxa SELIC, beneficia diretamente o segmento de renda variável, principalmente com a migração de recursos da renda fixa e o momento ainda é extremamente interessante para a construção de posição.

Por fim, o segmento exterior, apesar da cautela expressada pelos bancos centrais sobre o início do processo de corte juros, nos indicando, até esse momento, que não deve acontecer no 1º semestre, seria interessante e adotar muita, mas muita cautela ao iniciar, ou elevar, os percentuais de alocações em fundos com exposição (risco) aos mercados externos, notadamente aos mercados acionários dos Estados Unidos, Europa e China nos Fundos enquadrados no artigo 9º da Resolução 4.963/21.

Análise da Carteira de Investimentos

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.



Enquadramento na Resolução e Política de Investimentos

A situação da carteira ao término do período evidencia que, apesar de alguns objetivos 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 2024. As diferenças verificadas entre os percentuais da carteira em relação à Política de Investimentos demonstram apenas que os objetivos pretendidos para o ano de 2024 ainda não foram atingidos diante das oportunidades que o mercado ofereceu como boas alternativas.

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.

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 da política de investimentos, e de rentabilidade e liquidez pretendidos.

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.



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, estão presentes na lista exaustiva da SPREV, assim como apresentam histórico de regularidade no ambiente de gestão e administração de investimentos.

Retorno da Carteira de Investimentos

O mês de fevereiro foi de modesta recuperação na maioria das carteiras, após um primeiro mês do ano um pouco ruim, principalmente para aqueles que possuem uma carteira bastante diversificada. A grande maioria dos ativos atrelados à renda fixa, tiveram desempenho positivo, mas principalmente os fundos ligados a inflação, fecharam abaixo da meta no período. Por outro lado, na renda variável, depois de um mês de forte baixa, os ativos tiveram leve recuperação, mas ainda distante de apagar o resultado de janeiro. Para concluir, os ativos ligados aos investimentos no exterior, tiveram um bom desempenho e fecharam em boa alta, tanto pelo bom desempenho das bolsas americanas, e também pela valorização da moeda norte americana frente ao real.

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 2024, assim como também atendem os objetivos de rentabilidade e liquidez pretendidos.

Rio de Janeiro, 13 de março de 2024.

Mais Valia Consultoria Ltda EPP

Ronaldo Borges da Fonseca

Economista Consultor de Valores Mobiliários

GESTOR RECEITAS PREVIDENCIÁRIAS
RECEITA E DESPESAS DE APLICAÇÕES DE RECURSOS
FEVEREIRO de 2024

NITERÓI PREV 28.543.098/0001-42	SALDO 31.01.2024	APLICAÇÕES	RESGATE	RENTABILIDADE	SALDO 29.02.2024	Rentabilidade	QUANTIDADE COTAS
						%	
BB - FLUXO	80.406,52			585,05	80.991,57	0,73	29.314,488595
ITAÚ - Referenciado DI	9.552.333,03			82.622,48	9.634.955,51	0,86	2.196,084940
ITAÚ - Soberano RF	3.421.169,37	1.750.000,00	-800.000,00	40.104,45	4.411.273,82	0,92	67.065,725320
ITAÚ - Global Reserva	29.272.784,50			149.238,10	29.422.022,60	0,51	2.057.576,761440
CAIXA - DISPONIB.	196.234,24			1.422,96	197.657,20	0,73	81.121,515633
TOTAL CARTEIRA	42.522.927,66	1.750.000,00	-800.000,00	273.973,04	43.746.900,70	0,63%	2.237.274,575928

FINANCEIRO 18.531.246/0001-55	SALDO 31.01.2024	APLICAÇÕES	RESGATE	RENTABILIDADE	SALDO 29.02.2024	Rentabilidade	QUANTIDADE COTAS
						%	
BB - FLUXO	986.016,76	1.435,92	-38.521,11	7.184,30	956.115,87	0,76	346.061,284468
ITAÚ - Soberano comprev	0,00	45.000,00		226,10	45.226,10	0,50	687,584080
ITAÚ - Global comprev	26.888.249,19	150.000,00		137.699,89	27.175.949,08	0,51	1.900.501,612830
ITAÚ - Referenciado DI	23.824.087,25			206.065,32	24.030.152,57	0,86	5.477,166560
ITAÚ - Soberano 46763-4	3.620.730,43	2.000.000,00	-4.100.000,00	38.032,79	1.558.763,22	2,50	23.698,276390
CAIXA - DISPONIB.	405.005,99			2.936,82	407.942,81	0,73	167.425,925692
TOTAL CARTEIRA	55.724.089,62	2.196.435,92	-4.138.521,11	392.145,22	54.174.149,65	0,73%	2.443.851,850020

OSCILAÇÃO 49.455.597/0001-58	SALDO 31.01.2024	APLICAÇÕES	RESGATE	RENTABILIDADE	SALDO 29.02.2024	Rentabilidade	QUANTIDADE COTAS
						%	
ITAÚ - Referenciado DI	157.840.317,57			1.365.232,44	159.205.550,01	0,86	36.287,547920
TOTAL CARTEIRA	157.840.317,57	0,00	0,00	1.365.232,44	159.205.550,01	0,86%	36.287,547920

PREVIDENCIÁRIO 18.531.204/0001-14	SALDO 31.01.2024	APLICAÇÕES	RESGATE	RENTABILIDADE	SALDO 29.02.2024	Rentabilidade	QUANTIDADE COTAS
						%	
BB - FLUXO	644.297,15	3.593.720,36	-3.900.000,00	5.289,72	343.307,23	1,56	124.258,309349
BB - PERFIL	113.788.362,92	3.900.000,00		927.183,65	118.615.546,57	0,79	38.046.529,968833
BB - IRF-M1	121.739.643,36			901.948,75	122.641.592,11	0,74	34.212.443,390415
BB - IPCA 2024	54.704.405,53		-1.526.434,60	397.181,14	53.575.152,07	0,75	43.571.785,912925
BB - Vert IPCA 2024	61.909.475,97		-1.757.578,65	453.955,08	60.605.852,40	0,75	56.064.728,942480
ITAÚ - Global Pl Amort	66.710.358,57	1.077.288,08		341.305,93	68.128.952,58	0,50	4.764.476,996870
ITAÚ - Vert. 2024	104.280.629,76			-2.255.017,15	102.025.612,61	-2,16	101.371.865,455210
ITAÚ - Legend	11.064.806,85			82.275,71	11.147.082,56	0,74	677.545,561520
ITAÚ - Referenciado DI	113.655.325,29	8.513.891,41	-20.000.000,03	993.214,08	103.162.430,75	0,97	23.519,700690
ITAÚ - Optimus RF	121.633.809,11			836.499,40	122.470.308,51	0,69	8.816.579,224570
ITAÚ - Soberano RF	4.783.128,20		-2.200.000,00	37.187,96	2.620.316,16	1,44	39.837,337440
ITAÚ - Juros Moedas	10.707.611,13			82.615,00	10.790.226,13	0,77	24.319,771610
ITAÚ - High Grade	62.966.275,30	3.000.000,00		584.935,94	66.551.211,24	0,89	1.617.703,043500
BRADESCO - PREMIUM	34.306.882,50			307.402,65	34.614.285,15	0,90	2.050.231,256000
BRADESCO - Selection	4.673.569,55			130.875,23	4.804.444,78	2,80	574.469,682621
BRADESCO - ICATU	20.491.497,69	10.000.000,00		189.307,95	30.680.805,64	0,62	22.716.914,289298
BRADESCO - Finacap	10.445.566,01	15.000.000,00		422.917,61	25.868.483,62	1,66	1.801.773,2147725
BTG Tesouro SELIC	20.171.164,82			159.275,84	20.330.440,66	0,79	4.876.278,838122
XP - TREND	349.536,56	2.030,00		2.789,27	354.355,83	0,79	207.982,10900697
CAIXA - ALIANÇA	256.159.430,08			2.009.175,78	258.168.605,86	0,78	45.184.540,713908
CAIXA - DISPONIB.	102.808,90	2.315.493,89	-2.400.000,00	1.370,49	19.673,28	0,90	8.074,212979
CAIXA - REFERNC. DI	73.495.157,74	2.400.000,00		614.595,51	76.509.753,25	0,81	15.044.763,428275
CAIXA - Vert IPCA-2024	79.648.241,60			-1.730.890,97	77.917.350,63	-2,17	76.347.533,8664185
CAIXA - Juros Moedas	50.178.569,89			342.943,66	50.521.513,55	0,68	17.745.196,014213
CAIXA - RIO BRAVO	295.050,00			61.950,00	357.000,00	21,00	3.500,000000
TOTAL CARTEIRA	1.398.905.604,48	49.802.423,74	-31.784.013,28	5.900.288,23	1.422.824.303,17	0,42%	475.916.845,241028

Carteira - CEF	464.099.496,58	27,63%
Carteira - BB	356.818.557,82	21,24%
Carteira - Itaú	718.349.880,88	42,76%
Carteira - Bradesco	95.968.019,19	5,71%
Carteira - XP	354.355,83	0,02%
Carteira - BTG	20.330.440,66	1,21%
		98,57%

1.654.992.939,33	53.748.859,66	-36.722.534,39	7.931.638,93	1.679.950.903,53	0,47%	480.634.259,214896
-------------------------	----------------------	-----------------------	---------------------	-------------------------	--------------	---------------------------

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA: ("ADMINISTRADOR")

INSTITUIÇÃO	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÃO	RESGATE	RETORNO	RENTAB.	SALDO FINAL
BANCO DO BRASIL	353.852.608,21	7.495.156,28	-7.222.534,36	2.693.327,69	0,76%	356.818.557,82
CAIXA ECONOMICA	460.480.498,44	4.715.493,89	-2.400.000,00	1.303.504,25	0,28%	464.099.496,58
ITAÚ UNIBANCO	750.221.615,55	16.536.179,49	-27.100.000,03	2.722.238,44	0,37%	742.380.033,45
BRADESCO	69.917.515,75	25.000.000,00		1.050.503,44	1,11%	95.968.019,19
XP-INVESTIMENTOS	349.536,56	2.030,00		2.789,27	0,79%	354.355,83
BTG - PACTUAL	20.171.164,82			159.275,84	0,79%	20.330.440,66
TOTAL	1.654.992.939,33	53.748.859,66	-36.722.534,39	7.931.638,93	0,47%	1.679.950.903,53

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA: ("GESTOR")

INSTITUIÇÃO	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÃO	RESGATE	RETORNO	RENTAB.	SALDO FINAL
BB - DTVM	353.852.608,21	7.495.156,28	-7.222.534,36	2.693.327,69	0,76%	356.818.557,82
Caixa Economica	380.832.256,84	4.715.493,89	-2.400.000,00	3.034.395,22	0,79%	386.182.145,95
Caixa - DTVM	79.648.241,60			-1.730.890,97	-2,17%	77.917.350,63
Itaú Unibanco	645.940.985,79	16.536.179,49	-27.100.000,03	4.977.255,59	0,78%	640.354.420,84
Itaú - ASSET	104.280.629,76			-2.255.017,15	-2,16%	102.025.612,61
Bredesco - ASSET	34.306.882,50			307.402,65	0,90%	34.614.285,15
Sul América	4.673.569,55			130.875,23	2,80%	4.804.444,78
Icatu Vanguarda	20.491.497,69	10.000.000,00		189.307,95	0,62%	30.680.805,64
Finacap	10.445.566,01	15.000.000,00		422.917,61	1,66%	25.868.483,62
XP-ASSET	349.536,56	2.030,00		2.789,27	0,79%	354.355,83
BTG Pactual	20.171.164,82			159.275,84	0,79%	20.330.440,66
TOTAL	1.654.992.939,33	53.748.859,66	-36.722.534,39	7.931.638,93	0,47%	1.679.950.903,53

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA: (" Fundos de RENDA FIXA")

INSTITUIÇÃO	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÃO	RESGATE	RETORNO	RENTAB.	SALDO FINAL
BB - DTVM	353.852.608,21	7.495.156,28	-7.222.534,36	2.693.327,69	0,76%	356.818.557,82
Caixa Economica	410.006.878,55	4.715.493,89	-2.400.000,00	898.610,59	0,22%	413.220.983,03
Itaú Unibanco	739.514.004,42	16.536.179,49	-27.100.000,03	2.639.623,44	0,36%	731.589.807,32
Bredesco - ASSET	34.306.882,50			307.402,65	0,90%	34.614.285,15
XP-ASSET	349.536,56	2.030,00		2.789,27	0,79%	354.355,83
BTG Pactual	20.171.164,82			159.275,84	0,79%	20.330.440,66
TOTAL	1.558.201.075,06	28.748.859,66	-36.722.534,39	6.701.029,48	0,43%	1.556.928.429,81

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA: ("Fundos ESTRUTURADOS e IMOBILIÁRIO")

INSTITUIÇÃO	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÃO	RESGATE	RETORNO	RENTAB.	SALDO FINAL
Caixa Economica	50.473.619,89			404.893,66	0,80%	50.878.513,55
Itaú Unibanco	10.707.611,13			82.615,00	0,77%	10.790.226,13
Bredesco -Selection	4.673.569,55			130.875,23	2,80%	4.804.444,78
Bredesco - Icatu Vang	20.491.497,69	10.000.000,00		189.307,95	0,62%	30.680.805,64
Bredesco - Finacap	10.445.566,01	15.000.000,00		422.917,61	1,66%	25.868.483,62
TOTAL	96.791.864,27	25.000.000,00	0,00	1.230.609,45	1,01%	123.022.473,72

CARTEIRA	
RF	1.556.928.429,81
RV	122.665.473,72
FI	357.000,00
TOTAL:	1.679.950.903,53

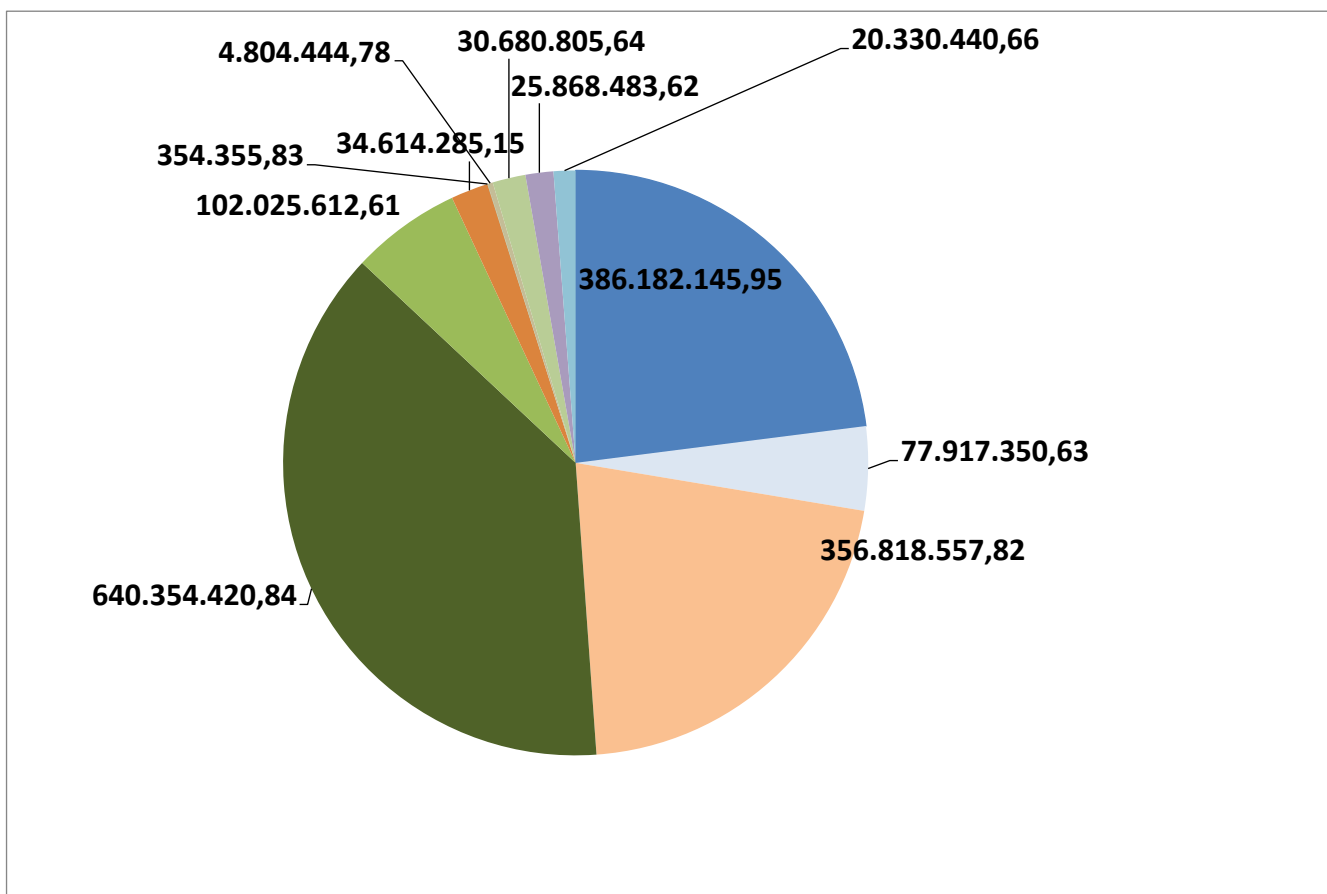
RENDA FIXA	
NITPREV	43.746.900,70
FINANCEIRO	54.174.149,65
PREVIDENC.	1.299.801.829,45
OSCILAÇÃO	159.205.550,01
TOTAL:	1.556.928.429,81

RENDA VARIÁVEL	
NITPREV	0,00
FINANCEIRO	0,00
PREVIDENC.	123.022.473,72
OSCILAÇÃO	0,00
TOTAL:	123.022.473,72

NITERÓI PREV

Enquadramento na Resolução nº 4.604 por Gestores - Base: FEVEREIRO/2024

CAIXA ECONOMICA FEDERAL	386.182.145,95	22,99%
CAIXA DTVM	77.917.350,63	4,64%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.	356.818.557,82	21,24%
ITAU UNIBANCO S.A.	640.354.420,84	38,12%
ITAU UNIBANCO ASSET MANAGEMENT S.A.	102.025.612,61	6,07%
BRAM - BRADESCOASSET MANAGEMENT S.A.	34.614.285,15	2,06%
XP VISTA ASSET MANAGEMENT LTDA	354.355,83	0,02%
SUL AMÉRICA INVEST. E GESTÃO	4.804.444,78	0,29%
ICATU VANGUARDA GESTÃO RECUR	30.680.805,64	1,83%
FINACAP-CONSULT FINANC E MERC DE CAPITAIS LTDA	25.868.483,62	1,54%
BTG PACTUAL	20.330.440,66	1,21%
	1.679.950.903,53	100,00%



Niterói Previdência
NITERÓI PREV

Alocação adequada à Resolução nº 4.963/2021.

FEVEREIRO DE 2024

RENTA FIXA

<i>ARTIGO 7º inciso I alinea "b" = 100% Títulos Públicos</i>	PL	R\$	%
BB IRF M1 TP FI RF	11.328.882/0001-35	122.641.592,11	7,30%
BB TP XXI FI RF	44.345.590/0001-60	53.575.152,07	3,19%
BB Vert 2024	49.964.484/0001-88	60.605.852,40	3,61%
CAIXA ALIANÇA TP FI RF	05.164.358/0001-73	258.168.605,86	15,37%
CAIXA FI BR 2024 X TP RF	50.635.944/0001-03	77.917.350,63	4,64%
ITAU SOBERANO RF SIMPLES FICFI	06.175.696/0001-73	8.635.579,30	0,51%
ITAU INST LEGEND FIC RF	29.241.799/0001-90	11.147.082,56	0,66%
ITAU ASSET NTN-B 2024 RF FI	50.236.636/0001-05	102.025.612,61	6,07%
XP TREND PÓS FIXADO	26.559.284/0001-44	354.355,83	0,02%
<i>ARTIGO 7º inciso III alinea "a" = Referenciado</i>			
BB FLUXO FIC RF	13.077.415/0001-05	1.380.414,67	0,08%
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI	13.077.418/0001-49	118.615.546,57	7,06%
CAIXA BR DIPONIBILIDADE FIC RF	14.508.643/0001-55	625.273,29	0,04%
CAIXA BR FI RF REFERENCIADO DI LP	03.737.206/0001-97	76.509.753,25	4,55%
ITAU INST FI REFERENCIADO DI	00.832.435/0001-00	296.033.088,84	17,62%
ITAU INST OPTIMUS RF LP FIC	40.635.061/0001-40	122.470.308,51	7,29%
ITAU INST GLOBAL DINÂMICO FIC RF	32.972.942/0001-28	124.726.924,26	7,42%
BGT PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REF DI	09.215.250/0001-13	20.330.440,66	1,21%
BRDESCO PREMIUM RF REFERENCIADO DI	03.399.411/0001-90	34.614.285,15	2,06%
<i>ARTIGO 7º inciso V alinea "b" = Crédito Privado</i>			
ITAU - High Grade	09.093.883/0001-04	66.551.211,24	3,96%
		1.556.928.429,81	92,68%

RENTA VARIÁVEL

<i>ARTIGO 8º inciso I</i>			
SUL AMÉRICA SELECTION FICFI AÇÕES	34.525.068/0001-06	4.804.444,78	3,91%
FINACAP MAURITSSTAD FIA	05.964.067/0001-60	25.868.483,62	21,03%
<i>ARTIGO 10º inciso I = Fundos Multimercado</i>			
ITAU INST MM JUROS E MOEDAS FICFI	00.973.117/0001-51	10.790.226,13	0,64%
ICATU VANG IGARATE LONG BIASED FIM	35.637.151/0001-30	30.680.805,64	1,83%
CAIXA FI JUROS E MOEDAS MM	14.120.520/0001-42	50.521.513,55	3,01%
<i>ARTIGO 11º = Fundos Imobiliários</i>			
CAIXA RIO BRAVO FDO DE FUNDOS FII	17.098.794/0001-70	357.000,00	0,02%
		123.022.473,72	7,32%

TOTAL 1.679.950.903,53 100,00%

NITERÓI PREV

Enquadramentos na Portaria nº 1.467/2022 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (FEVEREIRO / 2024)

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira (R\$)	Carteira %	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior	
				Inferior	Alvo	Superior	%	(R\$)
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%			0,00%	1,00%	100,00%	100,00%	1.679.950.903,53
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	695.071.183,37	41,37%	0,00%	41,00%	100,00%	58,63%	984.879.720,16
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%			0,00%		100,00%	100,00%	1.679.950.903,53
Artigo 7º, Inciso II	5,00%			0,00%		5,00%	5,00%	83.997.545,18
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	795.306.035,20	47,34%	0,00%	50,00%	60,00%	12,66%	212.664.506,92
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%			0,00%		60,00%	60,00%	1.007.970.542,12
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%			0,00%	1,00%	20,00%	20,00%	335.990.180,71
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%			0,00%	1,00%	5,00%	5,00%	83.997.545,18
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	66.551.211,24	3,96%	0,00%	1,00%	5,00%	1,04%	17.446.333,94
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' c '	5,00%			0,00%	1,00%	5,00%	5,00%	83.997.545,18
Total Renda Fixa		1.556.928.429,81	92,68%					

Enquadramentos na Portaria nº 1.467/2022 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL) - base (FEVEREIRO / 2024)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira (R\$)	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior	
				Inferior	Alvo	Superior	%	(R\$)
Artigo 8º - Inciso I	30,00%	30.672.928,40	1,83%	0,00%	3,00%	30,00%	28,17%	473.312.342,66
Artigo 8º - Inciso II	30,00%			0,00%		30,00%	30,00%	503.985.271,06
Total Investimentos Renda Variável		30.672.928,40	1,83%					

Enquadramentos na Portaria nº 1.467/2022 e Política de Investimento (EXTERIOR) - base (FEVEREIRO / 2024)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira (R\$)	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior	
				Inferior	Alvo	Superior	%	(R\$)
Artigo 9º - Inciso I	10,00%			0,00%		10,00%	10,00%	167.995.090,35
Artigo 9º - Inciso II	10,00%			0,00%		10,00%	10,00%	167.995.090,35
Artigo 9º - Inciso III	10,00%			0,00%	1,00%	10,00%	10,00%	167.995.090,35
Total Investimentos no Exterior		0,00	0,00%					

Enquadramentos na Portaria nº 1.467/2022 e Política de Investimento (ESTRUTURADO) - base (FEVEREIRO / 2024)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira (R\$)	Carteira %	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior	
				Inferior	Alvo	Superior	%	(R\$)
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	91.992.545,32	5,48%	0,00%	2,00%	10,00%	4,52%	76.002.545,03
Artigo 10º, Inciso II	5,00%			0,00%		5,00%	5,00%	83.997.545,18
Artigo 10º, Inciso III	5,00%			0,00%		5,00%	5,00%	83.997.545,18
Total Investimentos Estruturados		91.992.545,32	5,48%					

Enquadramentos na Portaria nº 1.467/2022 e Política de Investimento (FDO IMOBILIÁRIO) - base (FEVEREIRO / 2024)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira (R\$)	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior	
				Inferior	Alvo	Superior	%	(R\$)
Artigo 11º	5,00%	357.000,00	0,02%	0,00%	1,00%	5,00%	4,98%	83.640.545,18
Total Exterior	10,00%	357.000,00	0,02%	0,00%	1,00%	5,00%		

Enquadramentos na Portaria nº 1.467/2022 e Política de Investimento (EMPREST. CONSIGNADO) - base (FEVEREIRO / 2024)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira (R\$)	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior	
				Inferior	Alvo	Superior	%	(R\$)
Artigo 12º	5,00%			0,00%		5,00%	5,00%	83.997.545,18
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%		

Total Carteira Nitprev	1.679.950.903,53	100,00%
-------------------------------	-------------------------	----------------

FEVEREIRO / 2024

Retorno dos Fundos por Planos Constituídos

FUNDOS	ATIVO		RETORNO				
	CARTEIRA		REAL (\$)				
	REAL (\$)	%	NIT PREV	FINANCEIRO	OSCILAÇÃO	PREVIDENCIARIO	TOTAL
BBrasil - IRF M1	122.641.592,11	7,30 %				901.948,75	901.948,75
BBrasil - IPCA XXI 2024	53.575.152,07	3,19 %				397.181,14	397.181,14
BBrasil - Vert IPCA 2024	60.605.852,40	3,61 %				453.955,08	453.955,08
BBrasil - FLUXO	1.380.414,67	0,08 %	585,05	7.184,30		5.289,72	13.059,07
BBrasil - PERFIL	118.615.546,57	7,06 %				927.183,65	927.183,65
TOTAL BB	356.818.557,82	21,24 %	585,05	7.184,30	0,00	2.685.558,34	2.693.327,69
Caixa - DISPONIBILIDADE	625.273,29	0,04 %	1.422,96	2.936,82		1.370,49	5.730,27
Caixa - ALIANÇA	258.168.605,86	15,37 %				2.009.175,78	2.009.175,78
Caixa - FI BR 2024 X TP RF	77.917.350,63	4,64 %				-1.730.890,97	-1.730.890,97
Caixa - REFERENCIADO DI	76.509.753,25	4,55 %				614.595,51	614.595,51
Caixa - JUROS MOEDAS	50.521.513,55	3,01 %				342.943,66	342.943,66
Caixa - RIO BRAVO	357.000,00	0,02 %				61.950,00	61.950,00
TOTAL CAIXA	464.099.496,58	27,63 %	1.422,96	2.936,82	0,00	1.299.144,47	1.303.504,25
ITAÚ - ASSETNTN-B 2024 RFI	102.025.612,61	6,07 %				-2.255.017,15	-2.255.017,15
ITAÚ - Global	124.726.924,26	7,42 %	149.238,10	137.699,89		341.305,93	628.243,92
ITAÚ - LEGEND	11.147.082,56	0,66 %				82.275,71	82.275,71
ITAÚ - REFERENC. DI	296.033.088,84	17,62 %	82.622,48	206.065,32	1.365.232,44	993.214,08	2.647.134,32
ITAÚ - OPTIMUS	122.470.308,51	7,29 %				836.499,40	836.499,40
ITAÚ - SOBERANO	8.635.579,30	0,51 %	40.104,45	38.258,89		37.187,96	115.551,30
ITAÚ - HIGH GRADE	66.551.211,24	3,96 %				584.935,94	584.935,94
ITAÚ - JUROS MOEDA	10.790.226,13	0,64 %				82.615,00	82.615,00
TOTAL ITAÚ	742.380.033,45	44,19 %	271.965,03	382.024,10	1.365.232,44	703.016,87	2.722.238,44
Bradesco - PREMIUM	34.614.285,15	2,06 %				307.402,65	307.402,65
Bradesco - SELECTION	4.804.444,78	0,29 %				130.875,23	130.875,23
Bradesco - ICATU VANG	30.680.805,64	1,83 %				189.307,95	189.307,95
Bradesco - FINACAP	25.868.483,62	1,54 %				422.917,61	422.917,61
TOTAL BRADESCO	95.968.019,19	5,71 %	0,00	0,00	0,00	1.050.503,44	1.050.503,44
XP - TREND PÓS	354.355,83	0,02 %				2.789,27	2.789,27
TOTAL XP INVEST	354.355,83	0,02 %	0,00	0,00	0,00	2.789,27	2.789,27
BTG - TESOURO SELIC REF DI	20.330.440,66	1,21 %				159.275,84	159.275,84
TOTAL BTG PACTUAL	20.330.440,66	1,21 %	0,00	0,00	0,00	159.275,84	159.275,84
TOTAL	1.679.950.903,53	100,00%	273.973,04	392.145,22	1.365.232,44	5.900.288,23	7.931.638,93

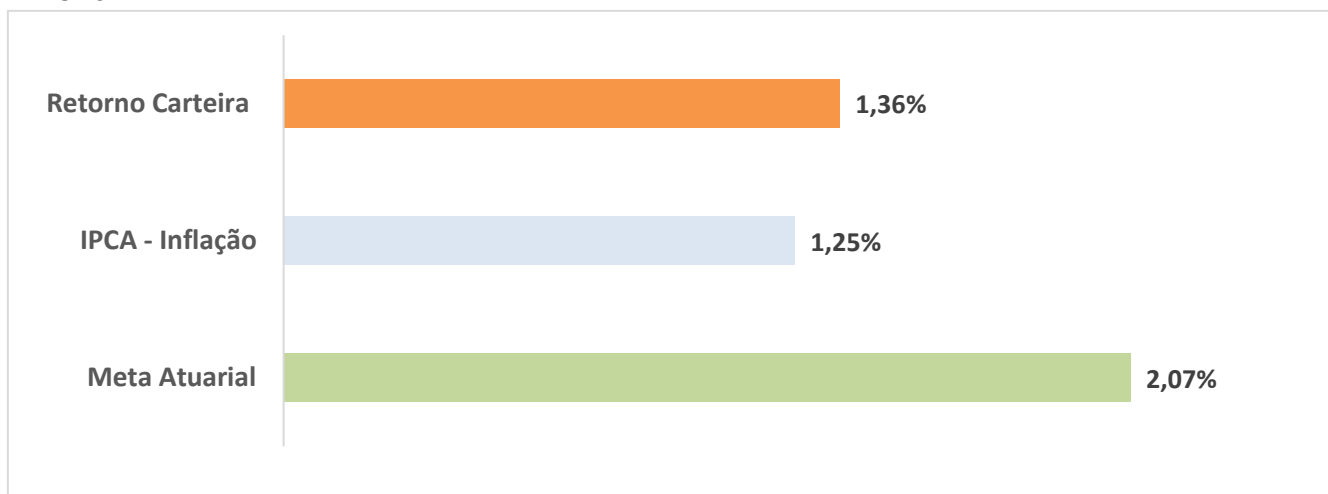
NITERÓI PREV

RETORNO E META ATUARIAL

Ano 2024

MÊS	VALOR APLICADO	RETORNO DA CARTEIRA		IPCA	META ATUARIAL
		REAL	%	%	%
JANEIRO	1.621.111.055,03	14.504.900,33	0,88%	0,42%	0,86%
FEVEREIRO	1.654.992.939,33	7.931.638,93	0,47%	0,83%	1,21%
MARÇO					
ABRIL					
MAIO					
JUNHO					
JULHO					
AGOSTO					
SETEMBRO					
OUTUBRO					
NOVEMBRO					
DEZEMBRO					
		22.436.539,26	1,36%	1,25%	2,07%

ANO 2024



RENDIMENTOS POR FUNDO ANO 2024.

	Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Mai	Junho	Julho	Agosto	Setembro	Outubro	Novembro	Dezembro	TOTAL
RENDA FIXA													
BB - IPCA XXI 2024	599.065,54	397.181,14											996.246,68
BB - Vert IPCA 2024	683.328,80	453.955,08											1.137.283,88
BB - FLUXO	15.260,94	13.059,07											28.320,01
BB - PERFIL	1.089.501,26	927.183,65											2.016.684,91
BB - IRF-M1	1.043.536,33	901.948,75											1.945.485,08
CEF - DISPONIB.	6.123,34	5.730,27											11.853,61
CEF - ALIANÇA	2.401.287,26	2.009.175,78											4.410.463,04
CEF - Vert IPCA 2024	878.538,70	-1.730.890,97											-852.352,27
CEF - REFERENC. DI	729.913,45	614.595,51											1.344.508,96
ITAÚ - Vert 2024	1.143.981,50	-2.255.017,15											-1.111.035,65
ITAÚ - GLOBAL	1.088.117,00	628.243,92											1.716.360,92
ITAÚ - LEGEND	95.380,80	82.275,71											177.656,51
ITAÚ - REFERENC.	2.993.266,94	2.647.134,32											5.640.401,26
ITAÚ - OPTIMUS	1.070.032,96	836.499,40											1.906.532,36
ITAÚ - SOBERANO	109.580,75	115.551,30											225.132,05
ITAÚ - HIGH GRADE	642.905,90	584.935,94											1.227.841,84
BRA - PREMIUM	368.800,93	307.402,65											676.203,58
XP-TREND	3.343,02	2.789,27											6.132,29
BTG- TESOIRO SELIC REF DI	190.970,20	159.275,84											350.246,04
	15.152.935,62	6.701.029,48	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	21.853.965,10
RENDA VARIÁVEL													
BRA - Sul Amér. SELECTION	-430.331,85	130.875,23											-299.456,62
BRA - FINACAP	-594.840,02	422.917,61											-171.922,41
BRA - ICATU VANG	-199.506,01	189.307,95											-10.198,06
ITAÚ - MM Juros Moedas	99.644,74	82.615,00											182.259,74
CEF - Juros Moedas MM	462.297,85	342.943,66											805.241,51
CX - RIO BRAVO	14.700,00	61.950,00											76.650,00
	-648.035,29	1.230.609,45	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	582.574,16
	14.504.900,33	7.931.638,93	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	22.436.539,26

Período de: 01.02.2024 até 29.02.2024

DATA	BANCO	CONTA	PLANO CONSTITUÍDO	FUNDO INVESTIMENTO	ATIVO				ANÁLISE/PARECER DO COMIN	
					ANBIMA	ARTIGO	HISTÓRICO	VALOR	DESCRIÇÃO DA OPERAÇÃO	DATA
18/fev	Itaú	48.544-6	Financeiro	Global	RF	7º,III,a	Aplicação	150.000,00	Repasse contribuição COMPREV Patronal e Servidores.	
19/fev	Itaú	48.544-6	Financeiro	Soberano	RF	7º, I, b	Aplicação	45.000,00	Conta caixa do COMPREV.	
18/fev	Itaú	46.763-4	Financeiro	Soberano	RF	7º, I, b	Aplicação	2.000.000,00	Repasse referente contribuição Patronal e Servidores.	
18/fev	Itaú	46.763-4	Financeiro	Soberano	RF	7º, I, b	Resgate	-4.100.000,00	Pagamento despesas administrativas e Previdenciárias	
01/fev	BB	40.200-5	Financeiro	Fluxo	RF	7º,III,a	Aplicação	1.435,90	Repasse referente contribuição Patronal e Servidores.	
29/fev	BB	40.200-5	Financeiro	Fluxo	RF	7º,III,a	Resgate	-38.521,11	Pagamento despesas Administrativas e Previdenciarias	
11/fev	Itaú	46.758-4	Niterói Prev	Soberano	RF	7º, I, b	Aplicação	1.750.000,00	Repasse referente contribuição Patronal e Servidores.	
29/jan	Itaú	46.758-4	Niterói Prev	Soberano	RF	7º, I, b	Resgate	-800.000,00	Pagamento despesas Administrativas e Previdenciarias	
15/fev	BB	40.100-9	Previdenciário	Fluxo	RF	7º,III,a	Aplicação	3.284.013,25	Juros antecipados pago pelo Fundo Vertice 2024.	
19/fev	BB	40.100-9	Previdenciário	Fluxo	RF	7º,III,a	Resgate	-3.900.000,00	Aplicação do Cupom em Fdo referenciado DI.	
29/fev	BB	40.100-9	Previdenciário	Fluxo	RF	7º,III,a	Aplicação	309.707,11	Repasse referente contribuição Patronal e Servidores.	
19/fev	BB	40.100-9	Previdenciário	Perfil	RF	7º,III,a	Aplicação	3.900.000,00	Aplicação do Cupom em Fdo referenciado DI.	
15/fev	BB	40.100-9	Previdenciário	IPCA XXI	RF	7º, I, b	Resgate	-1.526.434,60	Pag. Cupom semestral Vertice com venc. em 15.08.2024	
19/fev	BB	40.100-9	Previdenciário	Vertice 2024	RF	7º, I, b	Resgate	-1.757.578,65	Pag. Cupom semestral Vertice com venc. em 15.08.2024	
27/fev	Itaú	46.760-0	Previdenciário	Global	RF	7º,III,a	Aplicação	1.077.288,08	Acordo de contribuição em atraso de Patronal e Servidores.	
05/fev	Itaú	46.761-8	Previdenciário	Referenciado DI	RF	7º,III,a	Aplicação	3.500.000,00	Repasse referente contribuição Patronal e Servidores.	
08/fev	Itaú	46.761-8	Previdenciário	Referenciado DI	RF	7º,III,a	Aplicação	5.000.000,00	Repasse referente contribuição Patronal e Servidores.	
16/fev	Itaú	46.761-8	Previdenciário	Referenciado DI	RF	7º,III,a	Aplicação	13.891,40	Repasse referente contribuição Patronal e Servidores.	
21/fev	Itaú	46.761-8	Previdenciário	Referenciado DI	RF	7º,III,a	Resgate	-10.000.000,00	Resgate para troca posição Fdo RV Finacap	
23/fev	Itaú	46.761-8	Previdenciário	Referenciado DI	RF	7º,III,a	Resgate	-10.000.000,00	Resgate para troca posição Fdo MM Icatu Vang	
28/fev	Itaú	46.761-8	Previdenciário	Soberano	RF	7º, I, b	Resgate	-2.200.000,00	Pagamento despesas Administrativas e Previdenciarias	
19/fev	Itaú	46.761-8	Previdenciário	High Grade	RF	7º,III,a	Aplicação	3.000.000,00	Aplicação em troca de posição Fdo com melhor retorno	
26/fev	Bran	19.504-9	Previdenciário	Icatu Vang	RV	10º,I	Aplicação	10.000.000,00	Troca posição para Fdo MM(RV,RF,Cambio, Derivativos)	
08/fev	Bran	19.504-9	Previdenciário	Finacap	RV	8º,I	Aplicação	5.000.000,00	Troca posição para Fdo Ações Valor/Crescimento	
22/fev	Bran	19.504-9	Previdenciário	Finacap	RV	8º,I	Aplicação	10.000.000,00	Troca posição para Fdo Ações Valor/Crescimento	
15/fev	XP inv.	80.248-8	Previdenciário	Trend	RF	7º, I, b	Aplicação	2.030,00	Aplicação de distribuição dos rendimentos FII Rio Bravo.	
16/fev	Caixa	00.194-1	Previdenciário	Disponibilidade	RF	7º, I, b	Aplicação	2.315.493,89	Pag. Cupom semestral Vertice com venc. em 15.08.2024	
19/fev	Caixa	00.194-1	Previdenciário	Disponibilidade	RF	7º, I, b	Resgate	-2.400.000,00	Aplicação do Cupom em Fdo referenciado DI.	
19/fev	Caixa	00.194-1	Previdenciário	Referenciado DI	RF	7º,III,a	Aplicação	2.400.000,00	Aplicação do Cupom em Fdo referenciado DI.	

Niterói Previdência NITERÓI PREV

FUNDO NITERÓI PREV

FUNDO FINANCEIRO

FUNDO DE OSCILAÇÃO DE RISCO

FUNDO PREVIDENCIÁRIO

APORTE e RETORNO

ano 2024

MÊS	SALDO ANTERIOR	APORTE	RETORNO	SALDO DO MÊS
JANEIRO	1.621.111.055,03	19.376.983,97	14.504.900,33	1.654.992.939,33
FEVEREIRO	1.654.992.939,33	17.026.325,27	7.931.638,93	1.679.950.903,53
MARÇO				
ABRIL				
MAIO				
JUNHO				
JULHO				
AGOSTO				
SETEMBRO				
OUTUBRO				
NOVEMBRO				
DEZEMBRO				
ACUMULADO ANO		36.403.309,24	22.436.539,26	

APORTE

RETORNO

Niterói Previdência
NITERÓI PREV

FUNDO NITERÓI PREV
FUNDO FINANCEIRO
FUNDO OSCILAÇÃO
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	317.456.693,46	155.492.197,48	1.621.111.055,03
2024	1.621.111.055,03	36.403.309,24	22.436.539,26	1.679.950.903,53
		1.189.282.624,90	477.298.308,10	

APORTES EFETUADOS

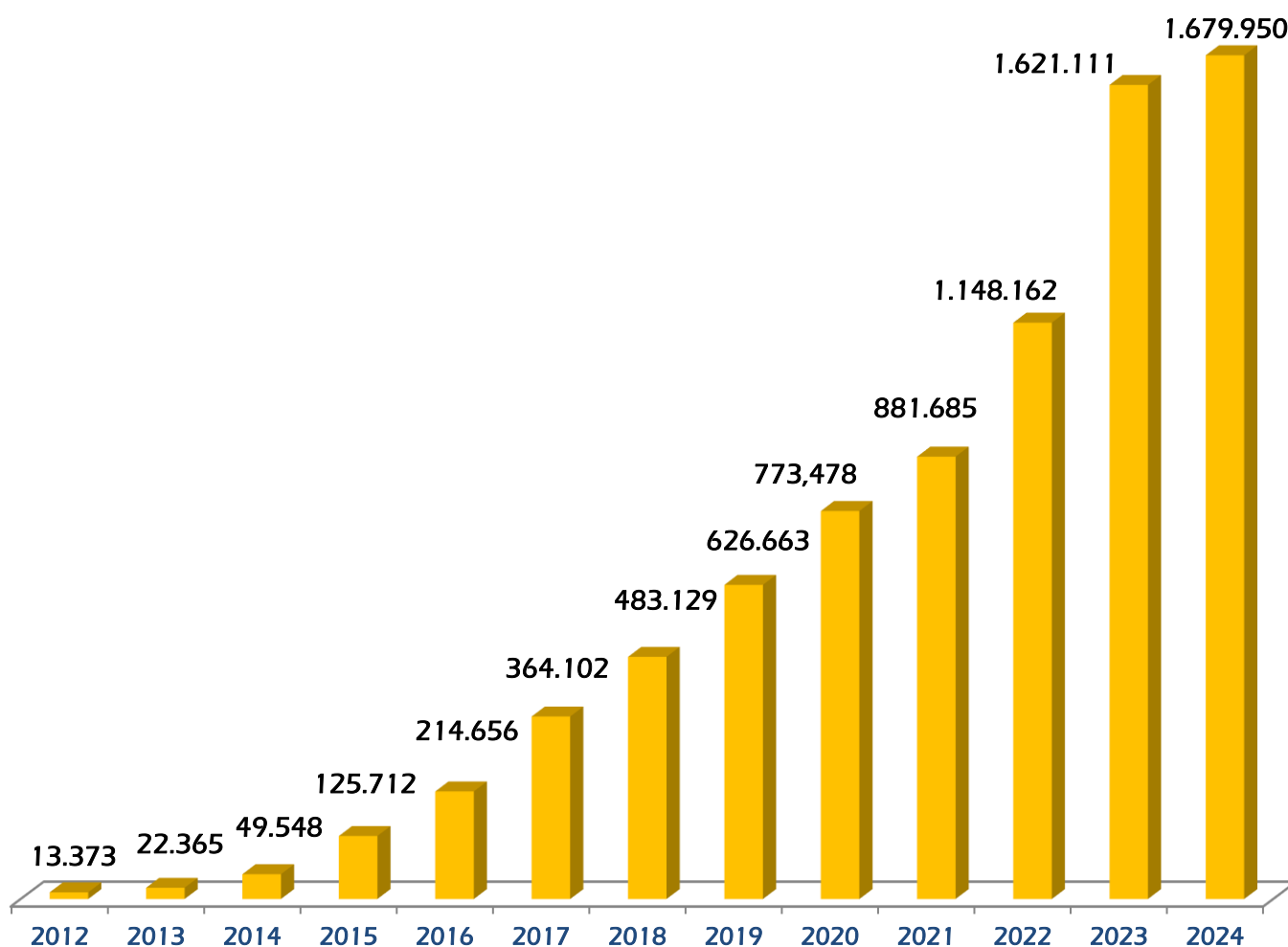
RENTABILIDADE

Base Fevereiro/2024

FUNDO NITERÓI PREV
FUNDO FINANCEIRO
FUNDO OSCILAÇÃO DE RISCO
FUNDO PREVIDENCIÁRIO

Evolução da Carteira de Investimentos

Posição em 29.02.2024



12121,47%

PATRIMÔNIO LÍQUIDO	1.697.209.331,46
Carteira de Investimentos	1.679.950.903,53
Imóveis	17.258.427,93