



Cenário Econômico

Assim como nos dois últimos meses, o mês de outubro foi mais um de resultados ruins para as carteiras de investimentos. No segmento de renda fixa, resultados mistos. Mais uma vez os fundos atrelados a inflação tiveram desempenho fraco com a continuação da abertura da curva de juros, por outro lado continuaram fazendo um bom trabalho de defesa os fundos atrelados ao CDI que fecharam no positivo. Já no segmento de renda variável, a realidade não foi boa para todos os índices de referência no mercado que fecharam em forte baixa no mês. Em resumo, a grande maioria das carteiras de investimentos experimentaram mais um mês de resultados ruins, mas aquelas que possuem uma boa diversificação ainda conseguem um resultado superior a meta atuarial no ano, com a gordura acumulada no primeiro semestre de 2023.

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 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.



NITERÓI
SEMPRE À FRENTE

Niterói Previdência
NITERÓI PREV

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 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 do Mercado de Capitais, assim como apresentam histórico de regularidade no ambiente de gestão e administração de investimentos.

Retorno da Carteira de Investimentos

Nos segmentos de renda fixa e investimentos estruturados, destacamos mais uma vez os fundos atrelados a inflação que tiveram desempenho fraco com a continuação da abertura da curva de juros, por outro lado continuaram fazendo um bom trabalho de defesa os fundos atrelados ao CDI que fecharam no positivo. Já nos segmentos de renda variável e investimentos no exterior, a realidade não foi boa para a maioria dos índices de referência no mercado que fecharam em baixa no mês.



NITERÓI
SEMPRE À FRENTE

Niterói Previdência
NITERÓI PREV

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 novembro de 2023.

Mais Valia Consultoria Ltda EPP

GESTOR RECEITAS PREVIDENCIÁRIAS

RECEITA E DESPESAS DE APLICAÇÕES DE RECURSOS

OUTUBRO de 2023

NITERÓI PREV 28.543.098/0001-42	SALDO 30.09.2023	APLICAÇÕES	RESGATE	RENTABILIDADE	SALDO 31.10.2023	Rentabilidade	QUANTIDADE COTAS
						%	
BB - FLUXO	80.036,91			722,18	80.759,09	0,90	30.195,236436
ITAÚ - Referenciado DI	7.226.697,71	1.000.000,00		77.716,73	8.304.414,44	0,94	1.965,982580
ITAÚ - Soberano RF	3.642.043,24			35.581,15	3.677.624,39	0,98	57.922,583000
ITAÚ - Global Reserva	28.144.115,17			197.527,37	28.341.642,54	0,70	2.057.576,761440
CAIXA - DISPONIB.	189.616,76			1.734,78	191.351,54	0,91	81.121,515633
TOTAL CARTEIRA	39.282.509,79	1.000.000,00	0,00	313.282,21	40.595.792,00		2.228.782,079089

FINANCEIRO 18.531.246/0001-55	SALDO 30.09.2023	APLICAÇÕES	RESGATE	RENTABILIDADE	SALDO 31.10.2023	Rentabilidade	QUANTIDADE COTAS
						%	
BB - FLUXO	341.958,69	421,96	-38.341,43	3.089,15	307.128,37	1,02	114.833,062139
ITAÚ - Referenciado DI	22.342.956,04	2.097.997,63	-3.500.000,03	240.954,70	21.181.908,34	1,15	5.014,593500
ITAÚ - Global comprev	23.268.934,55			163.311,28	23.432.245,83	0,70	1.701.159,151110
ITAÚ - Soberano RF	4.082.430,77	902.002,40		45.235,84	5.029.669,01	0,91	79.217,285290
CAIXA - DISPONIB.	391.348,22			3.580,41	394.928,63	0,91	167.425,925692
TOTAL CARTEIRA	50.427.628,27	3.000.421,99	-3.538.341,46	456.171,38	50.345.880,18		2.067.650,017731

OSCILAÇÃO 49.455.597/0001-58	SALDO 30.09.2023	APLICAÇÕES	RESGATE	RENTABILIDADE	SALDO 31.10.2023	Rentabilidade	QUANTIDADE COTAS
						%	
ITAÚ - Referenciado DI	151.669.587,34			1.610.935,84	153.280.523,18	1,06	36.287,547920
TOTAL CARTEIRA	151.669.587,34	0,00	0,00	1.610.935,84	153.280.523,18		36.287,547920

PREVIDENCIÁRIO 18.531.204/0001-14	SALDO 30.09.2023	APLICAÇÕES	RESGATE	RENTABILIDADE	SALDO 31.10.2023	Rentabilidade	QUANTIDADE COTAS
						%	
BB - FLUXO	718.300,76	3.678.225,85	-3.062.126,42	19.088,61	1.353.488,80	1,43	506.059,619718
BB - PERFIL	115.297.243,84	43.581.435,00		1.415.192,53	160.293.871,37	0,89	53.283.963,936481
BB - IRF-M1	44.312.261,96	73.051.681,43		509.961,95	117.873.905,34	0,43	34.034.578,798800
BB - IMA-B	43.558.124,48		-43.581.435,00	23.310,52	-0,00	0,05	0,000000
BB - IPCA 2024	52.961.141,27			230.912,62	53.192.053,89	0,44	44.817.021,251987
BB - Vert IPCA 2024	59.917.077,85			266.019,56	60.183.097,41	0,44	57.695.668,659511
BB - IRF-M	61.990.059,93		-62.179.993,25	189.933,32	-0,00	0,31	0,000000
BB - MULT MACRO	11.518.378,66		-11.488.088,71	-30.289,95	-0,00	-0,26	0,000000
ITAÚ - Global PI Amort	60.009.290,01	1.047.229,51		422.234,74	61.478.754,26	0,69	4.463.300,110950
ITAÚ - Vert. 2024	100.948.942,03			441.981,33	101.390.923,36	0,44	101.371.865,455210
ITAÚ - Legend	10.585.729,96			225.830,68	10.811.560,64	2,13	677.545,561520
ITAÚ - Referenciado DI	116.552.061,84	74.489.650,54	-5.000.000,01	1.320.379,15	187.362.091,52	0,71	44.355,999940
ITAÚ - Soberano RF	1.558.081,01	3.500.000,00	-1.998.000,00	41.520,08	3.101.601,09	1,36	48.850,216090
ITAÚ - Alocação Din.	64.580.909,04		-64.689.650,53	108.741,49	-0,00	0,17	0,000000
ITAÚ - Juros Moedas	10.305.539,96			99.313,61	10.404.853,57	0,96	24.319,771610
ITAÚ - High Grade	21.457.535,16			250.607,64	21.708.142,80	1,17	549.008,687960
BRADESCO - PREMIUM	32.946.154,26			347.375,60	33.293.529,86	1,05	2.050.231,256000
BRADESCO - Selection	4.793.901,48			-352.218,11	4.441.683,37	-7,35	574.469,682621
BRADESCO - ICATU	9.957.091,64			-131.683,68	9.825.407,96	-1,32	7.885.391,822754
BRADESCO - Finacap	0,00	5.000.000,00		10.913,04	5.010.913,04	0,22	405.255,4860671
BTG Tesour IPCA longo	19.796.944,12		-19.626.990,14	-169.953,98	0,00	-0,86	0,000000
BTG Tesouro SELIC	0,00	19.626.990,14		0,00	19.626.990,14	0,00	4.876.278,838122
XP - TREND	328.816,94	2.030,00		3.182,39	334.029,33	0,96	203.108,72364306
CAIXA- ALIANÇA	246.893.345,95			2.415.158,88	249.308.504,83	0,98	45.184.540,713908
CAIXA - DISPONIB.	99.341,94			908,87	100.250,81	0,90	42.500,298627
CAIXA - REFERNC. DI	70.689.639,89			718.883,07	71.408.522,96	1,02	14.571.166,646207
CAIXA- Vert IPCA-2024	77.085.578,61			342.676,74	77.428.255,35	0,44	76.347.533,866419
CAIXA- Juros Moedas	48.394.680,83			412.629,04	48.807.309,87	0,85	17.745.196,014213
CAIXA- RIO BRAVO	285.460,00			-5.740,00	279.720,00	-2,01	3.500,000000
TOTAL CARTEIRA	1.287.541.633,42	223.977.242,47	-211.626.284,06	9.126.869,74	1.309.019.461,57		467.405.711,418358

Carteira - CEF	447.918.843,99	28,84%
Carteira - BB	393.284.304,27	25,32%
Carteira - Itaú	639.505.954,97	41,17%
Carteira - Bradesco	52.571.534,23	3,38%
Carteira - XP	334.029,33	0,02%
Carteira - BTG	19.626.990,14	1,26%
	100,00%	

1.528.921.358,82	227.977.664,46	-215.164.625,52	11.507.259,17	1.553.241.656,93	0,75%	471.738.431,063098
------------------	----------------	-----------------	---------------	------------------	-------	--------------------

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA: ("ADMINISTRADOR")

INSTITUIÇÃO	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÃO	RESGATE	RETORNO	RENTAB.	SALDO FINAL
BANCO DO BRASIL	390.694.584,35	120.311.764,24	-120.349.984,81	2.627.940,49	0,67%	393.284.304,27
CAIXA ECONOMICA	444.029.012,20			3.889.831,79	0,88%	447.918.843,99
ITAÚ UNIBANCO	626.374.853,83	83.036.880,08	-75.187.650,57	5.281.871,63	0,83%	639.505.954,97
BRASESCO	47.697.147,38	5.000.000,00		-125.613,15	-0,24%	52.571.534,23
XP-INVESTIMENTOS	328.816,94	2.030,00		3.182,39	0,96%	334.029,33
BTG - PACTUAL	19.796.944,12	19.626.990,14	-19.626.990,14	-169.953,98	-0,86%	19.626.990,14
TOTAL	1.528.921.358,82	227.977.664,46	-215.164.625,52	11.507.259,17	0,75%	1.553.241.656,93

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA : ("GESTOR")

INSTITUIÇÃO	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÃO	RESGATE	RETORNO	RENTAB.	SALDO FINAL
BB - DTVM	390.694.584,35	120.311.764,24	-120.349.984,81	2.627.940,49	0,67%	393.284.304,27
Caixa Economica	366.943.433,59			3.547.155,05	0,97%	370.490.588,64
Caixa - DTVM	77.085.578,61			342.676,74	0,44%	77.428.255,35
Itaú Unibanco	525.425.911,80	83.036.880,08	-75.187.650,57	4.839.890,30	0,91%	538.115.031,61
Itaú - ASSET	100.948.942,03			441.981,33	0,44%	101.390.923,36
Bredesco - ASSET	32.946.154,26			347.375,60	1,05%	33.293.529,86
Sul América	4.793.901,48			-352.218,11	-7,35%	4.441.683,37
Icatu Vanguarda	9.957.091,64			-131.683,68	-1,32%	9.825.407,96
Finacap		5.000.000,00		10.913,04	0,22%	5.010.913,04
XP-ASSET	328.816,94	2.030,00		3.182,39	0,96%	334.029,33
BTG Pactual	19.796.944,12	19.626.990,14	-19.626.990,14	-169.953,98	-0,86%	19.626.990,14
TOTAL	1.528.921.358,82	227.977.664,46	-215.164.625,52	11.507.259,17	0,75%	1.553.241.656,93

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

INSTITUIÇÃO	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÃO	RESGATE	RETORNO	RENTAB.	SALDO FINAL
BB - DTVM	379.176.205,69	120.311.764,24	-108.861.896,10	2.658.230,44	0,68%	393.284.304,27
Caixa Economica	395.348.871,37			3.482.942,75	0,88%	398.831.814,12
Itaú Unibanco	616.069.313,87	83.036.880,08	-75.187.650,57	5.182.558,02	0,83%	629.101.101,40
Bredesco - ASSET	32.946.154,26			347.375,60	1,05%	33.293.529,86
XP-ASSET	328.816,94	2.030,00		3.182,39	0,96%	334.029,33
BTG Pactual	19.796.944,12	19.626.990,14	-19.626.990,14	-169.953,98	-0,86%	19.626.990,14
TOTAL	1.443.666.306,25	222.977.664,46	-203.676.536,81	11.504.335,22	0,79%	1.474.471.769,12

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

INSTITUIÇÃO	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÃO	RESGATE	RETORNO	RENTAB.	SALDO FINAL
BB - DTVM	11.518.378,66		-11.488.088,71	-30.289,95	-0,26%	-0,00
Caixa Economica	48.680.140,83			406.889,04	0,84%	49.087.029,87
Itaú Unibanco	10.305.539,96			99.313,61	0,96%	10.404.853,57
Bredesco -Selection	4.793.901,48			-352.218,11	-7,35%	4.441.683,37
Bredesco - Icatu Vang	9.957.091,64			-131.683,68	-1,32%	9.825.407,96
Bredesco - Finacap		5.000.000,00		10.913,04	0,22%	5.010.913,04
TOTAL	85.255.052,57	5.000.000,00	-11.488.088,71	2.923,95	0,00%	78.769.887,81

CARTEIRA	
RF	1.474.471.769,12
RV	78.490.167,81
FI	279.720,00
TOTAL:	1.553.241.656,93

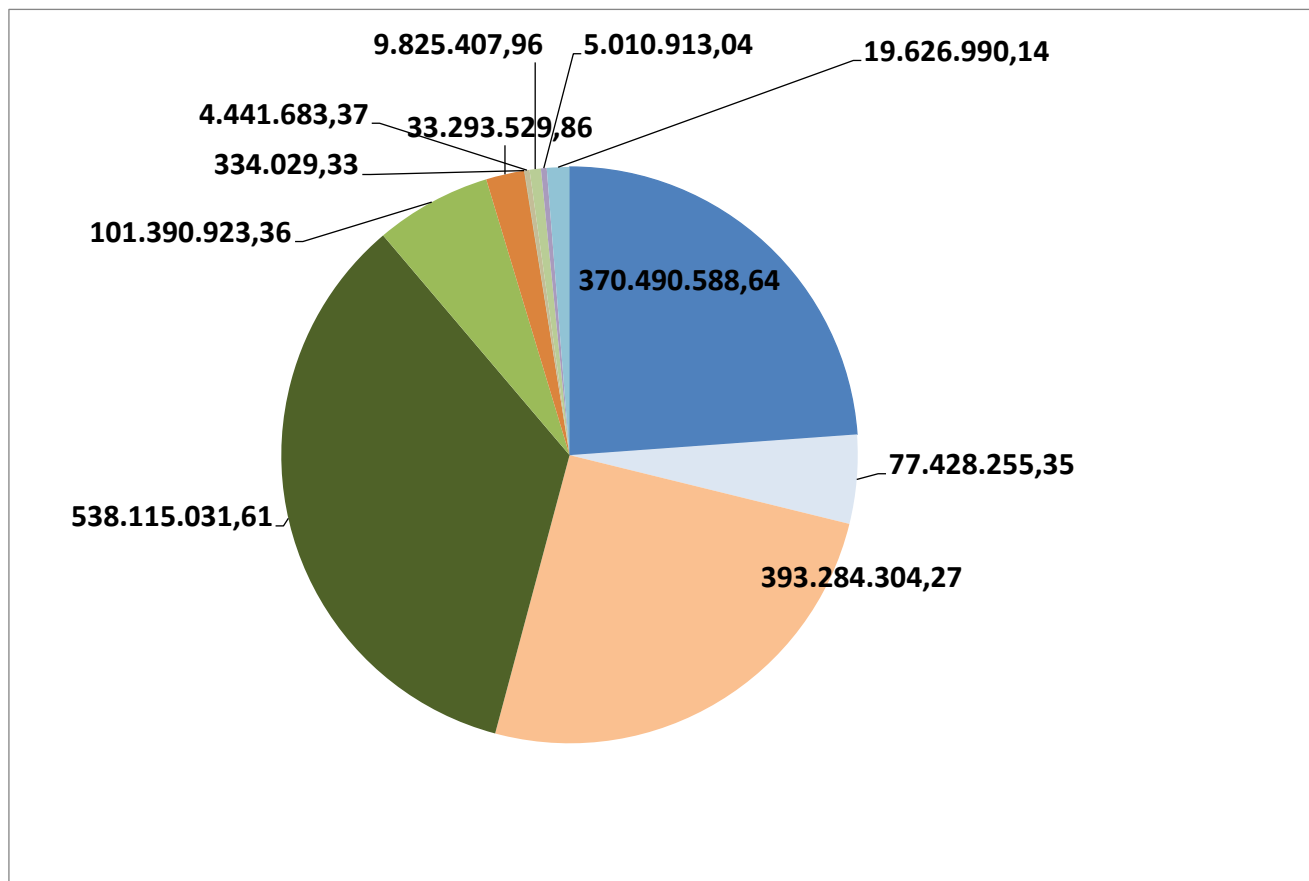
RENDA FIXA	
NITPREV	40.595.792,00
FINANCEIRO	50.345.880,18
PREVIDENC.	1.230.249.573,76
OSCILAÇÃO	153.280.523,18
TOTAL:	1.474.471.769,12

RENDA VARIÁVEL	
NITPREV	0,00
FINANCEIRO	0,00
PREVIDENC.	78.769.887,81
OSCILAÇÃO	0,00
TOTAL:	78.769.887,81

NITERÓI PREV

Enquadramento na Resolução nº 4.604 por Gestores - Base: OUTUBRO/2023

CAIXA ECONOMICA FEDERAL	370.490.588,64	23,85%
CAIXA DTVM	77.428.255,35	4,98%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.	393.284.304,27	25,32%
ITAÚ UNIBANCO S.A.	538.115.031,61	34,64%
ITAÚ UNIBANCO ASSET MANAGEMENT S.A.	101.390.923,36	6,53%
BRAM - BRADESCOASSET MANAGEMENT S.A.	33.293.529,86	2,14%
XP VISTA ASSET MANAGEMENT LTDA	334.029,33	0,02%
SUL AMÉRICA INVEST. E GESTÃO	4.441.683,37	0,29%
ICATU VANGUARDA GESTÃO RECUR	9.825.407,96	0,63%
FINACAP-CONSULT FINANC E MERC DE CAPITAIS LTDA	5.010.913,04	0,32%
BTG PACTUAL	19.626.990,14	1,26%
	1.553.241.656,93	100,00%



Niterói Previdência
NITERÓI PREV

Alocação adequada à Resolução nº 4.963/2021.

OUTUBRO DE 2023

RENTA FIXA

ARTIGO 7º inciso I alínea "b" = 100% Títulos Públicos

	PL	R\$	%
BB IRF M1 TP FI RF	11.328.882/0001-35	117.873.905,34	7,59%
BB TP XXI FI RF	44.345.590/0001-60	53.192.053,89	3,42%
BB Vert 2024	49.964.484/0001-88	60.183.097,41	3,87%
CAIXA ALIANÇA TP FI RF	05.164.358/0001-73	249.308.504,83	16,05%
CAIXA FI BR 2024 X TP RF	50.635.944/0001-03	77.428.255,35	4,98%
ITAÚ SOBERANO RF SIMPLES FICFI	06.175.696/0001-73	11.808.894,49	0,76%
ITAÚ INST LEGEND FIC RF	29.241.799/0001-90	10.811.560,64	0,70%
ITAÚ ASSET NTN-B 2024 RF FI	50.236.636/0001-05	101.390.923,36	6,53%
XP TREND PÓS FIXADO	26.559.284/0001-44	334.029,33	0,02%

ARTIGO 7º inciso III alínea "a" = Referenciado

BB FLUXO FIC RF	13.077.415/0001-05	1.741.376,26	0,11%
BB PERFIL FIC RF REFERENCIADO DI	13.077.418/0001-49	160.293.871,37	10,32%
CAIXA BR DIPONIBILIDADE FIC RF	14.508.643/0001-55	686.530,98	0,04%
CAIXA BR FI RF REFERENCIADO DI LP	03.737.206/0001-97	71.408.522,96	4,60%
ITAÚ INST FI REFERENCIADO DI	00.832.435/0001-00	370.128.937,48	23,83%
ITAÚ INST GLOBAL DINÂMICO FIC RF	32.972.942/0001-28	113.252.642,63	7,29%
BTG PACTUAL TESOIRO SELIC FI RF REF DI	09.215.250/0001-13	19.626.990,14	1,26%
BRANDESCO PREMIUM RF REFERENCIADO DI	03.399.411/0001-90	33.293.529,86	2,14%

ARTIGO 7º inciso V alínea "b" = Crédito Privado

ITAÚ - High Grade	09.093.883/0001-04	21.708.142,80	1,40%
-------------------	--------------------	---------------	-------

1.474.471.769,12 94,93%

RENTA VARIÁVEL

ARTIGO 8º inciso I

SUL AMÉRICA SELECTION FICFI AÇÕES	34.525.068/0001-06	4.441.683,37	5,64%
FINACAP MAURITSSTAD FIA	05.964.067/0001-60	5.010.913,04	6,36%

ARTIGO 10º inciso I = Fundos Multimercado

ITAÚ INST MM JUROS E MOEDAS FICFI	00.973.117/0001-51	10.404.853,57	0,67%
ICATU VANG IGARATE LONG BIASED FIM	35.637.151/0001-30	9.825.407,96	0,63%
CAIXA FI JUROS E MOEDAS MM	14.120.520/0001-42	48.807.309,87	3,14%

ARTIGO 11º = Fundos Imobiliários

CAIXA RIO BRAVO FDO DE FUNDOS FII	17.098.794/0001-70	279.720,00	0,02%
-----------------------------------	--------------------	------------	-------

78.769.887,81 5,07%

TOTAL 1.553.241.656,93 100,00%

NITERÓI PREV

Enquadramentos na Portaria nº 1.467/2022 e Política de Investimento (REDA FIXA) - base (OUTUBRO / 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%	1.553.241.656,93
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	682.331.224,64	43,93%	0,00%	38,00%	100,00%	56,07%	870.910.432,29
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%			0,00%		100,00%	100,00%	1.553.241.656,93
Artigo 7º, Inciso II	5,00%			0,00%		5,00%	5,00%	77.662.082,85
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	770.432.401,68	49,60%	0,00%	47,00%	60,00%	10,40%	161.512.592,48
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	60,00%			0,00%		60,00%	60,00%	931.944.994,16
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%			0,00%	1,00%	20,00%	20,00%	310.648.331,39
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	5,00%			0,00%	1,00%	5,00%	5,00%	77.662.082,85
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	21.708.142,80	1,40%	0,00%	1,00%	5,00%	3,60%	55.953.940,05
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'c'	5,00%			0,00%	1,00%	5,00%	5,00%	77.662.082,85
Total Renda Fixa		1.474.471.769,12	94,93%					

Enquadramentos na Portaria nº 1.467/2022 e Política de Investimento (REDA VARIÁVEL) - base (OUTUBRO / 2023)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira (R\$)	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior	
				Inferior	Alvo	Superior	%	(R\$)
Artigo 8º - Inciso I	30,00%	9.452.596,41	0,61%	0,00%	3,00%	30,00%	29,39%	456.519.900,67
Artigo 8º - Inciso II	30,00%			0,00%		30,00%	30,00%	465.972.497,08
Total Investimentos Renda Variável		9.452.596,41	0,61%					

Enquadramentos na Portaria nº 1.467/2022 e Política de Investimento (EXTERIOR) - base (OUTUBRO / 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%	155.324.165,69
Artigo 9º - Inciso II	10,00%			0,00%		10,00%	10,00%	155.324.165,69
Artigo 9º - Inciso III	10,00%			0,00%	2,00%	10,00%	10,00%	155.324.165,69
Total Investimentos no Exterior		0,00	0,00%					

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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira (R\$)	Carteira %	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior	
				Inferior	Alvo	Superior	%	(R\$)
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	69.037.571,40	4,44%	0,00%	4,00%	10,00%	5,56%	86.286.594,29
Artigo 10º, Inciso II	5,00%			0,00%		5,00%	5,00%	77.662.082,85
Artigo 10º, Inciso III	5,00%			0,00%		5,00%	5,00%	77.662.082,85
Total Investimentos Estruturados		69.037.571,40	4,44%					

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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira (R\$)	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior	
				Inferior	Alvo	Superior	%	(R\$)
Artigo 11º	5,00%	279.720,00	0,02%	0,00%	1,00%	5,00%	4,98%	77.382.362,85
Total Exterior		279.720,00	0,02%	0,00%	1,00%	5,00%		

Enquadramentos na Portaria nº 1.467/2022 e Política de Investimento (EMPREST. CONSIGNADO) - base (OUTUBRO / 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%	77.662.082,85
Total Exterior		0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%		

Total Carteira Nitprev		1.553.241.656,93	100,00%
-------------------------------	--	------------------	---------

OUTUBRO / 2023

Retorno dos Fundos por Planos Constituídos

FUNDOS	ATIVO		RETORNO				
	CARTEIRA		REAL (\$)				
	REAL (\$)	%	NIT PREV	FINANCEIRO	OSCILAÇÃO	PREVIDENCIARIO	TOTAL
BBrasil - IRF M1	117.873.905,34	7,59 %				509.961,95	509.961,95
BBrasil - IRF M	0,00	0,00 %				189.933,32	189.933,32
BBrasil - IMA-B	0,00	0,00 %				23.310,52	23.310,52
BBrasil - IPCA XXI 2024	53.192.053,89	3,42 %				230.912,62	230.912,62
BBrasil - Vert IPCA 2024	60.183.097,41	3,87 %				266.019,56	266.019,56
BBrasil - FLUXO	1.741.376,26	0,11 %	722,18	3.089,15		19.088,61	22.899,94
BBrasil - PERFIL	160.293.871,37	10,32 %				1.415.192,53	1.415.192,53
BBrasil - MM MACRO	0,00	0,00 %				-30.289,95	-30.289,95
TOTAL BB	393.284.304,27	25,32 %	722,18	3.089,15	0,00	2.624.129,16	2.627.940,49
Caixa - DISPONIBILIDADE	686.530,98	0,04 %	1.734,78	3.580,41		908,87	6.224,06
Caixa - ALIANÇA	249.308.504,83	16,05 %				2.415.158,88	2.415.158,88
Caixa - FI BR 2024 X TP RF	77.428.255,35	4,98 %				342.676,74	342.676,74
Caixa - REFERENCIADO DI	71.408.522,96	4,60 %				718.883,07	718.883,07
Caixa - JUROS MOEDAS	48.807.309,87	3,14 %				412.629,04	412.629,04
Caixa - RIO BRAVO	279.720,00	0,02 %				-5.740,00	-5.740,00
TOTAL CAIXA	447.918.843,99	28,84 %	1.734,78	3.580,41	0,00	3.884.516,60	3.889.831,79
ITAÚ - ASSETNTN-B 2024 RF FI	101.390.923,36	6,53 %				441.981,33	441.981,33
ITAÚ - Global	113.252.642,63	7,29 %	197.527,37	163.311,28		422.234,74	783.073,39
ITAÚ - LEGEND	10.811.560,64	0,70 %				225.830,68	225.830,68
ITAÚ - REFERENC. DI	370.128.937,48	23,83 %	77.716,73	240.954,70	1.610.935,84	1.320.379,15	3.249.986,42
ITAÚ - SOBERANO	11.808.894,49	0,76 %	35.581,15	45.235,84		41.520,08	122.337,07
ITAÚ - ALOCAÇÃO DIN.	0,00	0,00 %				108.741,49	108.741,49
ITAÚ - HIGH GRADE	21.708.142,80	1,40 %				250.607,64	250.607,64
ITAÚ - JUROS MOEDA	10.404.853,57	0,67 %				99.313,61	99.313,61
TOTAL ITAÚ	639.505.954,97	41,17 %	310.825,25	449.501,82	1.610.935,84	2.910.608,72	5.281.871,63
Bradesco - PREMIUM	33.293.529,86	2,14 %				347.375,60	347.375,60
Bradesco - SELECTION	4.441.683,37	0,29 %				-352.218,11	-352.218,11
Bradesco - ICATU VANG	9.825.407,96	0,63 %				-131.683,68	-131.683,68
Bradesco - FINACAP	5.010.913,04	0,32 %				10.913,04	10.913,04
TOTAL BRADESCO	52.571.534,23	3,38 %	0,00	0,00	0,00	-125.613,15	-125.613,15
XP - TREND PÓS	334.029,33	0,02 %				3.182,39	3.182,39
TOTAL XP INVEST	334.029,33	0,02 %	0,00	0,00	0,00	3.182,39	3.182,39
BTG - TESOURO IPCA LONGO	0,00	0,00 %				-169.953,98	-169.953,98
BTG - TESOURO SELIC REF DI	19.626.990,14	1,26 %				0,00	0,00
TOTAL BTG PACTUAL	19.626.990,14	1,26 %	0,00	0,00	0,00	-169.953,98	-169.953,98
TOTAL	1.553.241.656,93	100,00%	313.282,21	456.171,38	1.610.935,84	9.126.869,74	11.507.259,17

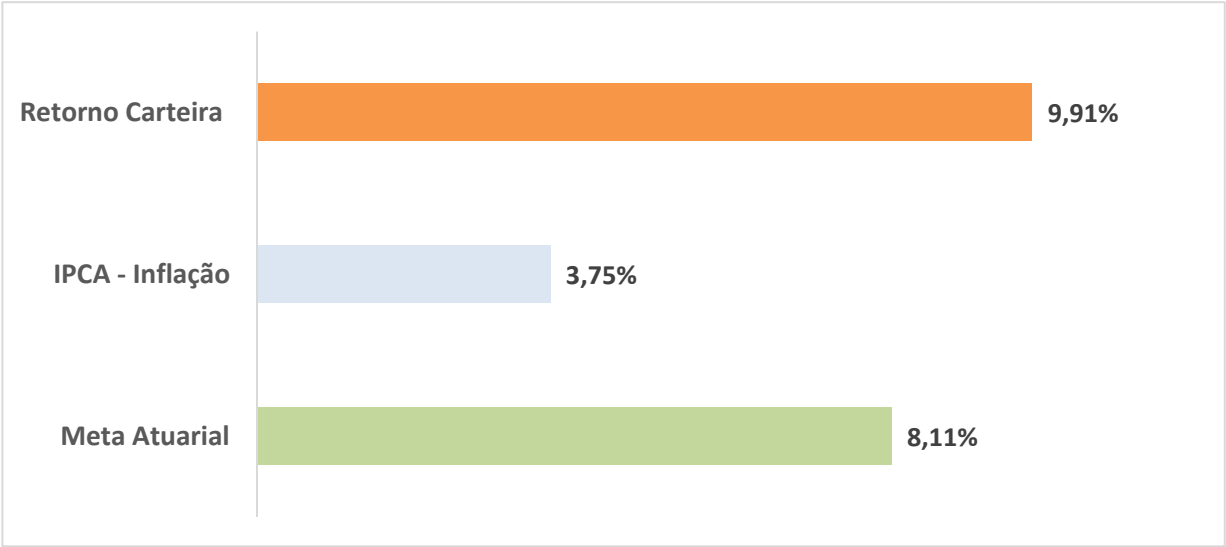
NITERÓI PREV

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	1.274.641.802,66	15.853.186,74	1,23%	-0,08%	0,33%
JULHO	1.300.058.095,50	13.516.853,01	1,03%	0,12%	0,54%
AGOSTO	1.328.627.171,42	10.717.417,96	0,72%	0,23%	0,69%
SETEMBRO	1.505.081.508,22	10.952.322,03	0,72%	0,26%	0,66%
OUTUBRO	1.528.921.358,82	11.507.259,17	0,75%	0,24%	0,66%
NOVEMBRO					
DEZEMBRO					

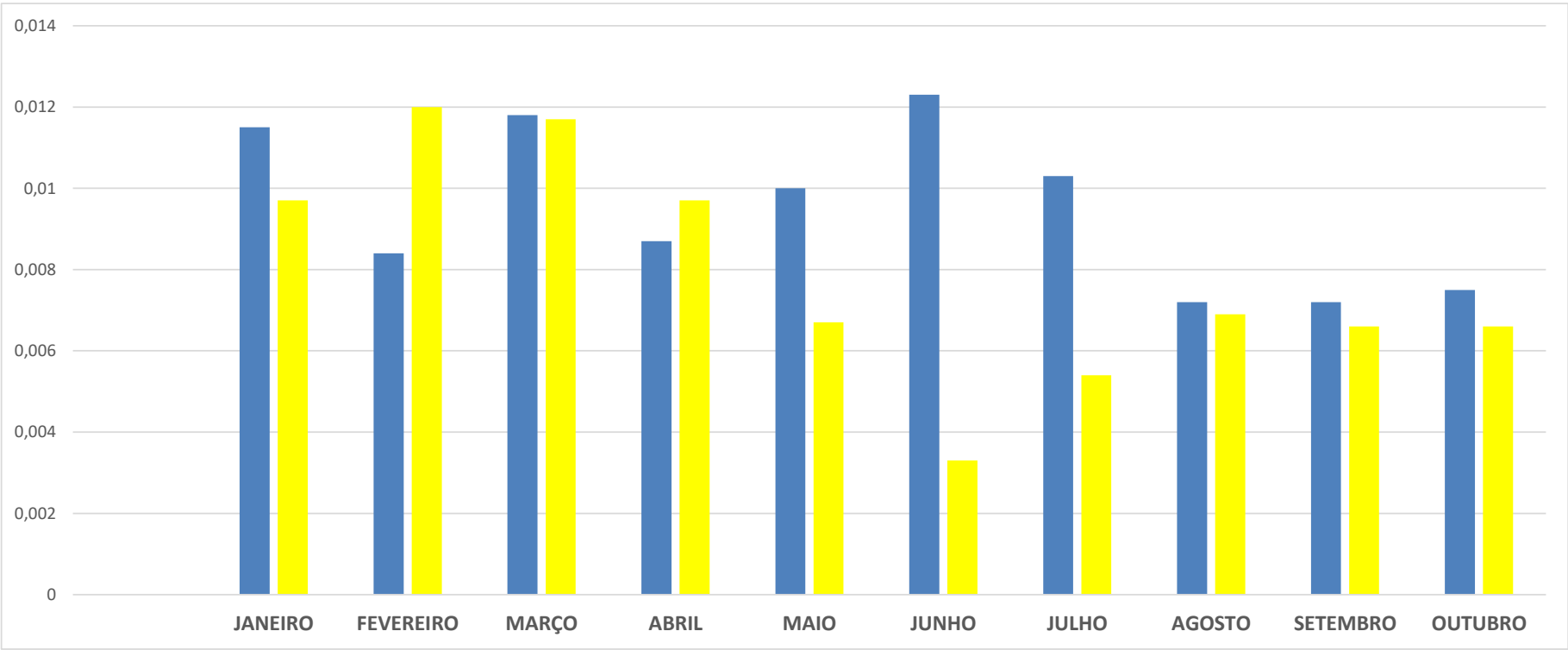
123.657.708,77 9,91% 3,75% 8,11%



Niterói Previdência

NITERÓI PREV

	JANEIRO	FEVEREIRO	MARÇO	ABRIL	MAIO	JUNHO	JULHO	AGOSTO	SETEMBRO	OUTUBRO	NOVEMBRO	DEZEMBRO
RETORNO	1,15%	0,84%	1,18%	0,87%	1,00%	1,23%	1,03%	0,72%	0,72%	0,75%		
META ATUARIAL	0,97%	1,20%	1,17%	0,97%	0,67%	0,33%	0,54%	0,69%	0,66%	0,66%		



RENDIMENTOS POR FUNDO ANO 2023.

	Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Maiο	Junho	Julho	Agosto	Setembro	Outubro	Novembro	Dezembro	TOTAL
RENTA FIXA													
BB - IPCA I 2022	27.065,08	22.363,73	28.863,60	22.825,09	12.784,01								113.901,51
BB - IPCA 2023	809.157,20	500.676,89	654.041,31	531.297,34	359.498,40								2.854.671,14
BB - IPCA XXI 2024	714.224,60	697.478,35	654.780,51	266.999,57	-4.704,83	487.249,53	558.431,71	477.500,52	575.369,57	230.912,62			4.658.242,15
BB - Vert IPCA 2024					-106.748,82	557.375,03	637.605,26	545.815,42	655.776,24	266.019,56			2.555.842,69
BB - IMA-B						664.852,55	298.201,67	-189.318,97	-426.162,75	23.310,52			370.883,02
BB - IRF-M					103.272,28	879.741,92	475.483,10	445.114,95	86.447,68	189.933,32			2.179.993,25
BB - FLUXO	21.967,96	9.298,33	12.929,96	3.517,88	6.000,86	4.205,78	7.598,14	46.472,34	46.207,88	22.899,94			181.099,07
BB - PERFIL	2.329.540,87	1.725.574,57	2.369.575,50	1.828.680,70	2.339.263,54	1.497.448,61	1.189.047,06	1.303.923,35	1.107.618,83	1.415.192,53			17.105.865,56
BB - IRF-M1	322.430,13	296.353,72	433.443,07	345.206,74	471.186,62	492.205,18	454.910,46	484.592,09	397.053,34	509.961,95			4.207.343,30
CEF - DISPONIB.	14.315,45	11.866,84	15.307,34	10.152,26	5.542,14	20.518,76	19.924,37	12.534,80	10.796,01	6.224,06			127.182,03
CEF - ALIANÇA	2.271.599,33	1.756.068,28	2.248.111,39	1.777.725,51	2.193.304,69	1.781.409,02	1.488.879,01	1.549.709,69	2.132.423,24	2.415.158,88			19.614.389,04
CEF - IPCA - 2023	1.085.522,33	671.085,61	876.661,54	712.059,63	481.392,30								3.826.721,41
CEF - Vert IPCA 2024					-136.424,22	715.591,69	820.048,86	703.407,74	843.354,72	342.676,74			3.288.655,53
CEF - IRF-M						459.802,15	357.045,56	298.774,08	-31.347,46				1.084.274,33
CEF - IMA-B					106.601,14	1.129.565,89	490.807,74	-243.731,39	-159.913,12				1.323.330,26
CEF - REFERENC. DI	1.752.285,22	1.294.154,57	1.606.420,78	1.206.977,46	1.432.397,80	903.643,97	779.805,12	855.123,49	718.096,24	718.883,07			11.267.787,72
ITAÚ - Vert 2024					-108.265,16	933.026,65	1.067.952,60	692.663,82	1.099.276,51	441.981,33			4.126.635,75
ITAÚ - GLOBAL	695.550,57	598.953,72	976.979,89	604.129,40	1.112.050,91	995.092,05	1.023.083,73	706.404,56	460.638,44	783.073,39			7.955.956,66
ITAÚ - LEGEND	58.011,45	38.821,32	126.183,38	75.764,50	197.508,60	85.096,33	88.835,71	36.450,60	43.624,44	225.830,68			976.127,01
ITAÚ - REFERENC.	2.461.899,70	1.627.246,02	2.607.986,00	1.957.828,41	1.663.808,03	1.517.819,79	1.358.499,83	1.806.396,97	3.090.767,13	3.249.986,42			21.342.238,30
ITAÚ - SOBERANO	71.506,28	60.687,59	92.198,55	90.725,40	90.326,02	128.511,44	92.681,31	81.348,10	95.538,91	122.337,07			925.860,67
ITAÚ - ALOCAÇÃO			246.202,85	275.451,92	754.104,57	950.287,00	570.901,83	220.477,84	-193.812,33	108.741,49			2.932.355,17
ITAÚ - HIGH GRADE			54.540,17	184.268,72	228.284,95	244.732,70	245.571,04	273.855,96	226.281,62	250.607,64			1.708.142,80
BRA - PREMIUM	181.647,64	224.861,81	301.014,51	234.112,38	305.894,80	301.860,06	318.977,75	345.593,70	324.335,54	347.375,60			2.885.673,79
XP-TREND			578,39	2.601,74	3.477,63	3.366,54	3.292,24	3.698,07	3.201,40	3.182,39			23.398,40
XP-Inflação	-2.943,03	927,81	5.985,18										3.969,96
BTG- TESOIRO IPCA Curto				14.314,39	55.471,43	104.222,59	17.630,56						191.638,97
BTG- TESOIRO IPCA Longo							262.539,20	-264.967,40	-392.266,65	-169.953,98			-564.648,83
BTG- TESOIRO SELIC REF DI										0,00			0,00
	12.813.780,78	9.536.419,16	13.311.803,92	10.144.639,04	11.566.027,69	14.857.625,23	12.627.753,86	10.191.840,33	10.713.305,43	11.504.335,22	0,00	0,00	117.267.530,66
RENTA VARIÁVEL													
BRA - Sul Amér. SELECTION									-206.098,52	-352.218,11			-558.316,63
BRA - FINACAP										10.913,04			10.913,04
BB - Multim. Macro	316.813,86	94.010,18	348.444,59	238.078,40	306.592,14	257.449,15	308.819,06	-28.991,16	-6.118,03	-30.289,95			1.804.808,24
BB - Multim. Dinam.	23.500,22	-23.594,50	36.076,34										35.982,06
ITAÚ - MM Juros Moedas	182.119,92	322.826,78	149.144,60	80.631,71	126.279,96	132.578,04	108.095,84	111.823,19	92.039,92	99.313,61			1.404.853,57
BRA - ICATU VANG									-42.908,36	-131.683,68			-174.592,04
CEF - Juros Moedas MM		107.063,10	445.351,93	344.292,30	622.412,74	568.609,32	467.284,25	429.025,60	410.641,59	412.629,04			3.807.309,87
CX - RIO BRAVO	1.400,00	-6.160,00	3.045,00	2.205,00	17.465,00	36.925,00	4.900,00	13.720,00	-8.540,00	-5.740,00			59.220,00
	523.834,00	494.145,56	982.062,46	665.207,41	1.072.749,84	995.561,51	889.099,15	525.577,63	239.016,60	2.923,95	0,00	0,00	6.390.178,11
													123.657.708,77
	13.337.614,78	10.030.564,72	14.293.866,38	10.809.846,45	12.638.777,53	15.853.186,74	13.516.853,01	10.717.417,96	10.952.322,03	11.507.259,17	0,00	0,00	123.657.708,77

Período de: 01.10.2023 até 31.10.2023

DATA	BANCO	CONTA	PLANO CONSTITUÍDO	FUNDO INVESTIMENTO	ATIVO				ANÁLISE/PARECER DO COMIN	
					ANBIMA	ARTIGO	HISTÓRICO	VALOR	DESCRIÇÃO DA OPERAÇÃO	DATA
02/out	BB	40.200-5	Financeiro	Fluxo	RF	7º,III,a	Aplicação	421,96	Repasse referente contribuição Patronal e Servidores.	
05/out	Itaú	46.761-8	Previdenciário	Soberano	RF	7º, I, b	Aplicação	3.500.000,00	Repasse referente contribuição Patronal e Servidores.	
05/out	Itaú	46.761-8	Previdenciário	Referenciado DI	RF	7º,III,a	Aplicação	5.000.000,00	Repasse referente contribuição Patronal e Servidores.	
10/out	BB	40.100-9	Previdenciário	Macro- Multimerc.	RF	10º,I	Resgate	-11.488.088,71	Troca posição, Fdo para DI melhor rentabilidade.	06/out
10/out	BB	40.100-9	Previdenciário	IMA-B	RF	7º, I, b	Resgate	-43.581.435,00	Troca posição, Fdo para DI melhor rentabilidade.	06/out
10/out	BB	40.100-9	Previdenciário	IRF-M1	RF	7º, I, b	Aplicação	10.871.688,18	Troca posição, Fdo Multim. Para melhor rentabilidade.	06/out
10/out	BB	40.100-9	Previdenciário	Fluxo	RF	7º,III,a	Aplicação	1.997.170,05	Troca posição,para Fdos melhor rentabilidade.	06/out
10/out	BB	40.100-9	Previdenciário	Perfil	RF	7º,III,a	Aplicação	42.200.665,48	Troca posição,para Fdos melhor rentabilidade.	06/out
11/out	Itaú	46.763-4	Financeiro	Soberano	RF	7º, I, b	Aplicação	902.002,40	Repasse referente contribuição Patronal e Servidores.	
11/out	Itaú	46.763-4	Financeiro	Referenciado DI	RF	7º,III,a	Aplicação	2.097.997,63	Repasse referente contribuição Patronal e Servidores.	
11/out	Itaú	46.761-8	Previdenciário	Referenciado DI	RF	7º,III,a	Aplicação	4.800.000,00	Repasse referente contribuição Patronal e Servidores.	
11/out	XP inv.	80.248-8	Previdenciário	Trend	RF	7º, I, b	Aplicação	2.030,00	Aplicação com distribuição dos rendimentos FII Rio Bravo.	
17/out	Itaú	46.761-8	Previdenciário	Referenciado DI	RF	7º,III,a	Resgate	-5.000.000,01	Pagamento despesas Administrativas e Previdenciarias	
18/out	Bradesco	19.504-9	Previdenciário	Finacap	RV	8º,I	Aplicação	5.000.000,00	Troca posição, de Multimercado para Fundo de Ações.	11/ago
23/out	Itaú	46.763-4	Financeiro	Referenciado DI	RF	7º,III,a	Resgate	-3.500.000,03	Pagamento despesas Administrativas e Previdenciarias	
23/out	Itaú	46.761-8	Previdenciário	Soberano	RF	7º, I, b	Resgate	-100.000,00	Pagamento despesas Administrativas e Previdenciarias	
27/out	Itaú	46.758-4	Niterói Prev	Referenciado DI	RF	7º,III,a	Aplicação	1.000.000,00	Repasse referente contribuição Patronal e Servidores.	
27/out	Itaú	46.760-0	Previdenciário	Global	RF	7º,III,a	Aplicação	1.047.229,51	Pagto acordo de atraso de contribuição Previdenciaria.	
27/out	Itaú	46.761-8	Previdenciário	Alocação Dinam.	RF	7º, I, b	Resgate	-64.689.650,53	Troca posição,para Fdos melhor rentabilidade.	27/out
30/out	BB	40.100-9	Previdenciário	IRF-M	RF	7º, I, b	Resgate	-62.179.993,25	Troca posição, Fdo para DI melhor rentabilidade.	27/out
30/out	BB	40.100-9	Previdenciário	IRF-M1	RF	7º, I, b	Aplicação	60.496.937,45	Troca posição,para Fdos melhor rentabilidade.	27/out
30/out	BB	40.100-9	Previdenciário	Fluxo	RF	7º,III,a	Aplicação	1.681.055,80	Troca posição,para Fdos melhor rentabilidade.	27/out
30/out	Itaú	46.761-8	Previdenciário	Soberano	RF	7º, I, b	Resgate	-1.898.000,00	Pagamento despesas Administrativas e Previdenciarias	
30/out	Itaú	46.761-8	Previdenciário	Referenciado DI	RF	7º,III,a	Aplicação	64.689.650,54	Troca posição, Fdo para DI melhor rentabilidade.	27/out
30/out	BTG	50.454-6	Previdenciário	Tesouro IPCA	RF	7º, I, b	Resgate	-19.626.990,14	Troca posição,para Fdos melhor rentabilidade.	27/out
31/out	BB	40.200-5	Financeiro	Fluxo	RF	7º,III,a	Resgate	-38.341,43	Pagamento despesas Administrativas e Previdenciarias	
31/out	BB	40.100-9	Previdenciário	IRF-M1	RF	7º, I, b	Aplicação	1.681.055,80	Troca posição,para Fdos melhor rentabilidade.	27/out
31/out	BB	40.100-9	Previdenciário	Fluxo	RF	7º,III,a	Resgate	-3.062.126,42	Troca posição,para Fdos melhor rentabilidade.	27/out
31/out	BB	40.100-9	Previdenciário	Perfil	RF	7º,III,a	Aplicação	1.380.769,52	Troca posição,para Fdos melhor rentabilidade.	06/out
31/out	BTG	50.454-6	Previdenciário	Tesouro SELIC	RF	7º, I, b	Aplicação	19.626.990,14	Troca posição,para Fdos melhor rentabilidade.	27/out

12.811.038,94

Niterói Previdência NITERÓI PREV

FUNDO NITERÓI PREV

FUNDO FINANCEIRO

FUNDO DE OSCILAÇÃO DE RISCO

FUNDO PREVIDENCIÁRIO

APOORTE e RETORNO

ano 2023

MÊS	SALDO ANTERIOR	APOORTE	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	1.274.641.802,67	9.563.106,09	15.853.186,74	1.300.058.095,50
JULHO	1.300.058.095,50	15.052.222,92	13.516.853,01	1.328.627.171,43
AGOSTO	1.328.627.171,43	165.736.918,84	10.717.417,96	1.505.081.508,23
SETEMBRO	1.505.081.508,23	12.887.528,56	10.952.322,03	1.528.921.358,82
OUTUBRO	1.528.921.358,62	12.813.039,14	11.507.259,17	1.553.241.656,93
NOVEMBRO				
DEZEMBRO				
ACUMULADO ANO		281.421.784,07	123.657.708,77	
		APOORTE	RETORNO	

Niterói Previdência
NITERÓI PREV

FUNDO NITERÓI PREV
FUNDO FINANCEIRO
FUNDO PREVIDENCIÁRIO

APOORTE E RENTABILIDADE

ANO	SALDO JANEIRO	APOORTE 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	281.421.784,07	123.657.708,77	1.553.241.656,93
		1.116.844.406,27	423.027.280,13	

APORTES EFETUADOS

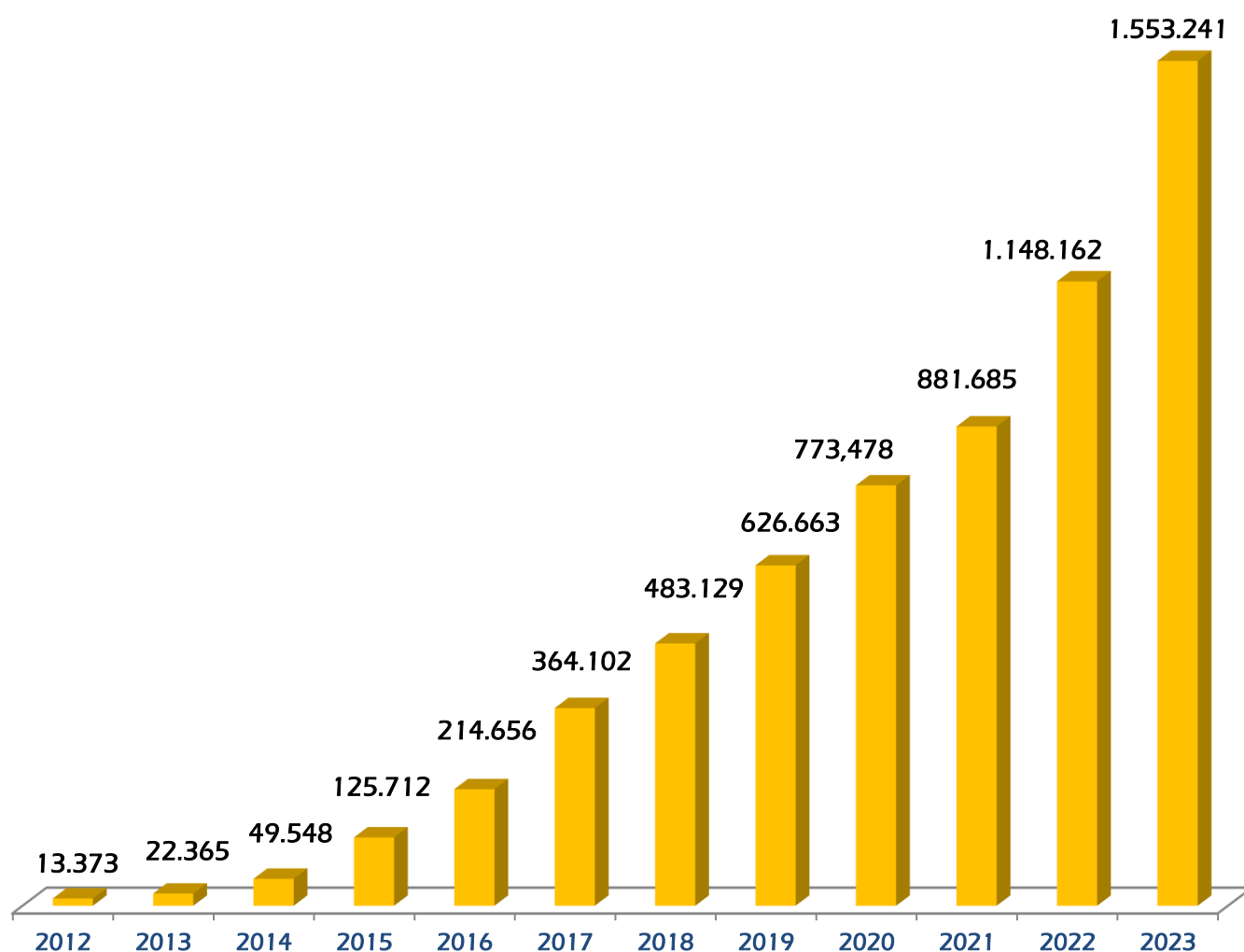
RENTABILIDADE

Base outubro/2023

FUNDO NITERÓI PREV
FUNDO FINANCEIRO
FUNDO OSCILAÇÃO DE RISCO
FUNDO PREVIDENCIÁRIO

Evolução da Carteira de Investimentos

Posição em 31.10.2023



11613,99%

PATRIMÔNIO LÍQUIDO

Carteira de Investimentos

Imóveis

1.570.500.084,86

1.553.241.656,93

17.258.427,93