



MACAIBAPREV



Setembro/2023

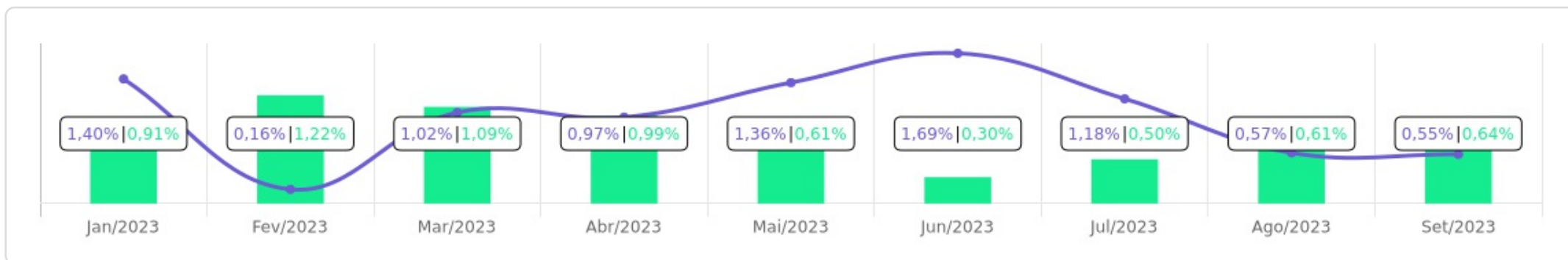


<p>Patrimônio</p> <p>R\$ 90.897.914,29</p>	<p>Rentabilidade</p> <p>Mês: 0,55%</p> <p>Acum.: 9,25%</p>	<p>Meta</p> <p>Mês: 0,64%</p> <p>Acum.: 7,06%</p>	<p>Gap</p> <p>Mês: -0,08%</p> <p>Acum.: 2,19%</p>	<p>VaR</p> <p>0,26%</p>
--	--	---	---	-------------------------

Evolução do Patrimônio







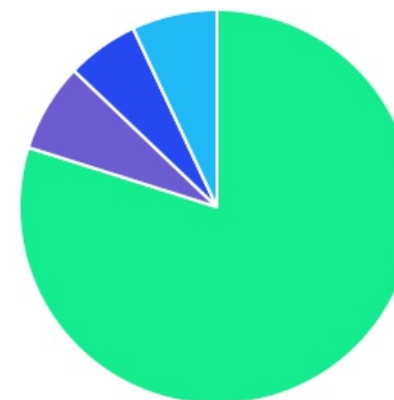
Comparativo (Rentabilidades | Metas)










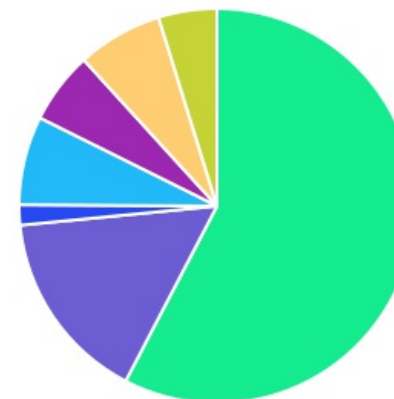
ATIVO	SALDO	CARTEIRA(%)	RESG.	4.963	RETORNO (R\$)	(%)
BB IRF-M TP FI RF PREVID	R\$ 2.842.161,60	3.14%	D+1	7, I "b"	R\$ 3.963,51	0,14%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI...	R\$ 22.029.419,10	24.34%	D+0	7, I "b"	R\$ 198.490,45	0,91%
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF...	R\$ 2.139.220,98	2.36%	D+0	7, I "b"	R\$ 3.119,34	0,15%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RF	R\$ 3.018.772,63	3.33%	D+0	7, I "b"	R\$ 12.141,67	0,40%
CAIXA BRASIL 2024 I TP FI...	R\$ 820.887,93	0.91%	0	7, I "b"	R\$ 8.908,27	1,10%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP FI...	R\$ 1.655.671,97	1.83%	D+0	7, I "b"	R\$ 1.850,82	0,11%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA...	R\$ 8.576.033,54	9.47%	D+360	7, I "b"	R\$ 93.169,98	1,10%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS...	R\$ 4.453.792,50	4.92%	0	7, I "b"	R\$ 48.726,71	1,11%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC...	R\$ 2.601.020,66	2.87%	D+3	7, I "b"	R\$ 22.646,67	0,88%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI...	R\$ 4.037.709,98	4.46%	D+0	7, I "b"	R\$ 44.191,64	1,11%
BB FLUXO FIC RF PREVID	R\$ 1.777.818,48	1.96%	D+0	7, III "a"	R\$ 26.487,37	0,54%
CAIXA BRASIL FI RF REF DI...	R\$ 10.460.903,37	11.56%	D+0	7, III "a"	R\$ 106.266,42	1,03%
MONGERAL AEGON FI RF	R\$ 2.070.799,72	2.29%	D+0	7, III "a"	R\$ 20.309,92	0,99%
INTER CORPORATE FI RF CRÉDITO PRIVADO	R\$ 1.500.784,75	1.66%	D+0	7, V "b"	R\$ 784,75	0,05%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVID	R\$ 325.411,72	0.36%	D+3	8, I	R\$ 2.909,61	0,90%
CAIXA BRASIL AÇÕES...	R\$ 1.518.879,83	1.68%	D+15	8, I	R\$ -1.841,37	-0,12%
BB AÇÕES ENERGIA FI AÇÕES	R\$ 1.979.850,17	2.19%	D+3	8, I	R\$ 2.847,61	0,14%
BB FATORIAL FIC AÇÕES	R\$ 697.184,03	0.77%	D+3	8, I	R\$ 3.264,18	0,47%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	R\$ 2.051.393,25	2.27%	D+3	8, I	R\$ 749,14	0,04%
BB AÇÕES ESG FI AÇÕES -...	R\$ 3.599.576,98	3.98%	D+4	9, III	R\$ -122.263,94	-3,29%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR...	R\$ 1.731.095,84	1.91%	D+3	9, III	R\$ -64.179,01	-3,57%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES...	R\$ 1.262.999,72	1.40%	D+2	10, I	R\$ 8.321,82	0,66%







CAIXA JUROS E...	R\$ 2.818.248,01	3,11%	D+0	10, I	R\$ 23.913,58	0,86%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO...	R\$ 2.230.085,73	2,46%	D+3	10, I	R\$ 11.074,83	0,50%
TÍTULOS PRIVADOS	R\$ 4.320.623,26	4,77%	-	7, IV	R\$ 31.951,43	0,75%
Total investimentos	R\$ 90.520.345,75	100,00%			R\$ 487.805,40	0,55%
Disponibilidade	R\$ 377.568,54	-			-	-
Total patrimônio	R\$ 90.897.914,29	100,00%			-	-

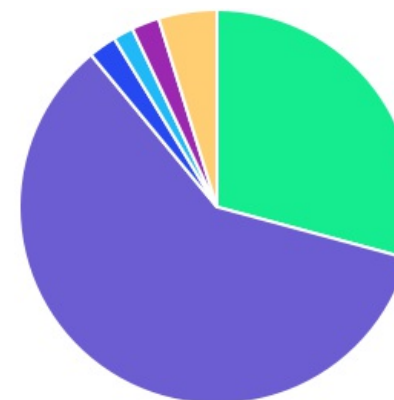
CLASSE	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Renda Fixa	79,88%	R\$ 72.305.620,47	
Renda Variável	7,26%	R\$ 6.572.719,00	
Estruturados	6,97%	R\$ 6.311.333,46	
Exterior	5,89%	R\$ 5.330.672,82	
<b>Total</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 90.520.345,75</b>	








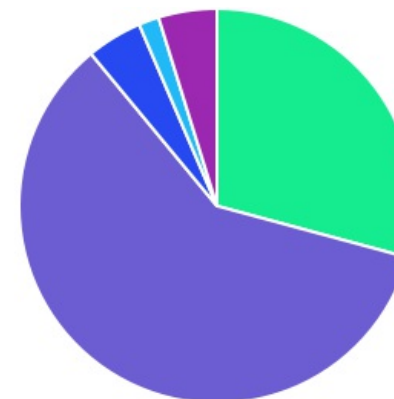
ENQUADRAMENTO	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	57,64%	R\$ 52.174.690,89	
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	15,81%	R\$ 14.309.521,57	
Artigo 8º, Inciso I	7,26%	R\$ 6.572.719,00	
Artigo 10º, Inciso I	6,97%	R\$ 6.311.333,46	
Artigo 9º, Inciso III	5,89%	R\$ 5.330.672,82	
Artigo 7º, Inciso IV	4,77%	R\$ 4.320.623,26	
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " b "	1,66%	R\$ 1.500.784,75	
<b>Total</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 90.520.345,75</b>	














GESTOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
CAIXA DISTRIBUIDORA	59,81%	R\$ 54.139.977,61	
BB GESTAO	29,21%	R\$ 26.436.767,16	
TÍTULOS	4,77%	R\$ 4.320.623,26	
MONGERAL AEGON	2,29%	R\$ 2.070.799,72	
FINACAP INVESTIMENTOS	2,27%	R\$ 2.051.393,25	
INTER ASSET	1,66%	R\$ 1.500.784,75	
<b>Total</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 90.520.345,75</b>	






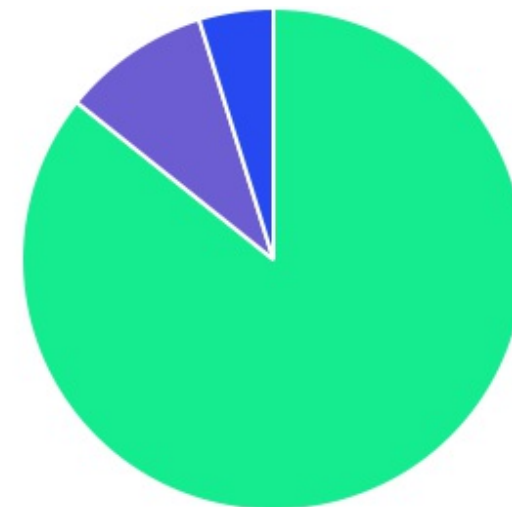
ADMINISTRADOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
CAIXA ECONOMICA	59,81%	R\$ 54.139.977,61	
BB GESTAO	29,21%	R\$ 26.436.767,16	
TÍTULOS	4,77%	R\$ 4.320.623,26	
BEM - DISTRIBUIDORA	4,55%	R\$ 4.122.192,97	
INTER DISTRIBUIDORA	1,66%	R\$ 1.500.784,75	
<b>Total</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 90.520.345,75</b>	



BENCHMARK	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
IRF-M 1	24,34%	R\$ 22.029.419,10	
CDI	19,93%	R\$ 18.040.392,05	
IPCA	18,85%	R\$ 17.067.536,02	
IBOVESPA	6,47%	R\$ 5.855.868,55	
IMA Geral ex-C	6,21%	R\$ 5.619.793,29	
GLOBAL BDRX	5,89%	R\$ 5.330.672,82	
IRF-M	5,50%	R\$ 4.981.382,58	
TÍTULOS	4,77%	R\$ 4.320.623,26	
125% do CDI	3,11%	R\$ 2.818.248,01	
IMA-B 5	2,74%	R\$ 2.476.559,90	
IEE	2,19%	R\$ 1.979.850,17	
<b>Total</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 90.520.345,75</b>	



LIQUIDEZ	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
0 a 30 dias	85,75%	R\$ 77.623.688,95	
181 a 365 dias	9,47%	R\$ 8.576.033,54	
Acima 2 anos	4,77%	R\$ 4.320.623,26	
<b>Total</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 90.520.345,75</b>	





RENDA FIXA	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
Títulos Tesouro Nacional - SELIC - 7, I "a"	100%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	5,00%	20,00%
FI Renda Fixa Referenciado 100% títulos TN - 7, I "b"	100%	R\$ 52.174.690,89	57.64%	20,00%	35,00%	80,00%
FI em Índices de Renda Fixa 100% títulos TN - 7, I "c"	100%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
Operações Compromissadas - 7, II	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
FI Renda Fixa - 7, III "a"	60%	R\$ 14.309.521,57	15.81%	5,00%	17,00%	50,00%
FI de Índices Renda Fixa - 7, III "b"	60%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
Ativos Bancários - 7, IV	20%	R\$ 4.320.623,26	4.77%	0,00%	10,00%	20,00%
FI Direitos Creditórios (FIDC) - sênior - 7, V "a"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
FI Renda Fixa "Crédito Privado" - 7, V "b"	5%	R\$ 1.500.784,75	1.66%	0,00%	3,00%	5,00%
FI Debêntures - 7, V "c"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
<b>Total Renda Fixa</b>		<b>R\$ 72.305.620,47</b>	<b>79,88%</b>			

RENDA VARIÁVEL	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Ações - 8, I	30%	R\$ 6.572.719,00	7.26%	0,00%	10,00%	20,00%
FI de Índices Ações - 8, II	30%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	5,00%
<b>Total Renda Variável</b>		<b>R\$ 6.572.719,00</b>	<b>7,26%</b>			

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Renda Fixa - Dívida Externa - 9, I	10%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	9,00%
FI Investimento no Exterior - 9, II	10%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	1,00%	9,00%
FI Ações - BDR Nível I - 9, III	10%	R\$ 5.330.672,82	5.89%	0,00%	8,00%	10,00%
<b>Total Investimentos no Exterior</b>		<b>R\$ 5.330.672,82</b>	<b>5,89%</b>			



FUNDOS ESTRUTURADOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Multimercado - aberto - 10, I	10%	R\$ 6.311.333,46	6,97%	0,00%	10,00%	10,00%
FI em Participações - 10, II	5%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
FI "Ações - Mercado de Acesso" - 10, III	5%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
<b>Total Fundos Estruturados</b>		<b>R\$ 6.311.333,46</b>	<b>6,97%</b>			
FUNDOS IMOBILIÁRIOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Imobiliário - 11	5%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	1,00%	4,00%
<b>Total Fundos Imobiliários</b>		<b>R\$ 0,00</b>	<b>0,00%</b>			
EMPRÉSTIMOS CONSIGNADOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
Empréstimos Consignados - 12	5%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
<b>Total Empréstimos Consignados</b>		<b>R\$ 0,00</b>	<b>0,00%</b>			
<b>Total Global</b>		<b>R\$ 90.520.345,75</b>	<b>100,00%</b>			

PERÍODO	SALDO ANTERIOR	SALDO FINAL	META	RENT.(R\$)	RENT.(%)	GAP
<b>2023</b>			IPCA + 4.61% a.a.			
Janeiro	R\$ 62.824.965,61	R\$ 64.368.661,40	0,91%	R\$ 846.215,00	1,40%	0,49%
Fevereiro	R\$ 64.368.661,40	R\$ 65.410.900,15	1,22%	R\$ 93.498,82	0,16%	-1,06%
Março	R\$ 65.410.900,15	R\$ 66.483.448,09	1,09%	R\$ 668.965,22	1,02%	-0,06%
Abril	R\$ 66.483.448,09	R\$ 71.588.517,50	0,99%	R\$ 639.925,60	0,97%	-0,02%
Maiο	R\$ 71.588.517,50	R\$ 82.033.028,64	0,61%	R\$ 1.009.760,29	1,36%	0,75%
Junho	R\$ 82.033.028,64	R\$ 85.346.307,27	0,30%	R\$ 1.403.221,09	1,69%	1,39%
Julho	R\$ 85.346.307,27	R\$ 88.160.653,69	0,50%	R\$ 1.006.837,55	1,18%	0,68%
Agosto	R\$ 88.160.653,69	R\$ 89.551.978,30	0,61%	R\$ 506.264,01	0,57%	-0,04%
Setembro	R\$ 89.551.978,30	R\$ 90.897.914,29	0,64%	R\$ 487.805,40	0,55%	-0,08%
<b>Total</b>	<b>R\$ 89.551.978,30</b>	<b>R\$ 90.897.914,29</b>	<b>7,06%</b>	<b>R\$ 6.662.492,98</b>	<b>9,25%</b>	<b>2,19%</b>
<b>2022</b>			IPCA + 4.79% a.a.			
Janeiro	R\$ 54.434.965,50	R\$ 53.259.992,23	0,93%	R\$ -140.896,90	-0,26%	-1,19%
Fevereiro	R\$ 53.259.992,23	R\$ 53.885.480,87	1,40%	R\$ 128.314,84	0,20%	-1,20%
Março	R\$ 53.885.480,87	R\$ 54.643.773,39	2,01%	R\$ 776.800,35	1,41%	-0,60%
Abril	R\$ 54.643.773,39	R\$ 54.982.809,36	1,45%	R\$ 166.311,74	0,30%	-1,15%
Maiο	R\$ 54.982.809,36	R\$ 56.585.859,87	0,86%	R\$ 439.228,13	0,79%	-0,07%
Junho	R\$ 56.585.859,87	R\$ 55.195.259,98	1,06%	R\$ -70.073,16	-0,14%	-1,20%
Julho	R\$ 55.195.259,98	R\$ 56.302.783,32	-0,29%	R\$ 575.478,76	1,03%	1,32%
Agosto	R\$ 56.302.783,32	R\$ 56.566.956,74	0,03%	R\$ 286.096,57	0,52%	0,49%
Setembro	R\$ 56.566.956,74	R\$ 56.932.180,17	0,10%	R\$ -141.900,28	-0,24%	-0,34%
Outubro	R\$ 56.932.180,17	R\$ 58.603.853,29	0,98%	R\$ 1.175.240,36	2,06%	1,08%

Novembro	R\$ 58.603.853,29	R\$ 58.986.279,55	0,80%	R\$ 190.373,68	0,32%	-0,48%
Dezembro	R\$ 58.986.279,55	R\$ 62.824.965,61	1,01%	R\$ 197.249,89	0,30%	-0,71%
<b>Total</b>	<b>R\$ 58.986.279,55</b>	<b>R\$ 62.824.965,61</b>	<b>10,85%</b>	<b>R\$ 3.582.223,98</b>	<b>6,47%</b>	<b>-4,38%</b>
<b>2021</b>	<b>IPCA + 4.98% a.a.</b>					
Janeiro	R\$ 50.023.561,34	R\$ 49.753.841,09	0,66%	R\$ -60.735,91	-0,12%	-0,77%
Fevereiro	R\$ 49.753.841,09	R\$ 49.666.732,54	1,27%	R\$ -311.325,53	-0,61%	-1,88%
Março	R\$ 49.666.732,54	R\$ 49.979.866,63	1,34%	R\$ 183.072,83	0,37%	-0,96%
Abril	R\$ 49.979.866,63	R\$ 50.188.472,12	0,72%	R\$ 333.995,76	0,67%	-0,05%
Maió	R\$ 50.188.472,12	R\$ 50.737.704,07	1,24%	R\$ 227.074,67	0,44%	-0,80%
Junho	R\$ 50.737.704,07	R\$ 50.382.492,84	0,94%	R\$ -28.885,75	-0,06%	-0,99%
Julho	R\$ 50.382.492,84	R\$ 50.601.003,39	1,37%	R\$ -37.066,57	-0,06%	-1,43%
Agosto	R\$ 50.601.003,39	R\$ 50.536.828,29	1,28%	R\$ -239.353,00	-0,49%	-1,76%
Setembro	R\$ 50.536.828,29	R\$ 50.752.628,50	1,57%	R\$ 37.462,90	0,06%	-1,50%
Outubro	R\$ 50.752.628,50	R\$ 50.774.098,01	1,66%	R\$ -229.889,22	-0,44%	-2,09%
Novembro	R\$ 50.774.098,01	R\$ 51.765.191,94	1,36%	R\$ 661.479,59	1,30%	-0,05%
Dezembro	R\$ 51.765.191,94	R\$ 54.434.965,50	1,14%	R\$ 474.264,95	0,91%	-0,23%
<b>Total</b>	<b>R\$ 51.765.191,94</b>	<b>R\$ 54.434.965,50</b>	<b>15,54%</b>	<b>R\$ 1.010.094,72</b>	<b>1,98%</b>	<b>-13,56%</b>

ATIVO	CNPJ	RENTABILIDADE				
		Mês (%)	Ano (%)	12 meses (%)	24 meses (%)	Início (%)
BB FLUXO FIC RF PREVID	13.077.415/0001-05	0,54%	6,06%	7,20%	-	10,66%
CAIXA BRASIL FI RF REF DI...	03.737.206/0001-97	1,03%	10,09%	13,67%	-	22,95%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RF PREVID	25.078.994/0001-90	-	-	-	-	6,65%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RF	23.215.097/0001-55	0,40%	10,36%	12,82%	-	21,36%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI...	10.740.670/0001-06	0,91%	9,48%	12,13%	-	20,80%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP FI...	11.060.913/0001-10	0,11%	8,79%	11,46%	-	12,83%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP...	14.386.926/0001-71	-	-	-	-	8,96%
CAIXA BRASIL 2024 I TP FI...	18.598.288/0001-03	1,10%	2,97%	5,75%	-	6,20%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR...	17.502.937/0001-68	-3,57%	16,05%	20,13%	-	-8,12%
BB IRF-M TP FI RF PREVID	07.111.384/0001-69	0,14%	0,57%	-	-	0,57%
CAIXA FIC FI NOVO BRASIL RF...	10.646.895/0001-90	-	-	-	-	5,38%
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF...	14.508.605/0001-00	0,15%	0,62%	-	-	0,62%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP FI...	10.577.503/0001-88	-	-	-	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVID	10.418.335/0001-88	0,90%	5,40%	4,22%	-	1,18%
BB TP IPCA FI RF PREVID	15.486.093/0001-83	-	5,87%	10,20%	-	15,96%
BB TP XI FI RF PREVID	24.117.278/0001-01	-	-	-	-	10,97%
CAIXA JUROS E...	14.120.520/0001-42	0,86%	9,35%	12,52%	-	13,87%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	05.900.798/0001-41	-	-0,08%	-1,88%	-	3,83%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO...	08.070.841/0001-87	0,50%	8,36%	10,18%	-	11,50%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC...	35.292.588/0001-89	0,88%	4,04%	-	-	4,04%
BB FATORIAL FIC AÇÕES	07.882.792/0001-14	0,47%	4,43%	1,94%	-	-0,40%

FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	05.964.067/0001-60	0,04%	2,57%	-	-	2,57%
BB AÇÕES ESG FI AÇÕES -...	21.470.644/0001-13	-3,29%	9,45%	15,78%	-	-8,79%
CAIXA BRASIL AÇÕES...	30.068.169/0001-44	-0,12%	11,80%	10,85%	-	11,88%
BB AÇÕES ENERGIA FI AÇÕES	02.020.528/0001-58	0,14%	5,44%	4,93%	-	-1,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA...	44.345.590/0001-60	1,10%	8,82%	11,72%	-	13,01%
MONGERAL AEGON FI RF	11.435.287/0001-07	0,99%	3,54%	-	-	3,54%
ICATU VANGUARDA RF FI PLUS LP	05.755.769/0001-33	-	6,37%	11,78%	-	11,78%
ICATU VANGUARDA FI RF INFLAÇÃO CP...	19.719.727/0001-51	-	5,43%	-	-	6,37%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES...	45.443.651/0001-94	0,66%	14,01%	18,57%	-	14,82%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI...	49.964.484/0001-88	1,11%	3,93%	-	-	3,93%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS...	50.635.944/0001-03	1,11%	0,97%	-	-	0,97%
INTER CORPORATE FI RF CRÉDITO PRIVADO	36.443.522/0001-05	0,05%	0,05%	-	-	0,05%

TÍTULO	VENC.	COMPRA	QTD.	P.U.		MARCAÇÃO	VALOR COMPRA	VALOR ATUAL	RETORNO
				COMPRA	ATUAL				
LF BTG PACTUAL IPCA	17/01/28	16/01/23	8	502.722,48	540.077,91	CURVA 6,40%	R\$ 4.021.779,82	R\$ 4.320.623,26	R\$ 31.951,43 ( 0,75% )
							R\$ 4.021.779,82	R\$ 4.320.623,26	R\$ 31.951,43 ( 0,75% )