



MACAIBAPREV

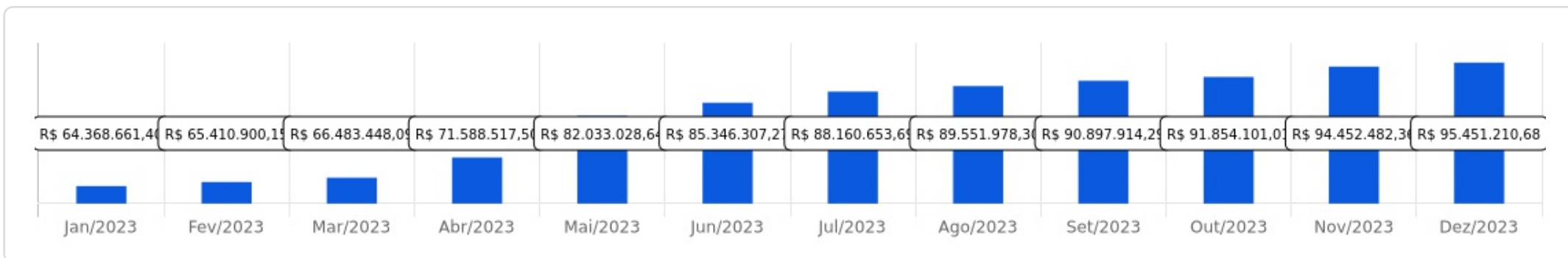


Janeiro a Dezembro de 2023

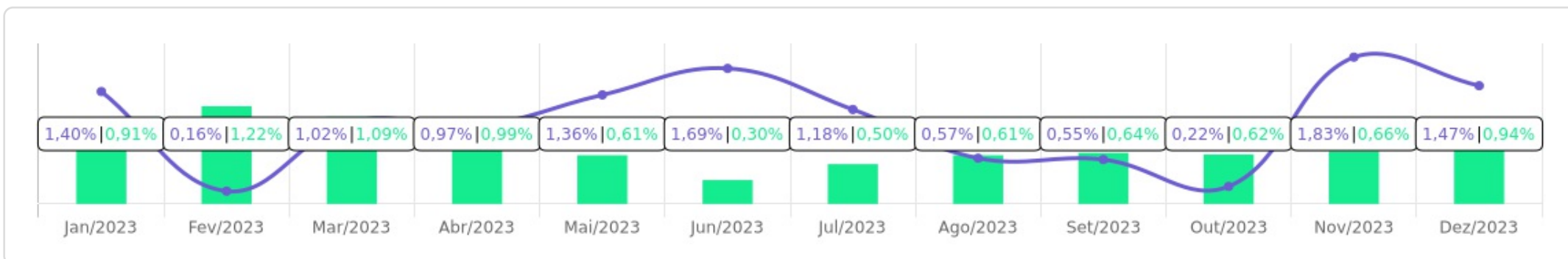


<b>Patrimônio</b> <b>R\$ 95.451.210,68</b>	<b>Rentabilidade</b> Mês: 1,47% Acum.: 13,13%	<b>Meta</b> Mês: 0,94% Acum.: 9,44%	<b>Gap</b> Mês: 0,54% Acum.: 3,69%	<b>VaR</b> 0,22%
---	---	---	--	---------------------





Evolução do Patrimônio

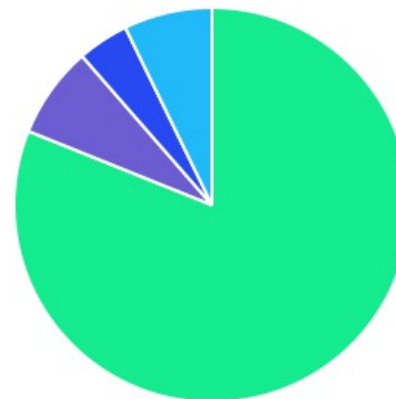









Comparativo (Rentabilidades | Metas)

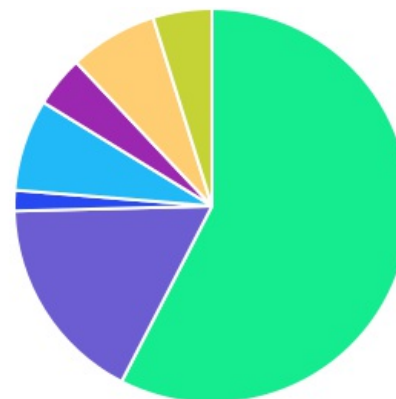








ATIVO	SALDO	CARTEIRA(%)	RESG.	4.963	RETORNO (R\$)	(%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI...	R\$ 24.727.413,27	26.93%	D+0	7, I "b"	R\$ 2.089.436,76	12,41%
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF...	R\$ 5.027.124,07	5.48%	D+0	7, I "b"	R\$ 170.443,05	3,61%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RF	R\$ 3.107.013,37	3.38%	D+0	7, I "b"	R\$ 371.630,41	13,59%
CAIXA BRASIL 2024 I TP FI...	R\$ 838.603,36	0.91%	0	7, I "b"	R\$ 86.187,76	5,19%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP FI...	R\$ 1.704.004,92	1.86%	D+0	7, I "b"	R\$ 182.087,13	11,96%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA...	R\$ 8.761.314,42	9.54%	D+360	7, I "b"	R\$ 902.201,35	11,17%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS...	R\$ 4.551.096,57	4.96%	0	7, I "b"	R\$ 267.509,07	3,17%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI...	R\$ 4.125.925,94	4.49%	D+0	7, I "b"	R\$ 243.514,25	6,20%
BB FLUXO FIC RF PREVID	R\$ 2.746.456,39	2.99%	D+0	7, III "a"	R\$ 520.093,29	6,97%
CAIXA BRASIL FI RF REF DI...	R\$ 10.768.058,66	11.73%	D+0	7, III "a"	R\$ 1.265.687,85	13,32%
MONGERAL AEGON FI RF	R\$ 2.132.545,32	2.32%	D+0	7, III "a"	R\$ 132.545,32	6,63%
INTER CORPORATE FI RF CRÉDITO PRIVADO	R\$ 1.544.879,90	1.68%	D+0	7, V "b"	R\$ 44.879,90	2,99%
CAIXA BRASIL AÇÕES...	R\$ 4.531.603,25	4.94%	D+15	8, I	R\$ 602.020,69	19,31%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	R\$ 2.358.277,41	2.57%	D+3	8, I	R\$ 358.277,41	17,91%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR...	R\$ 3.840.805,17	4.18%	D+3	9, III	R\$ 426.083,18	21,07%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES...	R\$ 1.389.792,05	1.51%	D+2	10, I	R\$ 281.999,96	25,46%
CAIXA JUROS E...	R\$ 2.895.210,43	3.15%	D+0	10, I	R\$ 312.479,05	12,33%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO...	R\$ 2.338.903,57	2.55%	D+3	10, I	R\$ 280.812,89	13,64%
TÍTULOS PRIVADOS	R\$ 4.420.647,47	4,82%	-	7, IV	R\$ 398.867,65	0,79%
Total investimentos	R\$ 91.809.675,54	100.00%			R\$ 9.734.237,72	13,13%
Disponibilidade	R\$ 3.641.535,14	-			-	-
<b>Total patrimônio</b>	<b>R\$ 95.451.210,68</b>	<b>100.00%</b>			<b>-</b>	<b>-</b>

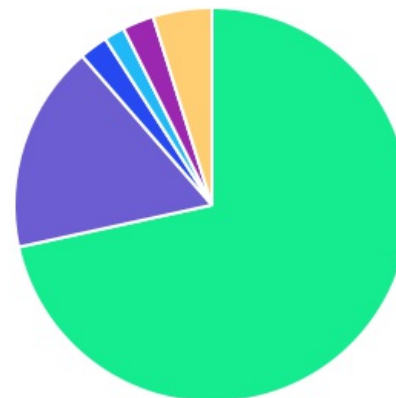
CLASSE	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Renda Fixa	81,10%	R\$ 74.455.083,66	
Renda Variável	7,50%	R\$ 6.889.880,66	
Estruturados	7,21%	R\$ 6.623.906,05	
Exterior	4,18%	R\$ 3.840.805,17	
<b>Total</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 91.809.675,54</b>	








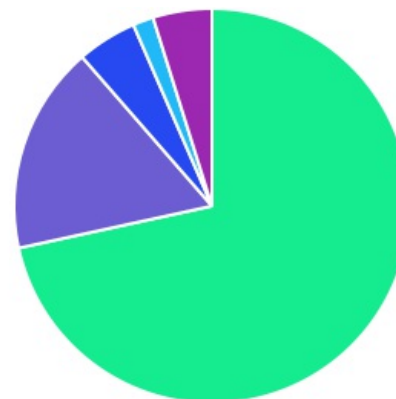
ENQUADRAMENTO	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	57,56%	R\$ 52.842.495,92	
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	17,04%	R\$ 15.647.060,37	
Artigo 8º, Inciso I	7,50%	R\$ 6.889.880,66	
Artigo 10º, Inciso I	7,21%	R\$ 6.623.906,05	
Artigo 7º, Inciso IV	4,82%	R\$ 4.420.647,47	
Artigo 9º, Inciso III	4,18%	R\$ 3.840.805,17	
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " b "	1,68%	R\$ 1.544.879,90	
<b>Total</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 91.809.675,54</b>	













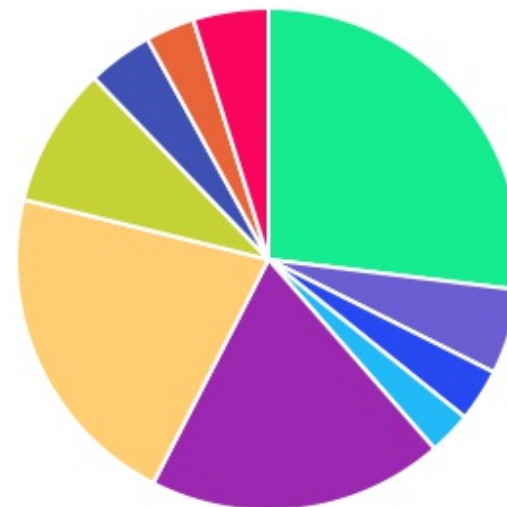
GESTOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
CAIXA DISTRIBUIDORA	71,58%	R\$ 65.719.628,69	
BB GESTAO	17,03%	R\$ 15.633.696,75	
TÍTULOS	4,82%	R\$ 4.420.647,47	
FINACAP INVESTIMENTOS	2,57%	R\$ 2.358.277,41	
MONGERAL AEGON	2,32%	R\$ 2.132.545,32	
INTER ASSET	1,68%	R\$ 1.544.879,90	
<b>Total</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 91.809.675,54</b>	






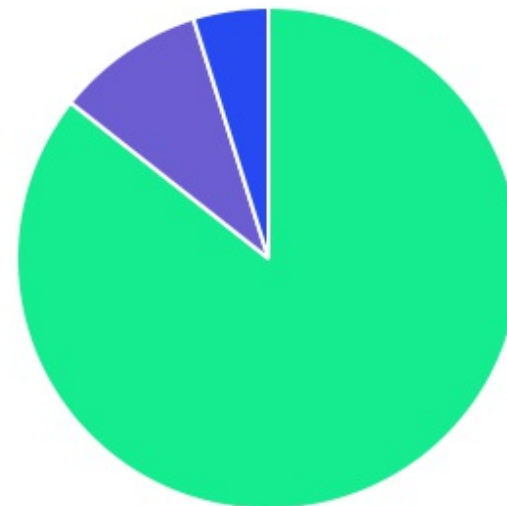
ADMINISTRADOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
CAIXA ECONOMICA	71,58%	R\$ 65.719.628,69	
BB GESTAO	17,03%	R\$ 15.633.696,75	
BEM - DISTRIBUIDORA	4,89%	R\$ 4.490.822,73	
TÍTULOS	4,82%	R\$ 4.420.647,47	
INTER DISTRIBUIDORA	1,68%	R\$ 1.544.879,90	
<b>Total</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 91.809.675,54</b>	



BENCHMARK	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
IRF-M 1	26,93%	R\$ 24.727.413,27	
CDI	21,27%	R\$ 19.530.843,84	
IPCA	18,99%	R\$ 17.438.336,93	
IBOVESPA	9,02%	R\$ 8.279.672,71	
IRF-M	5,48%	R\$ 5.027.124,07	
TÍTULOS	4,82%	R\$ 4.420.647,47	
GLOBAL BDRX	4,18%	R\$ 3.840.805,17	
IMA Geral ex-C	3,38%	R\$ 3.107.013,37	
125% do CDI	3,15%	R\$ 2.895.210,43	
IMA-B 5	2,77%	R\$ 2.542.608,28	
<b>Total</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 91.809.675,54</b>	



LIQUIDEZ	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
0 a 30 dias	85,64%	R\$ 78.627.713,65	
181 a 365 dias	9,54%	R\$ 8.761.314,42	
Acima 2 anos	4,82%	R\$ 4.420.647,47	
<b>Total</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 91.809.675,54</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\$ 52.842.495,92	57.56%	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\$ 15.647.060,37	17.04%	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\$ 4.420.647,47	4.82%	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\$ 1.544.879,90	1.68%	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\$ 74.455.083,66</b>	<b>81,10%</b>			
RENDA VARIÁVEL	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Ações - 8, I	30%	R\$ 6.889.880,66	7.50%	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\$ 6.889.880,66</b>	<b>7,50%</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\$ 3.840.805,17	4.18%	0,00%	8,00%	10,00%
<b>Total Investimentos no Exterior</b>		<b>R\$ 3.840.805,17</b>	<b>4,18%</b>			





FUNDOS ESTRUTURADOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Multimercado - aberto - 10, I	10%	R\$ 6.623.906,05	7.21%	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\$ 6.623.906,05</b>	<b>7,21%</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\$ 91.809.675,54</b>	<b>100,00%</b>			

PERÍODO	SALDO ANTERIOR	SALDO FINAL	META	RENT.(R\$)	RENT.(%)	GAP
2023			IPCA + 4.61% a.a.			
Janeiro	R\$ 59.205.692,45	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%
Mai	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%
Outubro	R\$ 90.897.914,29	R\$ 91.854.101,01	0,62%	R\$ 191.372,64	0,22%	-0,40%
Novembro	R\$ 91.854.101,01	R\$ 94.452.482,36	0,66%	R\$ 1.522.968,49	1,83%	1,17%
Dezembro	R\$ 94.452.482,36	R\$ 95.451.210,68	0,94%	R\$ 1.357.403,61	1,47%	0,54%
Total	R\$ 94.452.482,36	R\$ 95.451.210,68	9,44%	R\$ 9.734.237,72	13,13%	3,69%

ATIVO	CNPJ	RENTABILIDADE		
		1º Semestre	2º Semestre	Ano
BB FLUXO FIC RF PREVID	13.077.415/0001-05	4,40%	1,60%	6,97%
CAIXA BRASIL FI RF REF DI...	03.737.206/0001-97	6,42%	3,44%	13,32%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RF PREVID	25.078.994/0001-90	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RF	23.215.097/0001-55	8,26%	1,94%	13,59%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI...	10.740.670/0001-06	6,16%	3,12%	12,41%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP FI...	11.060.913/0001-10	7,00%	1,67%	11,96%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP...	14.386.926/0001-71	-	-	-
CAIXA BRASIL 2024 I TP FI...	18.598.288/0001-03	2,50%	0,46%	5,19%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR...	17.502.937/0001-68	14,53%	1,32%	21,07%
BB IRF-M TP FI RF PREVID	07.111.384/0001-69	-	0,57%	0,92%
CAIXA FIC FI NOVO BRASIL RF...	10.646.895/0001-90	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF...	14.508.605/0001-00	-	0,62%	3,61%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP FI...	10.577.503/0001-88	-	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVID	10.418.335/0001-88	6,51%	-1,05%	1,59%
BB TP IPCA FI RF PREVID	15.486.093/0001-83	5,87%	-	5,87%
BB TP XI FI RF PREVID	24.117.278/0001-01	-	-	-
CAIXA JUROS E...	14.120.520/0001-42	6,40%	2,78%	12,33%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	05.900.798/0001-41	-0,08%	-	-0,08%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO...	08.070.841/0001-87	6,66%	1,59%	13,64%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC...	35.292.588/0001-89	1,28%	3,60%	4,93%
BB FATORIAL FIC AÇÕES	07.882.792/0001-14	5,17%	-0,70%	1,40%

FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	05.964.067/0001-60	5,00%	12,30%	17,91%
BB AÇÕES GLOBAIS...	21.470.644/0001-13	7,68%	1,64%	7,72%
CAIXA BRASIL AÇÕES...	30.068.169/0001-44	13,72%	-1,69%	19,31%
BB AÇÕES ENERGIA FI AÇÕES	02.020.528/0001-58	12,62%	-6,38%	-0,70%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA...	44.345.590/0001-60	5,56%	3,09%	11,17%
MONGERAL AEGON FI RF	11.435.287/0001-07	0,23%	6,38%	6,63%
ICATU VANGUARDA RF FI PLUS LP	05.755.769/0001-33	5,12%	1,19%	6,37%
ICATU VANGUARDA FI RF INFLAÇÃO CP...	19.719.727/0001-51	4,12%	1,25%	5,43%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES...	45.443.651/0001-94	11,01%	2,70%	25,46%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI...	49.964.484/0001-88	0,78%	5,37%	6,20%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS...	50.635.944/0001-03	0,76%	2,40%	3,17%
INTER CORPORATE FI RF CRÉDITO PRIVADO	36.443.522/0001-05	-	2,99%	2,99%

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	552.580,93	CURVA 6,40%	R\$ 4.021.779,82	R\$ 4.420.647,47	R\$ 35.019,40 ( 0,80% )
							R\$ 4.021.779,82	R\$ 4.420.647,47	R\$ 35.019,40 ( 0,80% )