



MACAIBAPREV

 Novembre/2023

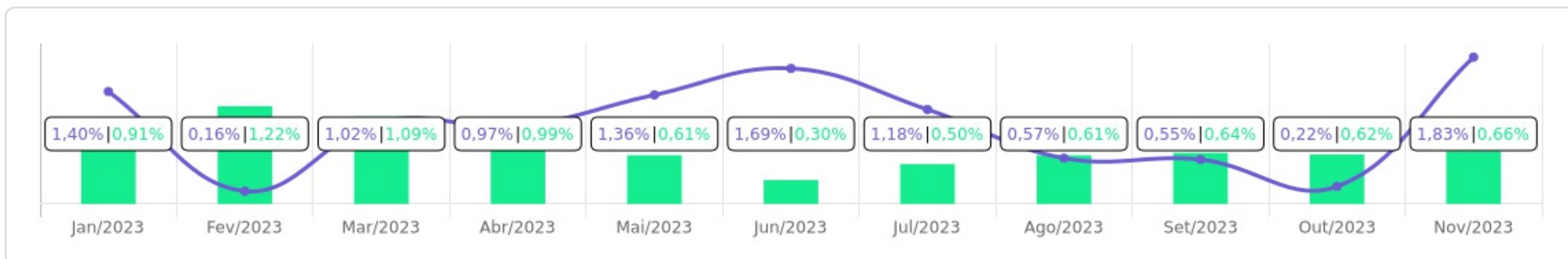


<p>Patrimônio</p> <p>R\$ 94.452.482,36</p>	<p>Rentabilidade</p> <p>Mês Acum.</p> <p>1,83% 11,49%</p>	<p>Meta</p> <p>Mês Acum.</p> <p>0,66% 8,43%</p>	<p>Gap</p> <p>Mês Acum.</p> <p>1,17% 3,06%</p>	<p>VaR</p> <p>0,23%</p>
---	---	---	--	-------------------------





Evolução do Patrimônio

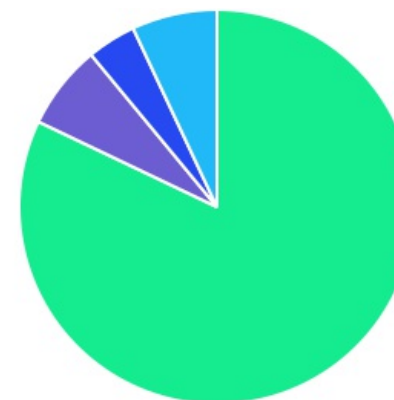









Comparativo (Rentabilidades | Metas)

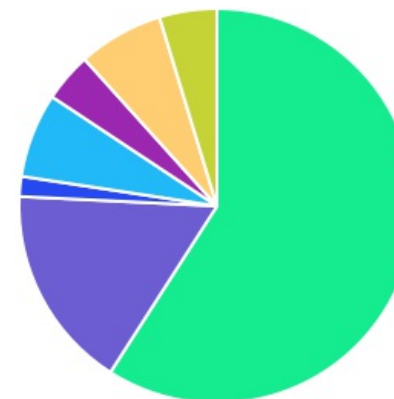








ATIVO	SALDO	CARTEIRA(%)	RESG.	4.963	RETORNO (R\$)	(%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI...	R\$ 27.362.051,75	29.29%	D+0	7, I "b"	R\$ 225.696,89	0,83%
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RF...	R\$ 4.954.754,93	5.30%	D+0	7, I "b"	R\$ 77.497,94	1,14%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RF	R\$ 3.069.946,38	3.29%	D+0	7, I "b"	R\$ 43.426,15	1,43%
CAIXA BRASIL 2024 I TP FI...	R\$ 830.941,88	0.89%	0	7, I "b"	R\$ 6.477,39	0,79%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP FI...	R\$ 1.679.839,89	1.80%	D+0	7, I "b"	R\$ 29.494,21	1,79%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA...	R\$ 8.681.173,53	9.29%	D+360	7, I "b"	R\$ 67.748,15	0,79%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS...	R\$ 4.509.127,78	4.83%	0	7, I "b"	R\$ 35.536,36	0,79%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI...	R\$ 4.087.856,90	4.38%	D+0	7, I "b"	R\$ 32.220,31	0,79%
BB FLUXO FIC RF PREVID	R\$ 2.832.065,80	3.03%	D+0	7, III "a"	R\$ 27.840,24	0,18%
CAIXA BRASIL FI RF REF DI...	R\$ 10.669.440,60	11.42%	D+0	7, III "a"	R\$ 102.154,36	0,97%
MONGERAL AEGON FI RF	R\$ 2.112.499,63	2.26%	D+0	7, III "a"	R\$ 20.263,43	0,97%
INTER CORPORATE FI RF CRÉDITO PRIVADO	R\$ 1.530.717,39	1.64%	D+0	7, V "b"	R\$ 14.345,79	0,95%
CAIXA BRASIL AÇÕES...	R\$ 4.248.788,51	4.55%	D+15	8, I	R\$ 246.011,42	6,15%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	R\$ 2.215.508,01	2.37%	D+3	8, I	R\$ 240.393,87	12,17%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR...	R\$ 3.743.895,21	4.01%	D+3	9, III	R\$ 114.020,03	3,14%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES...	R\$ 1.345.865,12	1.44%	D+2	10, I	R\$ 104.655,77	8,43%
CAIXA JUROS E...	R\$ 2.869.338,58	3.07%	D+0	10, I	R\$ 27.061,26	0,95%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO...	R\$ 2.297.149,18	2.46%	D+3	10, I	R\$ 76.138,72	3,43%
TÍTULOS PRIVADOS	R\$ 4.385.628,07	4,69%	-	7, IV	R\$ 31.986,20	0,73%
Total investimentos	R\$ 93.426.589,14	100.00%			R\$ 1.522.968,49	1,83%
Disponibilidade	R\$ 1.025.893,22	-			-	-
Total patrimônio	R\$ 94.452.482,36	100.00%			-	-

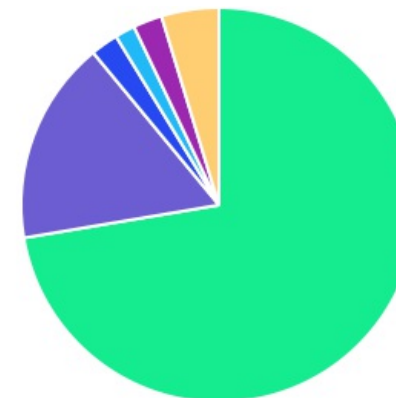
CLASSE	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Renda Fixa	82,10%	R\$ 76.706.044,53	
Estruturados	6,97%	R\$ 6.512.352,88	
Renda Variável	6,92%	R\$ 6.464.296,52	
Exterior	4,01%	R\$ 3.743.895,21	
Total	100,00%	R\$ 93.426.589,14	








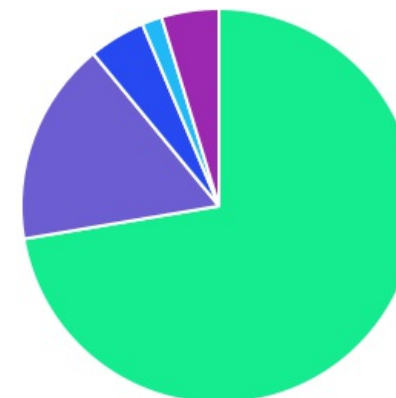
ENQUADRAMENTO	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	59,06%	R\$ 55.175.693,04	
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	16,71%	R\$ 15.614.006,03	
Artigo 10º, Inciso I	6,97%	R\$ 6.512.352,88	
Artigo 8º, Inciso I	6,92%	R\$ 6.464.296,52	
Artigo 7º, Inciso IV	4,69%	R\$ 4.385.628,07	
Artigo 9º, Inciso III	4,01%	R\$ 3.743.895,21	
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " b "	1,64%	R\$ 1.530.717,39	
Total	100,00%	R\$ 93.426.589,14	












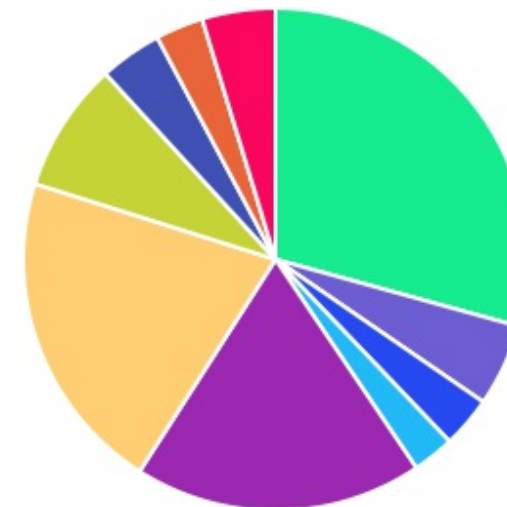
GESTOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
CAIXA DISTRIBUIDORA	72,34%	R\$ 67.581.139,81	
BB GESTAO	16,70%	R\$ 15.601.096,23	
TÍTULOS	4,69%	R\$ 4.385.628,07	
FINACAP INVESTIMENTOS	2,37%	R\$ 2.215.508,01	
MONGERAL AEGON	2,26%	R\$ 2.112.499,63	
INTER ASSET	1,64%	R\$ 1.530.717,39	
Total	100,00%	R\$ 93.426.589,14	






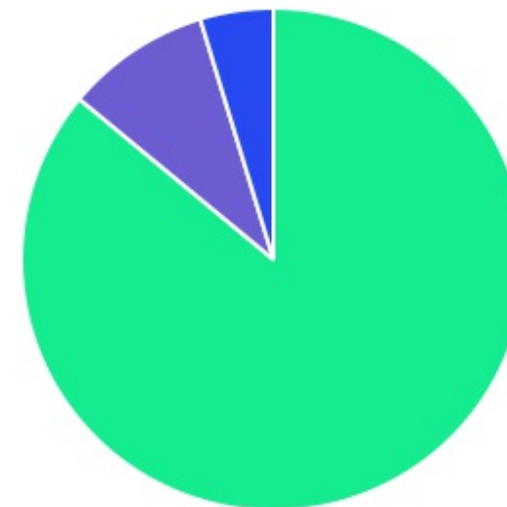
ADMINISTRADOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
CAIXA ECONOMICA	72,34%	R\$ 67.581.139,81	
BB GESTAO	16,70%	R\$ 15.601.096,23	
TÍTULOS	4,69%	R\$ 4.385.628,07	
BEM - DISTRIBUIDORA	4,63%	R\$ 4.328.007,64	
INTER DISTRIBUIDORA	1,64%	R\$ 1.530.717,39	
Total	100,00%	R\$ 93.426.589,14	



BENCHMARK	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
IRF-M 1	29,29%	R\$ 27.362.051,75	
CDI	20,81%	R\$ 19.441.872,60	
IPCA	18,49%	R\$ 17.278.158,21	
IBOVESPA	8,36%	R\$ 7.810.161,64	
IRF-M	5,30%	R\$ 4.954.754,93	
TÍTULOS	4,69%	R\$ 4.385.628,07	
GLOBAL BDRX	4,01%	R\$ 3.743.895,21	
IMA Geral ex-C	3,29%	R\$ 3.069.946,38	
125% do CDI	3,07%	R\$ 2.869.338,58	
IMA-B 5	2,69%	R\$ 2.510.781,77	
Total	100,00%	R\$ 93.426.589,14	



LIQUIDEZ	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
0 a 30 dias	86,01%	R\$ 80.359.787,54	
181 a 365 dias	9,29%	R\$ 8.681.173,53	
Acima 2 anos	4,69%	R\$ 4.385.628,07	
Total	100,00%	R\$ 93.426.589,14	



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\$ 55.175.693,04	59.06%	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\$ 15.614.006,03	16.71%	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\$ 4.385.628,07	4.69%	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\$ 1.530.717,39	1.64%	0,00%	3,00%	5,00%
FI Debêntures - 7, V "c"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa		R\$ 76.706.044,53	82,10%			

RENDA VARIÁVEL	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Ações - 8, I	30%	R\$ 6.464.296,52	6.92%	0,00%	10,00%	20,00%
FI de Índices Ações - 8, II	30%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Variável		R\$ 6.464.296,52	6,92%			

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\$ 3.743.895,21	4.01%	0,00%	8,00%	10,00%
Total Investimentos no Exterior		R\$ 3.743.895,21	4,01%			

FUNDOS ESTRUTURADOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Multimercado - aberto - 10, I	10%	R\$ 6.512.352,88	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%
Total Fundos Estruturados		R\$ 6.512.352,88	6,97%			
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%
Total Fundos Imobiliários		R\$ 0,00	0,00%			
EMPRÉSTIMOS CONSIGNADOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
Empréstimos Consignados - 12	5%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Total Empréstimos Consignados		R\$ 0,00	0,00%			
Total Global		R\$ 93.426.589,14	100,00%			

PERÍODO	SALDO ANTERIOR	SALDO FINAL	META	RENT.(R\$)	RENT.(%)	GAP
			2023			
			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%
Maió	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%
Total	R\$ 91.854.101,01	R\$ 94.452.482,36	8,43%	R\$ 8.376.834,11	11,49%	3,06%
			2022			
			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%
Maió	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%
Total	R\$ 58.986.279,55	R\$ 62.824.965,61	10,85%	R\$ 3.582.223,98	6,47%	-4,38%

2021	IPCA + 4.98% a.a.					
-------------	--------------------------	--	--	--	--	--

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%
Mai	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%
Total	R\$ 51.765.191,94	R\$ 54.434.965,50	15,54%	R\$ 1.010.094,72	1,98%	-13,56%

ATIVO	CNPJ	RENTABILIDADE				
		Mês (%)	Ano (%)	12 meses (%)	24 meses (%)	Início (%)
BB FLUXO FIC RF PREVID	13.077.415/0001-05	0,18%	6,53%	6,77%	-	11,15%
CAIXA BRASIL FI RF REF DI...	03.737.206/0001-97	0,97%	12,28%	13,57%	-	25,41%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RF PREVID	25.078.994/0001-90	-	-	-	-	6,65%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RF	23.215.097/0001-55	1,43%	12,23%	13,51%	-	23,42%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI...	10.740.670/0001-06	0,83%	11,42%	11,98%	-	22,95%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP FI...	11.060.913/0001-10	1,79%	10,38%	11,39%	-	14,48%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP...	14.386.926/0001-71	-	-	-	-	8,96%
CAIXA BRASIL 2024 I TP FI...	18.598.288/0001-03	0,79%	4,23%	5,61%	-	7,50%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR...	17.502.937/0001-68	3,14%	18,02%	12,36%	-	-6,56%
BB IRF-M TP FI RF PREVID	07.111.384/0001-69	-	0,92%	-	-	0,92%
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	1,14%	2,12%	-	-	2,12%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP FI...	10.577.503/0001-88	-	-	-	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVID	10.418.335/0001-88	-	1,59%	-4,91%	-	-2,48%
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	0,95%	11,33%	12,63%	-	15,94%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	05.900.798/0001-41	-	-0,08%	-1,88%	-	3,83%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO...	08.070.841/0001-87	3,43%	11,62%	12,84%	-	14,86%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC...	35.292.588/0001-89	-	4,93%	-	-	4,93%
BB FATORIAL FIC AÇÕES	07.882.792/0001-14	-	1,40%	-5,16%	-	-3,29%

FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	05.964.067/0001-60	12,17%	10,78%	-	-	10,78%
BB AÇÕES GLOBAIS...	21.470.644/0001-13	-	7,72%	9,14%	-	-10,23%
CAIXA BRASIL AÇÕES...	30.068.169/0001-44	6,15%	11,86%	9,09%	-	11,94%
BB AÇÕES ENERGIA FI AÇÕES	02.020.528/0001-58	-	-0,70%	-7,29%	-	-6,77%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA...	44.345.590/0001-60	0,79%	10,15%	11,61%	-	14,39%
MONGERAL AEGON FI RF	11.435.287/0001-07	0,97%	5,62%	-	-	5,62%
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	8,43%	21,49%	24,65%	-	22,35%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2024 FI...	49.964.484/0001-88	0,79%	5,22%	-	-	5,22%
CAIXA BRASIL 2024 X TÍTULOS PÚBLICOS...	50.635.944/0001-03	0,79%	2,22%	-	-	2,22%
INTER CORPORATE FI RF CRÉDITO PRIVADO	36.443.522/0001-05	0,95%	2,05%	-	-	2,05%

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	548.203,51	CURVA 6,40%	R\$ 4.021.779,82	R\$ 4.385.628,07	R\$ 31.986,20 (0,73%)
							R\$ 4.021.779,82	R\$ 4.385.628,07	R\$ 31.986,20 (0,73%)