

Relatório de Acompanhamento da Gestão Financeira 1º SEMESTRE DE 2021



Elaborado e apresentado pela PPS

- Auxiliar o Conselho Fiscal em sua manifestação quanto a:
 - Aderência da gestão dos recursos
 - ◆ Enquadramento das aplicações
 - ◆ Controle de risco
 - ◆ Rentabilidades
 - ◆ Custos

Alocação dos Recursos da Entidade EFPC (em R\$)

Segmentos	1º Semestre/2021		2º Semestre/2020		Limite 4.661	Política de Investimentos	
	R\$	%	R\$	%		Mínimo	Máximo
Renda Fixa	920.741.489	87,6%	906.519.058	87,7%	100,0%	54%	100%
Renda Variável	130.689.437	12,4%	127.050.550	12,3%	70,0%	0%	25%
Investimentos Estruturados	0	0,0%	0	0,0%	20%	0%	13%
Investimento no Exterior	0	0,0%	0	0,0%	10%	0%	8%
Total	1.051.430.926	100%	1.033.569.607	100%			

Alocação dos Recursos – Plano de Aposentadoria – Consolidado (em R\$)

Segmentos	1º Semestre/2021		2º Semestre/2020		Limite 4.661	Política de Investimentos	
	R\$	%	R\$	%		Mínimo	Máximo
Renda Fixa	915.352.939	87,5%	901.705.111	87,7%	100,0%	54%	100%
Renda Variável	130.689.437	12,5%	127.050.550	12,3%	70,0%	0%	25%
Investimentos Estruturados	0	0,0%	0	0,0%	20%	0%	13%
Investimento no Exterior	0	0,0%	0	0,0%	10%	0%	8%
Total	1.046.042.375	100%	1.028.755.661	100%			

Alocação dos Recursos de Gestão Administrativa da Entidade – PGA (em R\$)

Segmentos	1º Semestre/2021		2º Semestre/2020		Limite 4.661	Política de Investimentos	
	R\$	%	R\$	%		Mínimo	Máximo
Renda Fixa	5.388.551	100,0%	4.813.947	100,0%	100,0%	100%	100%
Renda Variável	0	0,0%	0	0,0%	70,0%	0%	0%
Investimentos Estruturados	0	0,0%	0	0,0%	20%	0%	0%
Investimento no Exterior	0	0,0%	0	0,0%	10%	0%	0%
Total	5.388.551	100%	4.813.947	100%			

Fontes: MB Prev e Intrag

Total dos Recursos da Entidade EFPC (em R\$)

Renda Fixa	Entidade	Plano de Aposentadoria	PGA
Fundos de Investimentos	920.674.452	915.286.303	5.388.149
Caixa (Administrado + Própria)	52.478	52.478	0
Outros Realizáveis	0	0	0
Total RF	920.726.929	915.338.781	5.388.149
Renda Variável	Entidade	Plano de Aposentadoria	PGA
Fundos de Investimentos	130.689.437	130.689.437	0
Total RV	130.689.437	130.689.437	0
Total do DI	1.051.416.366	1.046.028.217	5.388.149

Fontes: MB Prev e Intrag

Alocação dos Recursos do Perfil Agressivo – Plano de Aposentadoria (em R\$)

Segmentos	1º Semestre/2021	%	2º Semestre/2020	%
Renda Fixa	101.827.495	76,4%	96.149.866	76,7%
Renda Variável	31.379.703	23,6%	29.245.110	23,3%
Total	133.207.198	100%	125.394.976	100%

Alocação dos Recursos do Perfil Moderado – Plano de Aposentadoria (em R\$)

Segmentos	1º Semestre/2021	%	2º Semestre/2020	%
Renda Fixa	623.801.908	86,3%	613.212.719	86,2%
Renda Variável	99.309.734	13,7%	97.805.440	13,8%
Total	723.111.642	100%	711.018.159	100%

Alocação dos Recursos do Perfil Conservador – Plano de Aposentadoria (em R\$)

Segmentos	1º Semestre/2021	%	2º Semestre/2020	%
Renda Fixa	195.049.894	100,0%	197.156.473	100,0%
Renda Variável	0	0,0%	-	0,0%
Total	195.049.894	100%	197.156.473	100%

Tabela Comparativa dos Limites de Alocação vs Política de Investimento e Legislação Vigente

Segmentos	Alocação Atual	Política de Investimentos ¹		Resolução 4.661
		Mínimo	Máximo	
Renda Fixa	87,6%	54%	100%	100%
Renda Variável	12,4%	0%	25%	70%

1. Limites definidos para a Estratégia II - já para a Estratégia I a Política de Investimentos determina a alocação de 100% no segmento de Renda Fixa.

Recursos com gestão terceirizada (em R\$)

Gestor de Recursos	Valores em R\$	% Gestores	% Recursos Garantidores
Bradesco (MB I)	137.126.852	13,0%	13,0%
Bradesco (MB II)	441.544.976	42,0%	42,0%
Western (MB III)	284.081.061	27,0%	27,0%
Santander (MB IV)	57.536.474	5,5%	5,5%
BNP (MB V)	61.162.144	5,8%	5,8%
Bahia AM (Bahia AM Valuation FIC FI)	19.143.937	1,8%	1,8%
Bradesco (Bradesco Dividendos FIA)	5.669.052	0,5%	0,5%
Arx Investimento (Arx Income FIA)	26.033.640	2,5%	2,5%
Moat Capital (Moat Capital FIC FIA)	18.680.664	1,8%	1,8%
Intrag	4.494	0,1%	0,1%
Total	1.050.983.294	100,00%	100,00%

Fontes: MB Prev e Intrag

Enquadramento em Renda Fixa

Fontes: MB Prev, DI, Balancete e Intrag

Valores a Receber/Pagar	Total (R\$)	Carteira	Fundos	Entidade	Limite Res. 4.661	Política de Investimentos ¹		
						Min.	Máx.	Target
Total dos recursos garantidores	1.155.083.092	52.936	1.155.030.156	100,0%	-	-	-	-
Renda Fixa	924.638.772	52.936	924.585.836	80,0%	100%	85%	100%	-
Títulos Públicos	810.221.827	0	810.221.827	70,1%	100%	70%	100%	-
Títulos Privados	114.481.323	0	114.481.323	9,9%	80%	0%	30%	-
	CCB, CCCB e NP	0	0	0,0%	20%	-	-	-
	NCE e CCE	0	0	0,0%	20%	-	-	-
	FIDC e FICFIDC	0	0	0,0%	20%	-	-	-
	CPR, CDCA, CRA, WA	0	0	0,0%	20%	-	-	-
	Tit. De Cias Abertas (exceto debênture)	0	0	0,0%	20%	-	-	-
	Títulos de Cias Securitizadoras	0	0	0,0%	20%	-	-	-
	CDB, DEB, NC, DPGE, LF	114.481.323	0	114.481.323	9,9%	80%	30%	-
Termo de Renda Fixa	0	0	0	0,0%	-	-	-	-
Derivativos	0	0	0	0,0%	15%	0%	15%	-
Valores a Receber/Pagar	-139.665	0	-139.665	0,0%	-	-	-	-
Caixa	75.287	52.936	22.351	0,0%	-	-	-	-

Enquadramento em Renda Variável

Valores a Receber/Pagar	Total (R\$)	Carteira	Fundos	Entidade	Limite Res. 4.661	Política de Investimentos ¹		
						Min.	Máx.	Target
Renda Variável	230.444.320	0	230.444.320	20,0%	70%	0%	15%	-
Ações	102.077.412	0	102.077.412	8,8%	70%	0%	15%	-
	Novo Mercado	61.825.914	0	61.825.914	5,4%	70%	-	-
	Nível 2	17.321.757	0	17.321.757	1,5%		-	-
	Nível 1	19.114.508	0	19.114.508	1,7%	50%	-	-
	Bovespa Mais	3.815.234	0	3.815.234	0,3%		-	-
	Sem Selo de Governança	0	0	0	0,0%		-	-
Fundos de Índice	0	0	0	0,0%	-	-	-	-
Outros Ativos	130.807.770	0	130.807.770	11,3%	3%	-	-	-
Valores a Receber/Pagar	-2.440.862	0	-2.440.862	-0,2%	-	-	-	-

Observação: O valor atribuído à renda variável no slide anterior considera a posição em fundos de renda variável, conforme apresentado no balancete. Neste slide, utilizado para fins de enquadramento, a posição em renda variável considera somente as posições em ações e contas a pagar e a receber dos fundos de renda variável, mas não considera a posição em caixa de tais fundos, que é considerado renda fixa após a “explosão” dos fundos. As posições em renda fixa e renda variável deste slide serão consideradas nos próximos que consolidam posições por tipo de ativo e emissores.

Prazo de Vencimento dos Títulos de Renda Fixa

Dias Úteis	Privados	%	Públicos	%	Total	%
Até 21	-	0,0%	-	0,0%	-	0,0%
Até 42	2.808.700	2,5%	-	0,0%	2.808.700	0,3%
Até 63	-	0,0%	-	0,0%	-	0,0%
Até 84	-	0,0%	103.940.311	12,8%	103.940.311	11,2%
Até 105	2.104.001	1,8%	603.679	0,1%	2.707.680	0,3%
Até 126	17.153.547	15,0%	-	0,0%	17.153.547	1,9%
Até 252	14.734.593	12,9%	16.540.155	2,0%	31.274.748	3,4%
Até 504	59.545.272	52,0%	507.075.261	62,6%	566.620.533	61,3%
Até 756	6.949.816	6,1%	12.798.364	1,6%	19.748.180	2,1%
Até 1008	2.330.651	2,0%	96.732.092	11,9%	99.062.743	10,7%
Acima de 1008	8.854.744	7,7%	72.531.964	9,0%	81.386.708	8,8%
Total	114.481.323	100,0%	810.221.827	100,0%	924.703.150	100,0%

Fonte: Intrag

Risco de crédito

Notas Comerciais

CARACTERÍSTICAS DA EMISSÃO

Título	Carteira	Emitente	Valor	Rating	Agência	Vecto	Aquisição
NC	MB PREV III	LOCALIZA	1.014.347,52	AAA (bra)	Fitch	24/09/21	24/09/19

RATING ATUAL: Junho.2021

FITCH			MOODY'S			S&P		
Data	Rating	Class	Data	Rating	Class	Data	Rating	Class
01/01/20	AAA (bra)		-	-	-	-	-	-

LEGENDA I

	GRAU DE INVESTIMENTO
	GRAU ESPECULATIVO

LEGENDA II **

Estável	
Upgrade	
Downgrade	

Risco de crédito

Debêntures																
CARACTERÍSTICAS DA EMISSÃO							RATING ATUAL: Junho.2021									
Título	Carteira	Emitente	Valor	Rating	Agência	Vecto	Aquisição	FITCH			MOODY'S			S&P		
								Data	Rating	Class	Data	Rating	Class	Data	Rating	Class
DEB	MBPREV I	CELEO	160.461,96	brAAA	S&P	15/11/23	21/12/18	-	-	-	-	-	-	01/01/20	brAAA	↔
DEB	MBPREV II	CELEO	584.794,71	brAAA	S&P	15/11/23	21/12/18	-	-	-	-	-	-	01/01/20	brAAA	↔
DEB	MB PREV III	AMPLA	721.077,13	AAA (bra)	Fitch	15/12/20	21/12/17	01/01/20	AAA (bra)	↔	-	-	-	-	-	-
DEB	MB PREV III	NFC PARTICIPAÇÕES	7.485.363,80	AA+ (bra)	Fitch	23/12/20	31/10/19	01/01/20	AA+ (bra)	↔	-	-	-	-	-	-
DEB	MB PREV III	GUARARAPES	868.249,56	AA- (bra)	Fitch	25/04/21	14/05/18	01/01/20	AA- (bra)	↔	-	-	-	-	-	-
DEB	MB PREV III	NATURA	1.063.450,47	brAA-	S&P	25/09/21	28/09/17	-	-	-	-	-	-	01/01/20	brAAA	↔
DEB	MB PREV III	TELEFONICA BRASIL	1.225.881,74	Aaa.br	Moody's	08/02/22	08/02/17	-	-	-	-	-	-	01/01/20	brAAA	↔
DEB	MB PREV III	PETROBRAS	2.460.883,01	AA (bra)	Fitch	15/08/22	18/09/19	01/01/20	AA (bra)	↔	-	-	-	-	-	-
DEB	MB PREV III	PETROBRAS	1.553.603,08	AA (bra)	Fitch	15/08/22	02/10/19	01/01/20	AA (bra)	↔	-	-	-	-	-	-
DEB	MB PREV III	PETROBRAS	701.953,48	AA (bra)	Fitch	15/08/22	25/10/19	01/01/20	AA (bra)	↔	-	-	-	-	-	-
DEB	MB PREV III	PETROBRAS	242.750,48	AA (bra)	Fitch	15/08/22	29/10/19	01/01/20	AA (bra)	↔	-	-	-	-	-	-
DEB	MB PREV III	PETROBRAS	135.535,09	AA (bra)	Fitch	15/08/22	29/10/19	01/01/20	AA (bra)	↔	-	-	-	-	-	-
DEB	MB PREV III	PETROBRAS	531.016,68	AA (bra)	Fitch	15/08/22	29/10/19	01/01/20	AA (bra)	↔	-	-	-	-	-	-
DEB	MB PREV III	GERDAU	1.351.971,14	brAAA	S&P	21/11/22	19/12/18	-	-	-	-	-	-	01/01/20	brAAA	↔
DEB	MB PREV III	ELETOBRAS	1.317.280,68	brAAA	S&P	25/04/26	17/05/19	-	-	-	-	-	-	01/01/20	brAAA	↔

Fontes: Intrag e Agências de Rating

LEGENDA I

	GRAU DE INVESTIMENTO
	GRAU ESPECULATIVO

LEGENDA II **

Estável	↔
Upgrade	↑
Downgrade	↓

Risco de crédito

Letras Financeiras

CARACTERÍSTICAS DA EMISSÃO

Título	Carteira	Emitente	Valor	Rating	Agência	Vecto	Aquisição
LF	MBPREV I	BANCO ALFA	522.621,65	AA (bra)	Fitch	04/03/20	08/09/17
LF	MBPREV I	ITAU UNIBANCO	1.008.517,91	brAA-	S&P	09/04/20	16/02/18
LF	MBPREV I	ITAU UNIBANCO	1.008.838,00	brAA-	S&P	11/05/20	15/02/18
LF	MBPREV I	ITAU UNIBANCO	1.009.435,98	brAA-	S&P	09/07/20	09/02/18
LF	MBPREV I	BNP PARIBAS	672.597,66	brAAA	S&P	10/07/20	22/11/18
LF	MBPREV I	VOTORANTIM	817.350,04	Aa3.br	Moody's	03/08/20	02/08/18
LF	MBPREV I	VOTORANTIM	322.548,96	Aa3.br	Moody's	19/10/20	18/10/18
LF	MBPREV I	VOTORANTIM	641.316,59	Aa3.br	Moody's	23/11/20	21/11/18
LF	MBPREV I	BANCO ALFA	512.617,24	AA (bra)	Fitch	04/12/20	04/12/17
LF	MBPREV I	SAFRA	849.538,88	Aa1.br	Moody's	21/12/20	21/12/17
LF	MBPREV I	SAFRA	848.771,70	Aa1.br	Moody's	22/03/21	21/12/17
LF	MBPREV I	ITAU UNIBANCO	2.157.669,90	brAAA	S&P	22/04/21	20/09/18
LF	MBPREV I	ITAU UNIBANCO	2.289.003,35	Aa1.br	Moody's	15/10/21	15/04/19
LF	MBPREV I	SAFRA	980.279,41	Aa1.br	Moody's	21/01/22	23/07/18
LF	MBPREV I	ITAU UNIBANCO	2.288.386,51	Aa1.br	Moody's	15/03/22	15/04/19
LF	MBPREV I	BANCO ALFA	1.854.196,43	AA (bra)	Fitch	27/05/22	27/05/19
LF	MBPREV I	SAFRA	632.891,54	Aa1.br	Moody's	11/07/22	11/01/19
LF	MBPREV I	SAFRA	1.412.751,60	Aa1.br	Moody's	22/08/22	21/02/19
LF	MBPREV I	SAFRA	909.439,33	Aa1.br	Moody's	19/09/22	18/09/19
LF	MBPREV I	SAFRA	1.412.760,71	Aa1.br	Moody's	21/10/22	21/02/19
LF	MBPREV II	BANCO ALFA	522.621,65	AA (bra)	Fitch	04/03/20	08/09/17
LF	MBPREV II	ITAU UNIBANCO	1.008.517,91	brAA-	S&P	09/04/20	16/02/18
LF	MBPREV II	ITAU UNIBANCO	1.008.838,00	brAA-	S&P	11/05/20	15/02/18
LF	MBPREV II	ITAU UNIBANCO	1.009.435,98	brAA-	S&P	09/07/20	09/02/18
LF	MBPREV II	BNP PARIBAS	1.717.792,99	brAAA	S&P	10/07/20	22/11/18
LF	MBPREV II	VOTORANTIM	1.961.640,08	Aa3.br	Moody's	03/08/20	02/08/18
LF	MBPREV II	VOTORANTIM	1.451.470,31	Aa3.br	Moody's	19/10/20	18/10/18
LF	MBPREV II	VOTORANTIM	2.404.937,22	Aa3.br	Moody's	23/11/20	21/11/18
LF	MBPREV II	BANCO ALFA	512.617,24	AA (bra)	Fitch	04/12/20	04/12/17
LF	MBPREV II	SAFRA	679.631,09	Aa1.br	Moody's	21/12/20	21/12/17

Fontes: Intrag e Agências de Rating

LEGENDA I	
	GRAU DE INVESTIMENTO
	GRAU ESPECULATIVO

RATING ATUAL:

Junho.2021

FITCH			MOODY'S			S&P		
Data	Rating	Class	Data	Rating	Class	Data	Rating	Class
01/01/20	AA (bra)		01/01/20	Aa1.br		-	-	-
01/01/20	AAA (bra)		01/01/20	Aa1.br		01/01/20	brAAA	
01/01/20	AAA (bra)		01/01/20	Aa1.br		01/01/20	brAAA	
01/01/20	AAA (bra)		01/01/20	Aa1.br		01/01/20	brAAA	
-	-	-	-	-	-	01/01/20	brAAA	
-	-	-	01/01/20	Aa3.br		01/01/20	brAAA	
-	-	-	01/01/20	Aa3.br		01/01/20	brAAA	
-	-	-	01/01/20	Aa3.br		01/01/20	brAAA	
01/01/20	AA (bra)		01/01/20	Aa1.br		-	-	-
-	-	-	01/01/20	Aa1.br		01/01/20	brAAA	
-	-	-	01/01/20	Aa1.br		01/01/20	brAAA	
01/01/20	AAA (bra)		01/01/20	Aa1.br		01/01/20	brAAA	
01/01/20	AAA (bra)		01/01/20	Aa1.br		01/01/20	brAAA	
-	-	-	01/01/20	Aa1.br		01/01/20	brAAA	
01/01/20	AAA (bra)		01/01/20	Aa1.br		01/01/20	brAAA	
01/01/20	AA (bra)		01/01/20	Aa1.br		-	-	-
-	-	-	01/01/20	Aa1.br		01/01/20	brAAA	
-	-	-	01/01/20	Aa1.br		01/01/20	brAAA	
-	-	-	01/01/20	Aa1.br		01/01/20	brAAA	
-	-	-	01/01/20	Aa1.br		01/01/20	brAAA	
01/01/20	AA (bra)		01/01/20	Aa1.br		-	-	-
01/01/20	AAA (bra)		01/01/20	Aa1.br		01/01/20	brAAA	
01/01/20	AAA (bra)		01/01/20	Aa1.br		01/01/20	brAAA	
01/01/20	AAA (bra)		01/01/20	Aa1.br		01/01/20	brAAA	
-	-	-	-	-	-	01/01/20	brAAA	
-	-	-	01/01/20	Aa3.br		01/01/20	brAAA	
-	-	-	01/01/20	Aa3.br		01/01/20	brAAA	
-	-	-	01/01/20	Aa3.br		01/01/20	brAAA	
01/01/20	AA (bra)		01/01/20	Aa1.br		-	-	-
-	-	-	01/01/20	Aa1.br		01/01/20	brAAA	

LEGENDA II **	
	Estável
	Upgrade
	Downgrade

Risco de crédito

Letras Financeiras

Título	Carteira	Emitente	Valor	Rating	Agência	Vecto	Aquisição
LF	MBPREV II	SAFRA	679.017,36	Aa1.br	Moody's	22/03/21	21/12/17
LF	MBPREV II	ITAU UNIBANCO	5.178.407,76	brAAA	S&P	22/04/21	20/09/18
LF	MBPREV II	ITAU UNIBANCO	5.410.371,55	Aa1.br	Moody's	15/10/21	15/04/19
LF	MBPREV II	SAFRA	2.287.318,62	Aa1.br	Moody's	21/01/22	23/07/18
LF	MBPREV II	ITAU UNIBANCO	5.200.878,44	Aa1.br	Moody's	15/03/22	15/04/19
LF	MBPREV II	BANCO ALFA	4.171.941,96	AA (bra)	Fitch	27/05/22	27/05/19
LF	MBPREV II	SAFRA	2.531.566,16	Aa1.br	Moody's	11/07/22	11/01/19
LF	MBPREV II	SAFRA	5.337.061,61	Aa1.br	Moody's	22/08/22	21/02/19
LF	MBPREV II	SAFRA	2.425.171,54	Aa1.br	Moody's	19/09/22	18/09/19
LF	MBPREV II	SAFRA	5.337.096,03	Aa1.br	Moody's	21/10/22	21/02/19
LF	MBPREV III	VOTORANTIM	2.103.472,10	Aa3.br	Moody's	18/02/21	18/02/19
LF	MBPREV III	ITAU UNIBANCO	4.162.910,76	Aa1.br	Moody's	13/10/21	12/04/19
LF	MBPREV III	BANCO ALFA	4.904.371,44	AA (bra)	Fitch	14/01/22	15/07/19
LF	MBPREV III	ITAU UNIBANCO	2.523.879,84	AAA (bra)	Fitch	23/05/22	21/10/19
LF	MBPREV III	BRDESCO	5.567.545,96	Aa1.br	Moody's	31/05/22	31/05/19

FITCH			MOODY'S			S&P		
Data	Rating	Class	Data	Rating	Class	Data	Rating	Class
-	-	-	01/01/20	Aa1.br	↔	01/01/20	brAAA	↔
01/01/20	AAA (bra)	↔	01/01/20	Aa1.br	↔	01/01/20	brAAA	↔
01/01/20	AAA (bra)	↔	01/01/20	Aa1.br	↔	01/01/20	brAAA	↔
-	-	-	01/01/20	Aa1.br	↔	01/01/20	brAAA	↔
01/01/20	AAA (bra)	↔	01/01/20	Aa1.br	↔	01/01/20	brAAA	↔
01/01/20	AA (bra)	↔	01/01/20	Aa1.br	↔	-	-	-
-	-	-	01/01/20	Aa1.br	↔	01/01/20	brAAA	↔
-	-	-	01/01/20	Aa1.br	↔	01/01/20	brAAA	↔
-	-	-	01/01/20	Aa1.br	↔	01/01/20	brAAA	↔
-	-	-	01/01/20	Aa1.br	↔	01/01/20	brAAA	↔
-	-	-	01/01/20	Aa3.br	↔	01/01/20	brAAA	↔
01/01/20	AAA (bra)	↔	01/01/20	Aa1.br	↔	01/01/20	brAAA	↔
01/01/20	AA (bra)	↔	01/01/20	Aa1.br	↔	-	-	-
01/01/20	AAA (bra)	↔	01/01/20	Aa1.br	↔	01/01/20	brAAA	↔
01/01/20	AAA (bra)	↔	01/01/20	Aa1.br	↔	01/01/20	brAAA	↔

Fontes: Intrag e Agências de Rating

LEGENDA I

	GRAU DE INVESTIMENTO
	GRAU ESPECULATIVO

LEGENDA II **

Estável	
Upgrade	
Downgrade	

Tesouro Federal

EMISSOR	VLR LÍQUIDO	% TPF	% RF	% RG
LFT	298.947.005	37,1%	32,5%	28,4%
LTN	429.451.780	53,3%	46,6%	40,8%
NTN-B	77.850.541	9,7%	8,5%	7,4%
NTN-F	11.120	0,0%	0,0%	0,0%
TOTAL	806.260.445	100,0%	87,6%	76,7%

Risco de crédito

EMISSION	Valor	% CP	%RF	%RG
DEBÊNTURE SIMPLES	24.225.028	21,2%	2,6%	2,3%
LETRA FINANCEIRA	89.198.283	77,9%	9,7%	8,5%
LETRADE COMERCIAIS	1.058.012	0,9%	0,1%	0,1%
TOTAL	114.481.323	100,0%	12,4%	10,9%

EMISSION	Valor	NÃO FINANCEIRO	% CP	%RF	%RG
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	8.136.635	32,2%	7,1%	0,9%	0,8%
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	2.735.385	10,8%	2,4%	0,3%	0,3%
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	2.583.966	10,2%	2,3%	0,3%	0,2%
GERDAU SA	1.854.927	7,3%	1,6%	0,2%	0,2%
TELEFONICA BRASIL SA	1.606.861	6,4%	1,4%	0,2%	0,2%
RODOVIAS COLINAS SA	1.398.724	5,5%	1,2%	0,2%	0,1%
LOCALIZA RENT A CAR SA	1.058.012	4,2%	0,9%	0,1%	0,1%
NATURA COSMETICOS SA	1.045.988	4,1%	0,9%	0,1%	0,1%
GUARARAPES CONFECÇOES SA (EX CONFECÇOES GUARARAPES SA)	872.536	3,5%	0,8%	0,1%	0,1%
LOJAS AMERICANAS SA	821.624	3,2%	0,7%	0,1%	0,1%
COPEL GERACAO TRANSMISSAO SA	623.351	2,5%	0,5%	0,1%	0,1%
CELEO REDES DE TRANSMISSÃO ENERGIA S.A.	602.960	2,4%	0,5%	0,1%	0,1%
BCBF PARTICIPACOES S.A	424.461	1,7%	0,4%	0,0%	0,0%
VIA VAREJO SA	313.499	1,2%	0,3%	0,0%	0,0%
ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	277.452	1,1%	0,2%	0,0%	0,0%
SBF COMÉRCIO DE PRODUTOS ESPORTIVOS S.A.	261.943	1,0%	0,2%	0,0%	0,0%
BR PROPERTIES SA	234.329	0,9%	0,2%	0,0%	0,0%
C&A MODAS S.A.	176.850	0,7%	0,2%	0,0%	0,0%
NCF PARTICIPACOES SA	151.302	0,6%	0,1%	0,0%	0,0%
CAGECE CIA AGUA ESGOTO CEARA	102.236	0,4%	0,1%	0,0%	0,0%
TOTAL	25.283.040	100,0%	22,1%	2,7%	2,4%

EMISSION	Valor	% FINANCEIRO	% CP	%RF	%RG
BANCO ITAU S/A	31.454.000	35,3%	27,5%	3,4%	3,0%
BCO SAFRA SA	27.764.141	31,1%	24,3%	3,0%	2,6%
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	18.041.567	20,2%	15,8%	2,0%	1,7%
BRADESCO PROPRIOS	8.348.454	9,4%	7,3%	0,9%	0,8%
BANCO BNP PARIBAS BRASIL SA	2.667.122	3,0%	2,3%	0,3%	0,3%
BCO VOTORANTIM SA	922.999	1,0%	0,8%	0,1%	0,1%
TOTAL	89.198.283	100,0%	77,9%	9,7%	8,5%

Fontes: Intrag

Os Maiores Emissores de Renda Variável

EMPRESA	R\$	% Renda Variável	% RG
VALE SA	13.225.752	13,0%	1,3%
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	8.580.148	8,4%	0,8%
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	4.786.275	4,7%	0,5%
BRADESCO PROPRIOS	3.359.298	3,3%	0,3%
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	3.283.220	3,2%	0,3%
BANCO BTG PACTUAL S A	2.230.724	2,2%	0,2%
VIA VAREJO SA	2.229.492	2,2%	0,2%
LOJAS AMERICANAS SA	2.003.949	2,0%	0,2%
BRF SA	1.976.643	1,9%	0,2%
AMBEV S.A	1.855.878	1,8%	0,2%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	102.077.412	100,0%	9,7%

Fonte: Intrag

Maiores Emissores Instituições Financeiras

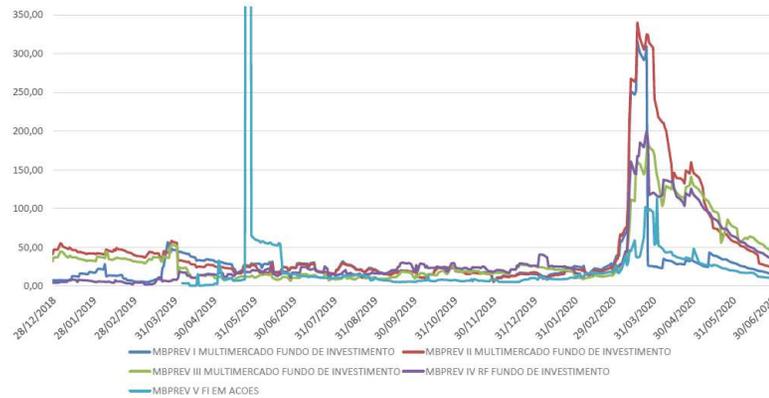
EMPRESA	R\$	% Inst. Financ.	% RG
BANCO ITAU S/A	31.454.000	30,3%	3,0%
BCO SAFRA SA	27.764.141	26,7%	2,6%
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	18.041.567	17,4%	1,7%
BRADESCO PROPRIOS	11.707.752	11,3%	1,1%
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	4.786.275	4,6%	0,5%
BANCO BNP PARIBAS BRASIL SA	2.667.122	2,6%	0,3%
BANCO BTG PACTUAL S A	2.230.724	2,1%	0,2%
BBSA	1.801.067	1,7%	0,2%
BANCO INTER SA	1.443.584	1,4%	0,1%
BCO VOTORANTIM SA	922.999	0,9%	0,1%
BANCO PAN S.A	569.995	0,5%	0,1%
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	326.452	0,3%	0,0%
BANCO MODAL SA	205.162	0,2%	0,0%
TOTAL INST. FINANCEIRAS	103.920.841	100,0%	9,9%

Fonte: Intrag

Rentabilidade Cota dos Investimentos

MB PREV / Benchmarks	Retorno dos Investimentos						
	1º Tri/21	2º Tri/21	1º Sem/21	3º Tri/20	4º Tri/20	2º Sem/20	12 Meses
Perfil Conservador							
MBPREV	0,38%	0,73%	1,11%	0,49%	0,51%	1,00%	2,14%
Benchmark: 100% IMA-S	0,44%	0,77%	1,22%	0,09%	0,56%	0,65%	1,88%
Perfil Moderado							
MBPREV	-0,30%	2,00%	1,70%	0,51%	4,13%	4,67%	6,43%
Benchmark: 77% IMA-S + 13% IMA-B+10% IbrX-100	-0,04%	1,99%	1,95%	0,23%	3,80%	4,04%	6,07%
Perfil Arrojado ***							
MBPREV	-0,45%	2,65%	2,19%	-	6,02%	6,02%	8,35%
Benchmark: 68% IMA-S + 12% IMA-B+20% IbrX-100	-0,05%	1,75%	1,70%	-	6,02%	6,02%	7,82%
Total							
Meta atuarial (INPC+ 2,51% a.a)	2,60%	2,59%	5,26%	2,71%	4,38%	7,21%	12,85%
*** Perfil Arrojado inicio em 10.2020							

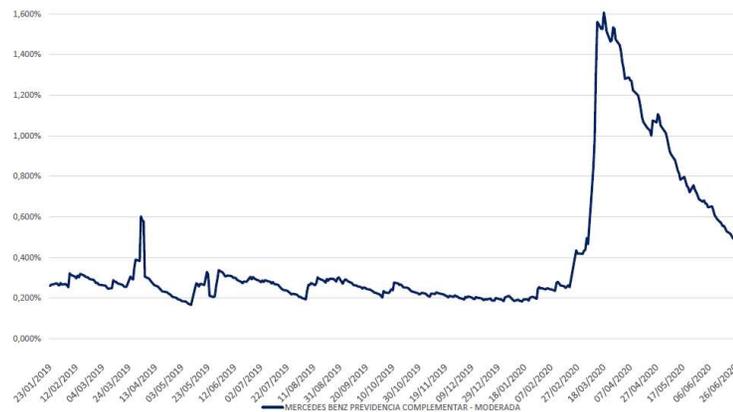
Consumo do Limite de Risco do Mercado



Obs.: O gráfico ao lado mostra qual o percentual do limite de risco de mercado que cada fundo utilizou ao longo do mês. O limite de VaR praticado é de 0,7% ao dia

Fonte: Intrag

Consumo do Limite de Risco do Mercado (Consolidada)



Obs.: o limite de VaR praticado é de 0,7% ao dia

Fonte: Intrag

Custo da Administração – Taxa de Gestão e Administração

Mês	MBPREVCONSER	MBPREVMOD	MBPrev I (BRAM)	MBPrev II (BRAM)	MBPrev III (SAM)	MBPrev IV (SAM)	MBPrev V (BNP)	Intrag	Total
Janeiro	-	-	12.864,91	36.687,62	24.637,95	5.404,34	7.195,01	27.321,46	114.111,29
Fevereiro	-	-	10.561,13	30.528,34	20.247,99	3.405,86	5.801,16	30.031,38	100.575,86
Março	-	-	12.811,29	37.061,19	24.522,51	4.815,12	5.071,77	33.979,02	118.260,90
Abril	-	-	11.558,92	33.911,91	22.266,38	5.181,79	3.839,35	26.934,26	103.692,61
Maió	-	-	11.594,01	34.098,23	22.306,09	5.099,16	4.023,22	26.996,76	104.117,47
Junho	-	-	12.207,24	36.082,61	23.531,93	5.250,93	4.902,17	28.388,12	110.363,00
Total	0,00	0,00	71.597,50	208.369,90	137.512,85	29.157,20	30.832,68	173.651,00	651.121,13

Custos Relacionados a Gestão dos Recursos (em R\$)

Mês	Taxa de Administração e Gestão	Taxa de Custódia	Taxas bancárias	Despesas B3	Taxa de Fiscalização CVM	Auditoria	Despesas ANBID	Despesas com Cartório	Total Geral	Patrimônio Médio	% Debitado Investimentos
Janeiro	114.111,29	35.762,94	2.099,88	21.361,06	36.840,50	0,00	0,00	1.742,86	522.066,68	1.016.993.034,50	0,25%
Fevereiro	100.575,86	29.947,79	2.307,60	24.603,58	0,00	14.163,36	3.281,00	0,00	493.360,13	1.018.234.386,18	0,21%
Março	118.260,90	35.207,61	2.544,77	25.309,91	0,00	0,00	0,00	0,00	540.589,64	985.209.849,71	0,22%
Abril	103.692,61	32.293,53	2.410,16	22.119,27	34.584,95	0,00	3.115,00	0,00	496.157,79	983.497.621,22	0,24%
Mai	104.117,47	32.438,27	2.371,70	21.863,93	0,00	0,00	0,00	0,00	469.434,81	989.299.624,01	0,20%
Junho	110.363,00	34.235,43	2.044,79	21.555,07	0,00	0,00	3.115,00	0,00	470.136,62	1.004.123.921,30	0,20%
Total	651.121,13	199.885,57	13.778,90	136.812,82	71.425,45	14.163,36	9.511,00	1.742,86	2.991.745,67	999.559.739,49	0,22%

Custos incorridos com a Administração dos Ativos da MBPrev – Reembolsado pela Patrocinadora

Mês	Taxa de Controladoria	Taxa Cálculo Risco	Extrato CBLC B3	Total
Janeiro	19.910,53	3.058,80	0,00	22.969,33
Fevereiro	20.980,67	3.192,80	0,00	24.173,47
Março	20.980,22	3.192,80	6,00	24.179,02
Abril	19.392,51	3.192,80	0,00	22.585,31
Maio	19.455,70	3.192,80	0,00	22.648,50
Junho	20.373,59	3.192,80	6,00	23.572,39
Total	121.093,22	19.022,80	12,00	140.128,02

Acompanhamento da gestão

Comentários:

As informações apresentadas anteriormente indicam que os investimentos dos planos estão aderentes à Resolução CMN nº 4.661/2018 e com a sua política de investimentos.

