

Relatório de Acompanhamento da Gestão Financeira 1º SEMESTRE DE 2022



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/2022		2º Semestre/2021		Limite 4.661	Política de Investimentos	
	R\$	%	R\$	%		Mínimo	Máximo
Renda Fixa	953.044.851	86,8%	898.996.279	84,8%	100,0%	54%	100%
Renda Variável	57.966.997	5,3%	88.600.381	8,4%	70,0%	0%	25%
Investimentos Estruturados	79.550.474	7,2%	72.709.429	6,9%	20%	0%	13%
Investimento no Exterior	7.242.918	0,7%	0	0,0%	10%	0%	8%
Total	1.097.805.240	100%	1.060.306.088	100%			

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

Segmentos	1º Semestre/2022		2º Semestre/2021		Limite 4.661	Política de Investimentos	
	R\$	%	R\$	%		Mínimo	Máximo
Renda Fixa	946.028.970	86,7%	892.842.542	84,7%	100,0%	54%	100%
Renda Variável	57.966.997	5,3%	88.600.381	8,4%	70,0%	0%	25%
Investimentos Estruturados	79.550.474	7,3%	72.709.429	6,9%	20%	0%	13%
Investimento no Exterior	7.242.918	0,7%	0	0,0%	10%	0%	8%
Total	1.090.789.359	100%	1.054.152.352	100%			

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

Segmentos	1º Semestre/2022		2º Semestre/2021		Limite 4.661	Política de Investimentos	
	R\$	%	R\$	%		Mínimo	Máximo
Renda Fixa	7.015.881	100,0%	6.153.736	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	7.015.881	100%	6.153.736	100%			

Fontes: MB Prev e Intrag

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

Renda Fixa	Entidade	Plano de Aposentadoria	PGA
Fundos de Investimentos	952.928.233	945.912.351	7.015.881
Caixa (Administrado + Própria)	40.316	40.316	0
Total RF	952.968.549	945.952.667	7.015.881
Renda Variável	Entidade	Plano de Aposentadoria	PGA
Fundos de Investimentos	58.042.290	58.042.290	0
Total RV	58.042.290	58.042.290	0
Investimentos Estruturados	Entidade	Plano de Aposentadoria	PGA
Fundos de Investimentos	79.550.474	79.550.474	0
Total MM	79.550.474	79.550.474	0
Investimento no Exterior	Entidade	Plano de Aposentadoria	PGA
Fundos de Investimentos	7.242.918	7.242.918	0
Total IE	7.242.918	7.242.918	0
Total do DI	1.097.804.230	1.090.788.349	7.015.881

Fontes: MB Prev e Intrag

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

Segmentos	1º Semestre/2022	%	2º Semestre/2021	%
Renda Fixa	113.377.742	83,0%	107.271.470	78,3%
Renda Variável	14.734.063	10,8%	24.342.624	17,8%
Investimentos Estruturados	6.159.510	4,5%	5.404.026	3,9%
Investimento no Exterior	2.365.937	1,7%	-	0,0%
Total	136.637.252	100,0%	137.018.120	100,0%

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

Segmentos	1º Semestre/2022	%	2º Semestre/2021	%
Renda Fixa	600.335.525	89,5%	622.375.485	88,1%
Renda Variável	43.308.227	6,5%	64.325.935	9,1%
Investimentos Estruturados	22.303.103	3,3%	19.567.554	2,8%
Investimento no Exterior	4.876.981	0,7%	-	0,0%
Total	670.823.837	100,0%	706.268.975	100,0%

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

Segmentos	1º Semestre/2022	%	2º Semestre/2021	%
Renda Fixa	290.305.241	100,0%	216.810.664	100,0%
Renda Variável	-	0,0%	-	0,0%
Investimentos Estruturados	-	0,0%	-	0,0%
Investimento no Exterior	-	0,0%	-	0,0%
Total	290.305.241	100,0%	216.810.664	100,0%

Fontes: MB Prev e Intrag

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	86,8%	54%	100%	100%
Renda Variável	5,3%	0%	25%	70%
Investimentos Estruturados	7,2%	0%	13%	20%
Investimento no Exterior	0,7%	0%	8%	10%

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
Arx Investimentos (Arx Income I	9.870.677	0,9%	0,9%
Bahia AM (Bahia AM Valuation F	8.344.638	0,8%	0,8%
Bradesco (MB I)	126.476.582	11,5%	11,5%
Bradesco (MB II)	321.801.197	29,3%	29,3%
Santander (MB III)	340.822.771	31,0%	31,0%
Santander (MB IV)	163.830.640	14,9%	14,9%
BNP (MB V)	30.435.821	2,8%	2,8%
Gauss (Gauss FC FIM)	24.854.989	2,3%	2,3%
Absolute (Absolute Vertex II FC	28.462.613	2,6%	2,6%
Moat Capital (Moat Capital FIC F	9.391.153	0,9%	0,9%
JGP (JGP Strategy Estruturado FC	26.232.871	2,4%	2,4%
Schroder (Schroder Sust Ações G	7.242.918	0,7%	0,7%
Intrag	38.368	0,0%	0,0%
Total	1.097.805.240	100,0%	100,0%

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		
							Mín.	Máx.	Target
Total dos recursos garantidores		1.010.591.178	38.368	1.010.552.810	100,0%	-	-	-	-
Renda Fixa		953.023.034	38.368	952.984.666	94,3%	100%	85%	100%	-
Títulos Públicos		790.162.100	0	790.162.100	78,2%	100%	70%	100%	-
Títulos Privados		162.911.856	0	162.911.856	16,1%	80%	0%	30%	-
	CCB, CCCB e NP	0	0	0	0,0%	20%	-	-	-
	NCE e CCE	0	0	0	0,0%	20%	-	-	-
	FIDC e FICFIDC	0	0	0	0,0%	20%	-	-	-
	CPR, CDCA, CRA, WA	0	0	0	0,0%	20%	-	-	-
	Tit. De Cias Abertas (exceto debênture)	0	0	0	0,0%	20%	-	-	-
	Títulos de Cias Securitizadoras	0	0	0	0,0%	20%	-	-	-
CDB, DEB, NC, DPGE, LF		162.911.856	0	162.911.856	16,1%	80%	-	30%	-
Termo de Renda Fixa		0	0	0	0,0%	-	-	-	-
Derivativos		0	0	0	0,0%	15%	0%	15%	-
Valores a Receber/Pagar		-123.778	-1.948	-121.830	0,0%	-	-	-	-
Caixa		72.856	40.316	32.540	0,0%	-	-	-	-

Enquadramento em Renda Variável

Valores a Receber/Pagar		Total (R\$)	Carteira	Fundos	Entidade	Limite Res. 4.661	Política de Investimentos ¹		
							Mín.	Máx.	Target
Renda Variável		57.568.144	0	57.568.144	5,7%	70%	0%	15%	-
Ações		56.837.013	0	56.837.013	5,6%	70%	0%	15%	-
	Novo Mercado	33.849.804	0	33.849.804	3,3%	70%	-	-	-
	Nível 2	9.731.641	0	9.731.641	1,0%		-	-	-
	Nível 1	11.380.210	0	11.380.210	1,1%	50%	-	-	-
	Bovespa Mais	1.875.358	0	1.875.358	0,2%		-	-	-
	Sem Selo de Governança	0	0	0	0,0%		-	-	-
Fundos de Índice		0	0	0	0,0%	-	-	-	-
Outros Ativos		-6.147	0	-6.147	0,0%	3%	-	-	-
Valores a Receber/Pagar		737.279	0	737.279	0,1%	-	-	-	-

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	-	0,0%	-	0,0%	-	0,0%
Até 63	-	0,0%	-	0,0%	-	0,0%
Até 84	-	0,0%	-	0,0%	-	0,0%
Até 105	-	0,0%	-	0,0%	-	0,0%
Até 126	-	0,0%	-	0,0%	-	0,0%
Até 252	25.886.949	15,9%	76.986.573	9,7%	102.873.523	10,8%
Até 504	29.453.591	18,1%	30.242.300	3,8%	59.695.891	6,3%
Até 756	23.133.682	14,2%	198.033.943	25,0%	221.167.625	23,2%
Até 1008	27.645.813	17,0%	87.775.008	11,1%	115.420.821	12,1%
Acima de 1008	56.791.820	34,9%	397.568.658	50,3%	454.360.478	47,7%
Total	162.911.856	100,0%	790.606.483	100,0%	953.518.339	100,0%

Fonte: Intrag

Risco de crédito

Debêntures

CARACTERÍSTICAS DA EMISSÃO								RATING ATUAL: Junho 2022								
Título	Carteira	Emitente	Valor	Rating	Agência	Vcto	Aquisição	FITCH			MOODY'S			S&P		
Data	Rating	Class	Data	Rating	Class	Data	Rating	Class	Data	Rating	Class	Data	Rating	Class		
-	-	-	-	-	-	-	brAAA	☺⇌	-	-	-	-	brAAA	☺⇌		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	A+(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	brAAA	☺⇌	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	brAAA	☺⇌	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-	-	-						

Fontes: Intrag e Agências de Rating

LEGENDA I		LEGENDA II	
☺	GRAU DE INVESTIMENTO	Estável	⇌
☹	GRAU ESPECULATIVO	Upgrade	⬆
		Downgrade	⬇

Risco de crédito

Debêntures

CARACTERÍSTICAS DA EMISSÃO

Título	Carteira	Emitente	Valor	Rating	Agência	Vcto	Aquisição
DEB	MBPREV III	CELPE	1.763.286,05	brAAA	S&P	15/04/2026	03/12/2021
DEB	MBPREV III	ELETRONBRAS	1.006.198,95	brAAA	S&P	15/04/2026	24/06/2022
DEB	MBPREV III	ELETRONBRAS	1.331.043,07	brAAA	S&P	25/04/2026	17/05/2019
DEB	MBPREV III	VIA VAREJO	258.615,95	brAA	S&P	30/04/2026	10/05/2021
DEB	MBPREV III	BRF	1.007.200,94	AA+(bra)	FITCH	30/04/2026	23/06/2022
DEB	MBPREV III	AERIS	242.255,15	AA(bra)	FITCH	31/07/2026	16/08/2021
DEB	MBPREV III	BR PROPERTIES	425.475,57	brAA+	S&P	10/08/2026	19/08/2021
DEB	MBPREV III	SANEAGO	367.510,24	A+(bra)	FITCH	11/08/2026	25/08/2021
DEB	MBPREV III	CIA ESTADUAL DISTRIB	158.516,31	brAA+	S&P	15/08/2026	25/08/2021
DEB	MBPREV III	MRS LOGÍSTICA	649.878,26	AAA(bra)	FITCH	15/08/2026	22/09/2021
DEB	MBPREV III	COGNA EDUCAÇÃO	807.188,35	AA+(bra)	FITCH	20/08/2026	20/08/2021
DEB	MBPREV III	VAMOS	884.601,25	AA-(bra)	FITCH	20/08/2026	04/10/2021
DEB	MBPREV III	MOVIDA	889.277,62	AA-(bra)	FITCH	15/09/2026	20/09/2021
DEB	MBPREV III	COPASA	590.871,64	AAA.br	MOODY'S	15/09/2026	29/09/2021
DEB	MBPREV III	VIA	513.217,42	brAA	S&P	15/09/2026	29/09/2021
DEB	MBPREV III	MAGAZINE LUIZA	522.563,77	brAAA	S&P	15/10/2026	15/10/2021
DEB	MBPREV III	MINERVA	214.960,59	brAAA	S&P	15/10/2026	21/10/2021
DEB	MBPREV III	LIGHT SERVIÇOS ELETR	1.096.056,66	brAA+	S&P	15/10/2026	10/11/2021
DEB	MBPREV III	COPEL GERAÇÃO E TRA	1.031.960,63	AAA(bra)	FITCH	15/10/2026	11/11/2021
DEB	MBPREV III	ANHANGUERA BANDEI	1.056.917,22	AAA.br	MOODY'S	04/11/2026	09/11/2021
DEB	MBPREV III	ANHANGUERA BANDEI	2.057.506,49	AAA.br	MOODY'S	04/11/2026	21/02/2022
DEB	MBPREV III	PAGUE MENOS	191.773,34	A+(bra)	FITCH	05/11/2026	25/02/2022
DEB	MBPREV III	LOCAMERICA	1.672.373,91	brAAA	S&P	10/11/2026	08/12/2021
DEB	MBPREV III	EQUATORIAL	1.006.667,58	brAA+	S&P	15/12/2026	28/06/2022
DEB	MBPREV III	COLINAS	1.005.246,46	brAA+	S&P	15/12/2026	29/06/2022
DEB	MBPREV III	LOCALIZA	125.809,21	AAA(bra)	FITCH	25/02/2027	11/03/2022
DEB	MBPREV III	AES TIETÊ	1.004.249,61	AA(bra)	FITCH	15/03/2027	30/06/2022
DEB	MBPREV III	BK BRASIL	301.161,09	AA(bra)	FITCH	24/04/2027	28/04/2022
DEB	MBPREV III	LOCAMERICA	459.479,64	brAAA	S&P	10/05/2027	13/05/2022
DEB	MBPREV III	GUARARAPES	2.037.945,98	A+(bra)	FITCH	10/05/2027	26/05/2022
DEB	MBPREV III	RUMO MALHA PAULIST	261.393,97	AAA(bra)	FITCH	15/10/2027	22/10/2021
DEB	MBPREV III	SENDAS DISTRIBUIDOR	273.559,04	AAA(bra)	FITCH	26/11/2027	07/01/2022

RATING ATUAL: Junho 2022

FITCH			MOODY'S			S&P		
Data	Rating	Class	Data	Rating	Class	Data	Rating	Class
-	-	-	-	-	-	-	brAAA	😊⇌
-	-	-	-	-	-	-	brAAA	😊⇌
-	-	-	-	-	-	-	brAAA	😊⇌
-	-	-	-	-	-	-	brAA	😊⇌
-	AA+(bra)	😊⇌	-	-	-	-	-	-
-	AA(bra)	😊⇌	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	brAA+	😊⇌
-	A+(bra)	😊⇌	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	brAA+	😊⇌
-	AAA(bra)	😊⇌	-	-	-	-	-	-
-	AA+(bra)	😊⇌	-	-	-	-	-	-
-	AA-(bra)	😊⇌	-	-	-	-	-	-
-	AA-(bra)	😊⇌	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	AAA.br	😊⇌	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	brAA	😊⇌
-	-	-	-	-	-	-	brAAA	😊⇌
-	-	-	-	-	-	-	brAAA	😊⇌
-	-	-	-	-	-	-	brAAA+	😊⇌
-	AAA(bra)	😊⇌	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	AAA.br	😊⇌	-	-	-
-	-	-	-	AAA.br	😊⇌	-	-	-
-	A+(bra)	😊⇌	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	brAAA	😊⇌
-	-	-	-	-	-	-	brAA+	😊⇌
-	-	-	-	-	-	-	brAA+	😊⇌
-	AAA(bra)	😊⇌	-	-	-	-	-	-
-	AA(bra)	😊⇌	-	-	-	-	-	-
-	AA(bra)	😊⇌	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	brAAA	😊⇌
-	A+(bra)	😊⇌	-	-	-	-	-	-
-	AAA(bra)	😊⇌	-	-	-	-	-	-
-	AAA(bra)	😊⇌	-	-	-	-	-	-

Fontes: Intrag e Agências de Rating

LEGENDA I

😊	GRAU DE INVESTIMENTO
😬	GRAU ESPECULATIVO

LEGENDA II

Estável	⇌
Upgrade	⬆
Downgrade	⬇

Risco de crédito

Debêntures

CARACTERÍSTICAS DA EMISSÃO

Título	Carteira	Emitente	Valor	Rating	Agência	Vcto	Aquisição
DEB	MBPREV III	SABESP	1.362.506,87	brAAA	S&P	15/07/2028	16/07/2021
DEB	MBPREV III	ALGAR	268.025,71	brAAA	S&P	15/07/2028	12/08/2021
DEB	MBPREV III	RGE SUL DISTRIBUIDOR	644.255,14	AAA.br	MOODY'S	27/09/2028	08/10/2021
DEB	MBPREV III	ENERGISA	313.939,82	AAA(bra)	FITCH	15/10/2028	29/10/2021
DEB	MBPREV III	CCR	933.436,04	brAAA	S&P	15/01/2029	14/02/2022
DEB	MBPREV III	RAIA DROGASIL	346.775,45	AAA(bra)	FITCH	25/01/2029	16/02/2022
DEB	MBPREV III	LOCALIZA	118.902,55	AAA(bra)	FITCH	25/02/2029	11/03/2022
DEB	MBPREV III	HAPVIDA	2.553.097,98	AAA(bra)	FITCH	10/05/2029	18/05/2022
DEB	MBPREV IV	PETROBRAS	1.772.581,30	AA(bra)	FITCH	15/08/2022	29/10/2019
DEB	MBPREV IV	PETROBRAS	230.979,05	AA(bra)	FITCH	15/08/2022	29/10/2019
DEB	MBPREV IV	GERDAU	528.407,59	brAAA	S&P	21/11/2022	20/03/2019
DEB	MBPREV IV	NCF PARTIPAÇÕES	157.638,22	AA+(bra)	FITCH	23/12/2023	23/12/2020
DEB	MBPREV IV	COPEL GERAÇÃO E TRA	125.491,36	AA(bra)	FITCH	15/07/2024	30/01/2020
DEB	MBPREV IV	B3	570.556,05	AAA.br	MOODY'S	14/08/2024	07/12/2021
DEB	MBPREV IV	B3	211.317,06	AAA.br	MOODY'S	14/08/2024	08/12/2021
DEB	MBPREV IV	B3	52.829,26	AAA.br	MOODY'S	14/08/2024	27/12/2021
DEB	MBPREV IV	B3	190.185,35	AAA.br	MOODY'S	14/08/2024	27/12/2021
DEB	MBPREV IV	ELETRONBRAS	633.588,67	brAAA	S&P	25/04/2026	17/05/2019
DEB	MBPREV IV	B3	98.850,06	AAA.br	MOODY'S	24/05/2026	08/06/2022
DEB	MBPREV IV	B3	719.465,35	AAA.br	MOODY'S	24/05/2026	10/06/2022
DEB	MBPREV IV	B3	97.830,98	AAA.br	MOODY'S	24/05/2026	14/06/2022
DEB	MBPREV IV	B3	3.057,22	AAA.br	MOODY'S	24/05/2026	14/06/2022
DEB	MBPREV IV	FERROVIA CENTRO ATL	696.016,89	brAAA	S&P	20/06/2026	30/06/2022
DEB	MBPREV IV	CIA ESTADUAL DISTRIB	110.226,57	brAA+	S&P	15/08/2026	25/08/2021
DEB	MBPREV IV	MAGAZINE LUIZA	301.790,71	brAAA	S&P	15/10/2026	15/10/2021
DEB	MBPREV IV	ANHANGUERA BANDEI	477.251,38	AAA.br	MOODY'S	04/11/2026	09/11/2021
DEB	MBPREV IV	REDE D'OR SÃO LUIZ	210.384,26	AAA(bra)	FITCH	20/12/2026	03/09/2021
DEB	MBPREV IV	ALIANÇA ENERGIA	884.416,31	AAA(bra)	FITCH	15/01/2027	01/02/2022
DEB	MBPREV IV	ARTERIS	440.221,18	brAA+	S&P	11/03/2027	24/03/2022
DEB	MBPREV IV	COMPANHIA ESTADUA	1.663.320,63	AAA.br	MOODY'S	25/05/2027	08/06/2022
DEB	MBPREV IV	HAPVIDA	318.120,89	AAA(bra)	FITCH	10/05/2029	18/05/2022

RATING ATUAL: Junho 2022

FITCH			MOODY'S			S&P		
Data	Rating	Class	Data	Rating	Class	Data	Rating	Class
-	-	-	-	-	-	-	brAAA	😊⇒
-	-	-	-	-	-	-	brAAA	😊⇒
-	-	-	-	AAA.br	😊⇒	-	-	-
-	AAA(bra)	😊⇒	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	brAAA	😊⇒
-	AAA(bra)	😊⇒	-	-	-	-	-	-
-	AAA(bra)	😊⇒	-	-	-	-	-	-
-	AAA(bra)	😊⇒	-	-	-	-	-	-
-	AA(bra)	😊⇒	-	-	-	-	-	-
-	AA(bra)	😊⇒	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	brAAA	😊⇒
-	AA+(bra)	😊⇒	-	-	-	-	-	-
-	AA(bra)	😊⇒	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	AAA.br	😊⇒	-	-	-
-	-	-	-	AAA.br	😊⇒	-	-	-
-	-	-	-	AAA.br	😊⇒	-	-	-
-	-	-	-	AAA.br	😊⇒	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	brAAA	😊⇒
-	-	-	-	AAA.br	😊⇒	-	-	-
-	-	-	-	AAA.br	😊⇒	-	-	-
-	-	-	-	AAA.br	😊⇒	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	brAAA	😊⇒
-	-	-	-	-	-	-	brAA+	😊⇒
-	-	-	-	-	-	-	brAAA	😊⇒
-	-	-	-	AAA.br	😊⇒	-	-	-
-	AAA(bra)	😊⇒	-	-	-	-	-	-
-	AAA(bra)	😊⇒	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	brAA+	😊⇒
-	-	-	-	AAA.br	😊⇒	-	-	-
-	AAA(bra)	😊⇒	-	-	-	-	-	-

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

RATING ATUAL: Junho 2022

Título	Carteira	Emitente	Valor	Rating	Agência	Vcto	Aquisição
LF	MBPREV I	BANCO SAFRA	725.360,33	AA+.br	MOODY'S	11/07/2022	10/01/2019
LF	MBPREV I	BANCO SAFRA	3.868.588,44	AA+.br	MOODY'S	11/07/2022	29/04/2020
LF	MBPREV I	BANCO SAFRA	1.620.384,10	AA+.br	MOODY'S	22/08/2022	21/02/2019
LF	MBPREV I	BANCO SAFRA	1.043.700,14	AA+.br	MOODY'S	19/09/2022	18/09/2019
LF	MBPREV I	BANCO SAFRA	1.622.147,46	AA+.br	MOODY'S	21/10/2022	21/02/2019
LF	MBPREV I	BANCO VOTORANTIM	1.300.050,38	AA-.br	MOODY'S	30/11/2022	09/11/2021
LF	MBPREV I	BANCO ALFA	1.353.177,44	AA(bra)	FITCH	12/12/2022	11/12/2020
LF	MBPREV I	BANCO ALFA	1.522.324,62	AA(bra)	FITCH	12/12/2022	09/11/2021
LF	MBPREV I	BANCO VOTORANTIM	1.796.765,51	AA-.br	MOODY'S	10/02/2023	09/11/2021
LF	MBPREV I	BANCO ALFA	448.095,19	AA(bra)	FITCH	09/03/2023	09/11/2021
LF	MBPREV I	BANCO BNP PARIBAS	498.036,74	brAAA	S&P	30/05/2023	28/05/2021
LF	MBPREV I	BANCO BNP PARIBAS	387.361,91	brAAA	S&P	30/05/2023	09/11/2021
LF	MBPREV I	BANCO SANTANDER	1.705.980,32	AAA.br	MOODY'S	11/12/2023	23/03/2022
LF	MBPREV I	BANCO VOTORANTIM	879.103,66	AA-.br	MOODY'S	04/03/2024	30/08/2021
LF	MBPREV I	BANCO VOTORANTIM	419.679,36	AA-.br	MOODY'S	20/05/2024	18/02/2022
LF	MBPREV I	BANCO SANTANDER	715.860,99	AAA.br	MOODY'S	27/05/2024	23/03/2022
LF	MBPREV I	BANCO SAFRA	682.463,27	AA+.br	MOODY'S	07/02/2025	07/02/2022
LF	MBPREV I	BANCO SAFRA	622.583,09	AA+.br	MOODY'S	17/03/2025	17/03/2022
LF	MBPREV II	BANCO SAFRA	2.901.441,33	AA+.br	MOODY'S	11/07/2022	10/01/2019
LF	MBPREV II	BANCO SAFRA	967.147,11	AA+.br	MOODY'S	11/07/2022	15/12/2021
LF	MBPREV II	BANCO SAFRA	6.121.451,06	AA+.br	MOODY'S	22/08/2022	21/02/2019
LF	MBPREV II	BANCO SAFRA	2.783.200,39	AA+.br	MOODY'S	19/09/2022	18/09/2019
LF	MBPREV II	BANCO SAFRA	869.750,12	AA+.br	MOODY'S	19/09/2022	17/11/2021
LF	MBPREV II	BANCO SAFRA	6.128.112,61	AA+.br	MOODY'S	21/10/2022	21/02/2019
LF	MBPREV II	BANCO SAFRA	1.081.431,64	AA+.br	MOODY'S	21/10/2022	17/11/2021
LF	MBPREV II	BANCO VOTORANTIM	904.382,88	AA-.br	MOODY'S	30/11/2022	11/01/2022
LF	MBPREV II	BANCO SAFRA	2.296.664,72	AA+.br	MOODY'S	30/01/2023	17/11/2021
LF	MBPREV II	BANCO VOTORANTIM	449.191,38	AA-.br	MOODY'S	10/02/2023	11/01/2022
LF	MBPREV II	BANCO ABC	1.173.585,04	AA.br	MOODY'S	22/03/2023	17/11/2021
LF	MBPREV II	BANCO VOTORANTIM	167.301,17	AA-.br	MOODY'S	28/04/2023	11/01/2022
LF	MBPREV II	BANCO BNP PARIBAS	2.434.846,29	brAAA	S&P	30/05/2023	28/05/2021
LF	MBPREV II	BANCO BNP PARIBAS	110.674,83	brAAA	S&P	30/05/2023	11/01/2022

[illegible]

Fontes: Intrag e Agências de Rating

LEGENDA I		LEGENDA II	
	GRAU DE INVESTIMENTO	Estável	↔
	GRAU ESPECULATIVO	Upgrade	↑
		Downgrade	↓

Risco de crédito

Letras Financeiras

CARACTERÍSTICAS DA EMISSÃO

Título	Carteira	Emitente	Valor	Rating	Agência	Vcto	Aquisição
LF	MBPREV II	BANCO SANTANDER	605.577,81	AAA.br	MOODY'S	12/06/2023	11/01/2022
LF	MBPREV II	BANCO CITIBANK	276.825,33	AAA(bra)	FITCH	10/07/2023	12/01/2022
LF	MBPREV II	BANCO SAFRA	1.064.969,18	AA+.br	MOODY'S	22/09/2023	17/11/2021
LF	MBPREV II	BANCO SANTANDER	1.540.885,45	AAA.br	MOODY'S	11/12/2023	15/12/2021
LF	MBPREV II	BANCO SANTANDER	605.347,86	AAA.br	MOODY'S	11/12/2023	11/01/2022
LF	MBPREV II	BANCO VOTORANTIM	221.820,74	AA-.br	MOODY'S	03/01/2024	12/01/2022
LF	MBPREV II	BANCO VOTORANTIM	2.966.974,84	AA-.br	MOODY'S	04/03/2024	30/08/2021
LF	MBPREV II	BANCO VOTORANTIM	109.887,96	AA-.br	MOODY'S	04/03/2024	12/01/2022
LF	MBPREV II	BANCO SAFRA	1.067.773,02	AA+.br	MOODY'S	22/03/2024	17/11/2021
LF	MBPREV II	BANCO SAFRA	111.879,60	AA+.br	MOODY'S	06/05/2024	17/11/2021
LF	MBPREV II	BANCO VOTORANTIM	1.416.417,83	AA-.br	MOODY'S	20/05/2024	18/02/2022
LF	MBPREV II	BANCO SANTANDER	220.264,92	AAA.br	MOODY'S	27/05/2024	11/01/2022
LF	MBPREV II	BANCO ALFA	223.339,18	AA(bra)	FITCH	22/07/2024	12/01/2022
LF	MBPREV II	BANCO SAFRA	2.257.378,51	AA+.br	MOODY'S	07/02/2025	07/02/2022
LF	MBPREV II	BANCO SAFRA	1.556.457,71	AA+.br	MOODY'S	17/03/2025	17/03/2022
LF	MBPREV III	BANCO ALFA	1.200.106,75	AA(bra)	FITCH	11/08/2022	06/02/2020
LF	MBPREV III	BANCO VOTORANTIM	1.017.308,97	AA-.br	MOODY'S	01/12/2022	01/12/2020
LF	MBPREV III	BANCO SAFRA	6.884.370,31	AA+.br	MOODY'S	14/04/2025	14/04/2022
LF	MBPREV IV	BANCO VOTORANTIM	1.595.756,84	AA-.br	MOODY'S	24/03/2023	04/05/2022
LF	MBPREV IV	BANCO VOTORANTIM	391.593,86	AA-.br	MOODY'S	12/06/2023	29/11/2021
LF	MBPREV IV	BANCO CITIBANK	1.162.666,39	AAA(bra)	FITCH	10/07/2023	29/09/2021
LF	MBPREV IV	BANCO BRADESCO	2.609.981,89	AA+.br	MOODY'S	28/08/2023	26/08/2021
LF	MBPREV IV	BANCO ABC	1.249.507,28	AA.br	MOODY'S	28/09/2023	28/09/2021
LF	MBPREV IV	BANCO SAFRA	1.141.331,46	AA+.br	MOODY'S	02/10/2023	29/09/2021
LF	MBPREV IV	BANCO BRADESCO	331.942,71	AA+.br	MOODY'S	09/10/2023	08/04/2021
LF	MBPREV IV	BANCO ALFA	447.490,82	AA(bra)	FITCH	28/11/2023	28/05/2021
LF	MBPREV IV	BANCO SAFRA	656.727,68	AA+.br	MOODY'S	04/01/2024	31/08/2021
LF	MBPREV IV	BANCO ITAÚ	1.790.002,22	AA+.br	MOODY'S	01/02/2024	26/01/2022
LF	MBPREV IV	BANCO ALFA	1.609.877,33	AA(bra)	FITCH	11/03/2024	11/03/2022
LF	MBPREV IV	BANCO ITAÚ	1.791.021,34	AA+.br	MOODY'S	01/04/2024	21/01/2022
LF	MBPREV IV	BANCO ITAÚ	6.209.664,00	AA+.br	MOODY'S	01/04/2024	24/03/2022

RATING ATUAL: Junho 2022

FITCH			MOODY'S			S&P		
Data	Rating	Class	Data	Rating	Class	Data	Rating	Class
-	-	-	-	AAA.br	☺⇌	-	-	-
-	AAA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	AA+.br	☺⇌	-	-	-
-	-	-	-	AAA.br	☺⇌	-	-	-
-	-	-	-	AAA.br	☺⇌	-	-	-
-	-	-	-	AA-.br	☺⇌	-	-	-
-	-	-	-	AA-.br	☺⇌	-	-	-
-	-	-	-	AA+.br	☺⇌	-	-	-
-	-	-	-	AA+.br	☺⇌	-	-	-
-	-	-	-	AA-.br	☺⇌	-	-	-
-	-	-	-	AAA.br	☺⇌	-	-	-
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	AA+.br	☺⇌	-	-	-
-	-	-	-	AA+.br	☺⇌	-	-	-
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	AA-.br	☺⇌	-	-	-
-	-	-	-	AA+.br	☺⇌	-	-	-
-	-	-	-	AA-.br	☺⇌	-	-	-
-	-	-	-	AA-.br	☺⇌	-	-	-
-	AAA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	AA+.br	☺⇌	-	-	-
-	-	-	-	AA.br	☺⇌	-	-	-
-	-	-	-	AA+.br	☺⇌	-	-	-
-	-	-	-	AA+.br	☺⇌	-	-	-
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	AA+.br	☺⇌	-	-	-
-	-	-	-	AA+.br	☺⇌	-	-	-
-	AA(bra)	☺⇌	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	AA+.br	☺⇌	-	-	-
-	-	-	-	AA+.br	☺⇌	-	-	-

Fontes: Intrag e Agências de Rating

LEGENDA I

☺	GRAU DE INVESTIMENTO
☹	GRAU ESPECULATIVO

LEGENDA II

Estável	⇌
Upgrade	⬆
Downgrade	⬇

Risco de crédito

Certificados de Depósito Bancário

CARACTERÍSTICAS DA EMISSÃO

Título	Carteira	Emitente	Valor	Rating	Agência	Vcto	Aquisição
CDB	MBPREV IV	BANCO BNP PARIBAS	2.641.749,18	brAAA	S&P	31/07/2023	16/05/2022

RATING ATUAL: Junho 2022

FITCH			MOODY'S			S&P		
Data	Rating	Class	Data	Rating	Class	Data	Rating	Class
-	-	-	-	-	-	-	brAAA	😊↔

Fontes: Intrag e Agências de Rating

LEGENDA I

😊	GRAU DE INVESTIMENTO
😬	GRAU ESPECULATIVO

LEGENDA II

Estável	↔
Upgrade	↑
Downgrade	↓

Tesouro Federal

EMISSION	VLR LÍQUIDO	%TPF	%RF	%TOTAL
LFT	678.129.249	85,8%	71,2%	61,8%
LTN	105.901.658	13,4%	11,1%	9,6%
NTN-B	6.131.192	0,8%	0,6%	0,6%
NTN-F	-	0,0%	0,0%	0,0%
TOTAL	790.162.100	100,0%	82,9%	72,0%

Risco de crédito

EMISSION	Valor	%CP	%RF	%TOTAL
DEBENTURE SIMPLES	66.334.114	40,7%	6,4%	6,0%
LETRA FINANCEIRA	93.935.993	57,7%	9,0%	8,6%
CERTIFICADO DE DEPÓSITO BANCÁRIO	2.641.749	1,6%	0,3%	0,2%
LETRAS COMERCIAIS	-	0,0%	0,0%	0,0%
TOTAL	162.911.856	100,0%	15,7%	14,8%

EMISSION	Valor	% NÃO FINANCEIRO	%CP	%RF	%TOTAL
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	8.482.470	12,8%	5,2%	0,8%	0,8%
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	4.754.608	7,2%	2,9%	0,5%	0,4%
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	3.662.136	5,5%	2,2%	0,4%	0,3%
CONCESSIONARIA SISTEMA ANHANGUERA BANDEIRANTES S/A	3.591.675	5,4%	2,2%	0,3%	0,3%
HAPVIDA PARTICIPACOES INVESTIMENTO SA	2.871.219	4,3%	1,8%	0,3%	0,3%
RODOVIAS COLINAS SA	2.422.484	3,7%	1,5%	0,2%	0,2%
COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	2.131.854	3,2%	1,3%	0,2%	0,2%
ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	2.126.419	3,2%	1,3%	0,2%	0,2%
GUARARAPES CONFECÇÕES SA (EX CONFECÇÕES GUARARAPES SA)	2.037.946	3,1%	1,3%	0,2%	0,2%
MOVIDA PARTICIPACOES	1.924.927	2,9%	1,2%	0,2%	0,2%
GERDAU SA	1.900.645	2,9%	1,2%	0,2%	0,2%
CIA ENERGETICA PERNAMBUCO CELPE	1.763.286	2,7%	1,1%	0,2%	0,2%
NATURA COSMETICOS SA	1.716.990	2,6%	1,1%	0,2%	0,2%
COPEL GERACAO TRANSMISSAO SA	1.695.272	2,6%	1,0%	0,2%	0,2%
COMPANHIA ESTADUAL DE TRANSMISSAO DE ENERGIA ELETRICA - CEEE-T	1.663.321	2,5%	1,0%	0,2%	0,2%
LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	1.404.732	2,1%	0,9%	0,1%	0,1%
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	1.362.507	2,1%	0,8%	0,1%	0,1%
USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMINAS	1.021.883	1,5%	0,6%	0,1%	0,1%
BRF SA	1.007.201	1,5%	0,6%	0,1%	0,1%
EQUATORIAL ENERGIA SA	1.006.668	1,5%	0,6%	0,1%	0,1%
OUTROS	17.785.872	26,8%	10,9%	1,7%	1,6%
TOTAL	66.334.114	100,0%	40,7%	6,4%	6,0%

EMISSION	Valor	% FINANCEIRO	%CP	%RF	%TOTAL
BCO SAFRA SA	48.075.313	49,8%	29,5%	4,6%	4,4%
BANCO ITAUS/A	9.790.688	10,1%	6,0%	0,9%	0,9%
BCO VOTORANTIM SA	7.063.456	7,3%	4,3%	0,7%	0,6%
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	6.804.411	7,0%	4,2%	0,7%	0,6%
BANCO VOTORANTIM S.A.	6.572.779	6,8%	4,0%	0,6%	0,6%
BANCO BNP PARIBAS BRASIL (BUNGEPREV	6.072.669	6,3%	3,7%	0,6%	0,6%
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	5.393.917	5,6%	3,3%	0,5%	0,5%
BRABESCO FIDC	2.941.925	3,0%	1,8%	0,3%	0,3%
BCO ABC BRASIL SA	2.423.092	2,5%	1,5%	0,2%	0,2%
BCO CITIBANK SA	1.439.492	1,5%	0,9%	0,1%	0,1%
TOTAL	96.577.742	100,0%	59,3%	9,3%	8,8%

Fontes: Intrag

Os Maiores Emissores de Renda Variável

EMPRESA	R\$	%RV	%TOTAL
VALE SA	7.488.896	13,2%	0,7%
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	5.812.490	10,2%	0,5%
BRADESCO FIDC	2.888.071	5,1%	0,3%
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	2.622.820	4,6%	0,2%
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	2.143.865	3,8%	0,2%
BRF SA	1.642.334	2,9%	0,1%
Banco BTG Pactual S.A.	1.562.105	2,7%	0,1%
BBSA	1.557.745	2,7%	0,1%
ITAUSA SA	1.291.424	2,3%	0,1%
LOJAS RENNER SA	1.250.805	2,2%	0,1%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	56.837.013	100,0%	5,2%

Fonte: Intrag

Os Maiores Emissores Instituições Financeiras

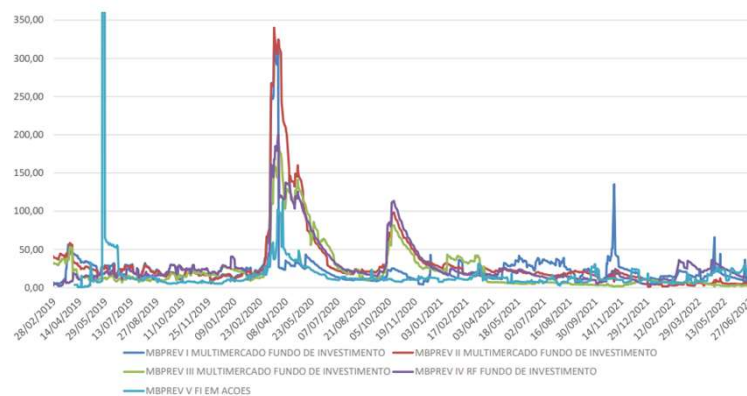
EMPRESA	R\$	% Inst. Financ.	%TOTAL
BCO SAFRA SA	48.075.313	47,7%	4,4%
BANCO ITAU S/A	9.790.688	9,7%	0,9%
BCO VOTORANTIM SA	7.063.456	7,0%	0,6%
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	6.804.411	6,7%	0,6%
BANCO VOTORANTIM S.A.	6.572.779	6,5%	0,6%
BANCO BNP PARIBAS BRASIL (BUNGEPREV	6.072.669	6,0%	0,6%
BRADESCO FIDC	5.829.996	5,8%	0,5%
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	5.553.496	5,5%	0,5%
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	2.622.820	2,6%	0,2%
BCO ABC BRASIL SA	2.423.092	2,4%	0,2%
TOTAL INST. FINANCEIRAS	100.808.721	100,0%	9,2%

Fonte: Intrag

Rentabilidade da Cota Contábil

MB Prev / Benchmarks	Retorno dos Investimentos*						
	1º Tri/22	2º Tri/22	1º Sem/22	3º Tri/21	4º Tri/21	2º Sem/21	12 Meses
Perfil Conservador							
MB Prev	2,58%	2,88%	5,54%	1,22%	1,85%	3,10%	8,81%
Benchmark: IMA-S	2,68%	2,89%	5,65%	1,39%	1,99%	3,41%	9,25%
Perfil Moderado							
MB Prev	2,87%	1,13%	4,03%	-1,13%	1,26%	0,12%	4,15%
Benchmark: 77% IMA-S + 13% IMA-B + 10% IbrX-100	3,87%	0,92%	4,82%	0,03%	1,52%	1,55%	6,45%
Perfil Agressivo							
MB Prev	2,60%	-0,06%	2,54%	-2,54%	0,92%	-1,65%	0,85%
Benchmark: 68% IMA-S + 12% IMA-B + 20% IbrX-100	4,48%	-1,15%	3,28%	-1,55%	1,13%	-0,45%	2,82%
Total							
Meta Atuarial: (INPC + 2,51% a.a.) até 2021, a partir de 2022 (INPC + 2,70% a.a.)	4,11%	2,81%	7,03%	3,78%	3,40%	7,30%	14,84%

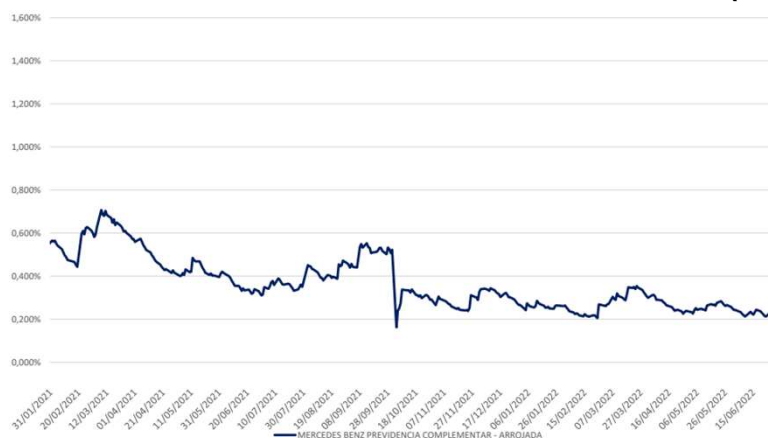
Consumo do Limite de Risco do Mercado



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

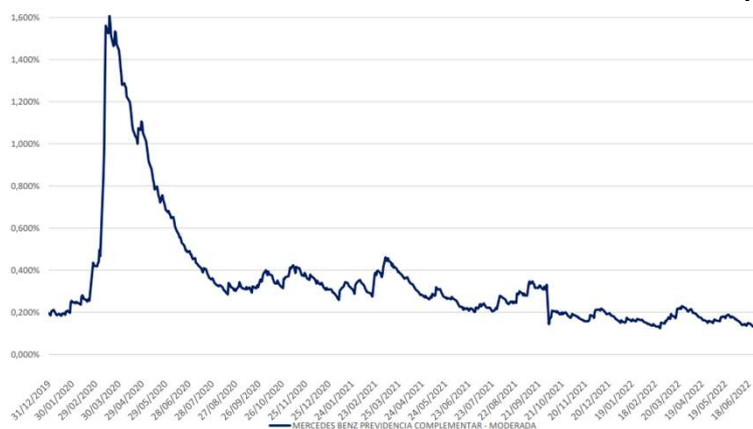
Consumo do Limite de Risco do Mercado (Consolidada) – Perfil Arrojado



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

Fonte: Intrag

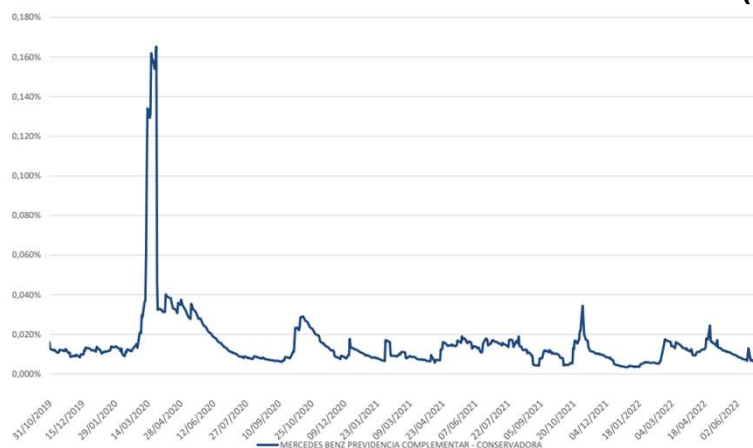
Consumo do Limite de Risco do Mercado (Consolidada) – Perfil Moderado



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

Fonte: Intrag

Consumo do Limite de Risco do Mercado (Consolidada) – Perfil Conservador



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	MBPREVARROJ	MBPrev I (BRAM)	MBPrev II (BRAM)	MBPrev III (SAM)	MBPrev IV (SAM)	MBPrev V (BNP)	Intrag	Total
Janeiro				8.518,17	39.346,48	35.656,70	9.605,40	4.355,61	27.739,04	125.221,40
Fevereiro				7.677,11	34.679,56	32.572,49	9.473,41	4.179,13	25.374,49	113.956,19
Março				10.849,03	37.315,16	35.809,98	13.479,41	4.945,04	29.345,45	131.744,07
Abril				9.558,52	32.960,94	31.331,80	11.960,68	4.292,00	26.039,57	116.143,51
Maio				11.017,62	38.664,73	36.553,08	6.981,74	4.631,19	30.171,30	128.019,66
Junho				10.620,58	37.316,00	34.965,52	13.536,85	4.295,90	29.101,32	129.836,17
Julho										-
Agosto										-
Setembro										-
Outubro										-
Novembro										-
Dezembro										-
Total	0,00	0,00		58.241,03	220.282,87	206.889,57	65.037,49	26.698,87	167.771,17	744.921,00

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	Patrimônio Médio	% Debitado
Janeiro	125.221,40	34.698,26	2.044,54	24.983,62	-	-	-	-	186.947,82	1.066.818.690,79	0,21%
Fevereiro	113.956,19	31.944,02	1.604,88	25.082,05	-	-	3.526,00	-	176.113,14	1.072.412.371,39	0,20%
Março	131.744,07	36.602,46	1.367,12	25.291,95	-	24.744,00	-	-	219.749,60	1.085.791.660,15	0,24%
Abril	116.143,51	32.294,20	1.976,38	26.297,78	-	-	3.336,00	-	180.047,87	1.085.879.645,51	0,20%
Maio	128.019,66	37.311,90	1.463,71	26.000,10	120.799,45	-	-	-	313.594,82	1.096.349.939,86	0,34%
Junho	129.836,17	35.933,69	2.028,39	26.046,71	-	-	3.450,00	-	197.294,96	1.097.766.871,79	0,22%
Julho											
Agosto											
Setembro											
Outubro											
Novembro											
Dezembro											
Total	744.921,00	208.784,53	10.485,02	153.702,21	120.799,45	24.744,00	10.312,00	0,00	1.273.748,21	1.084.169.863	0,12%
										Até Junho/2022	0,23%

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

Mês	Taxa de Controladoria	Taxa Cálculo Risco	Extrato CBLC B3	Total
Janeiro	19.872,93	3.701,35	-	23.574,28
Fevereiro	18.252,78	3.701,35	-	21.954,13
Março	20.976,58	3.701,35	-	24.677,93
Abril	18.719,76	3.701,35	-	22.421,11
Maio	21.543,84	3.701,35	-	25.245,19
Junho	20.810,14	3.701,35	-	24.511,49
Julho	-	-	-	-
Agosto	-	-	-	-
Setembro	-	-	-	-
Outubro	-	-	-	-
Novembro	-	-	-	-
Dezembro	-	-	-	-
Total	120.176,03	22.208,10	0,00	142.384,13

Acompanhamento da gestão

Comentários:

As informações apresentadas anteriormente indicam que os investimentos dos planos estão aderentes à Resolução CMN nº 4.994/2022 e com a sua política de investimentos.



