

Relatório de Acompanhamento da Gestão Financeira 2º 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	2º Semestre/2022		1º Semestre/2022		Limite 4.994	Política de Investimentos	
	R\$	%	R\$	%		Mínimo	Máximo
Renda Fixa	997.243.518	85,8%	953.044.851	86,8%	100,0%	54%	100%
Renda Variável	73.273.826	6,3%	57.966.997	5,3%	70,0%	0%	25%
Investimentos Estruturados	84.194.903	7,2%	79.550.474	7,2%	20%	0%	13%
Investimento no Exterior	7.781.584	0,7%	7.242.918	0,7%	10%	0%	10%
Total	1.162.493.831	100%	1.097.805.240	100%			

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

Segmentos	2º Semestre/2022		1º Semestre/2022		Limite 4.994	Política de Investimentos	
	R\$	%	R\$	%		Mínimo	Máximo
Renda Fixa	989.899.284	85,7%	946.028.970	86,7%	100,0%	54%	100%
Renda Variável	73.273.826	6,3%	57.966.997	5,3%	70,0%	0%	25%
Investimentos Estruturados	84.194.903	7,3%	79.550.474	7,3%	20%	0%	13%
Investimento no Exterior	7.781.584	0,7%	7.242.918	0,7%	10%	0%	10%
Total	1.155.149.598	100%	1.090.789.359	100%			

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

Segmentos	2º Semestre/2022		1º Semestre/2022		Limite 4.994	Política de Investimentos	
	R\$	%	R\$	%		Mínimo	Máximo
Renda Fixa	7.344.233	100,0%	7.015.881	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	7.344.233	100%	7.015.881	100%			

Fontes: MB Prev e Intrag

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

Renda Fixa	Entidade	Plano de Aposentadoria	PGA
Fundos de Investimentos	996.435.226	989.090.550	7.344.676
Caixa (Administrado + Própria)	742.587	742.587	0
Total RF	997.177.813	989.833.137	7.344.676
Renda Variável	Entidade	Plano de Aposentadoria	PGA
Fundos de Investimentos	73.341.001	73.341.001	0
Total RV	73.341.001	73.341.001	0
Investimentos Estruturados	Entidade	Plano de Aposentadoria	PGA
Fundos de Investimentos	84.194.903	84.194.903	0
Total MM	84.194.903	84.194.903	0
Investimento no Exterior	Entidade	Plano de Aposentadoria	PGA
Fundos de Investimentos	7.781.584	7.781.584	0
Total IE	7.781.584	7.781.584	0
Total do DI	1.162.495.301	1.155.150.626	7.344.676

Fontes: MB Prev e Intrag

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

Segmentos	2º Semestre/2022	%	1º Semestre/2022	%
Renda Fixa	107.189.896	79,1%	113.377.742	83,0%
Renda Variável	19.136.118	14,1%	14.734.063	10,8%
Investimentos Estruturados	6.647.047	4,9%	6.159.510	4,5%
Investimento no Exterior	2.541.895	1,9%	2.365.937	1,7%
Total	135.514.956	100,0%	136.637.252	98,3%

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

Segmentos	2º Semestre/2022	%	1º Semestre/2022	%
Renda Fixa	627.711.469	88,3%	600.335.525	89,5%
Renda Variável	54.204.883	7,6%	43.308.227	6,5%
Investimentos Estruturados	24.068.437	3,4%	22.303.103	3,3%
Investimento no Exterior	5.239.689	0,7%	4.876.981	0,7%
Total	711.224.477	100,0%	670.823.837	99,3%

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

Segmentos	2º Semestre/2022	%	1º Semestre/2022	%
Renda Fixa	307.675.019	100,0%	290.305.241	100,0%
Renda Variável	-	0,0%	-	0,0%
Investimentos Estruturados	-	0,0%	-	0,0%
Investimento no Exterior	-	0,0%	-	0,0%
Total	307.675.019	100,0%	290.305.241	100,0%

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

Segmentos	2º Semestre/2022	%	1º Semestre/2022	%
Renda Fixa	7.341.904	100,0%	-	-
Renda Variável	-	0,0%	-	-
Investimentos Estruturados	-	0,0%	-	-
Investimento no Exterior	-	0,0%	-	-
Total	7.341.904	100,0%	0	0,0%

Fontes: MB Prev e Intrag

pps *portfolio
performance*

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

Segmentos	Alocação Atual	Política de Investimentos ¹		Resolução 4.994
		Mínimo	Máximo	
Renda Fixa	88,9%	54%	100%	100%
Renda Variável	6,3%	0%	25%	70%
Investimentos Estruturados	4,8%	0%	13%	20%
Investimento no Exterior	0,0%	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
Santander (MB III)	352.755.037	30,3%	30,3%
Bradesco (MB II)	328.662.820	28,3%	28,3%
Santander (MB IV)	183.169.269	15,8%	15,8%
Bradesco (MB I)	131.852.006	11,3%	11,3%
BNP (MB V)	36.368.010	3,1%	3,1%
Absolute (Absolute Vertex II F)	30.715.483	2,6%	2,6%
JGP (JGP Strategy Estruturado)	28.351.590	2,4%	2,4%
Gauss (Gauss FC FIM)	25.127.830	2,2%	2,2%
Arx Investimentos (Arx Incom)	13.240.985	1,1%	1,1%
Bahia AM (Bahia AM Valuator)	12.189.365	1,0%	1,0%
Moat Capital (Moat Capital FIC)	11.542.640	1,0%	1,0%
Schroder (Schroder Sust Ações)	7.781.584	0,7%	0,7%
Intrag	737.211	0,1%	0,1%
Total	1.162.493.831	100,0%	100,0%

Fontes: MB, Bradesco e Intrag

Enquadramento em Renda Fixa

Fontes: MB Prev, DI, Balancete e Intrag

Valores a Receber/Pagar		Total (R\$)	Carteira	Fundos	Entidade	Limite Res. 4.994	Política de Investimentos ¹		
							Min.	Máx.	Target
Total dos recursos garantidores		1.067.641.545	737.211	1.066.904.334	100,0%	-	-	-	-
Renda Fixa		997.133.554	737.211	996.396.343	93,4%	100%	85%	100%	-
Títulos Públicos		827.405.855	0	827.405.855	77,5%	100%	70%	100%	-
Títulos Privados		169.151.462	0	169.151.462	15,8%	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 Clas Abertas (exceto debênture)	0	0	0	0,0%	20%	-	-	-
	Títulos de Clas Securitizadoras	0	0	0	0,0%	20%	-	-	-
CDB, DEB, NC, DPGE, LF		169.151.462	0	169.151.462	15,8%	80%	-	30%	-
Termo de Renda Fixa		0	0	0	0,0%	-	-	-	-
Derivativos		0	0	0	0,0%	15%	0%	15%	-
Valores a Receber/Pagar		-200.023	-5.376	-194.647	0,0%	-	-	-	-
Caixa		776.260	742.587	33.672	0,1%	-	-	-	-

Enquadramento em Renda Variável

Valores a Receber/Pagar		Total (R\$)	Carteira	Fundos	Entidade	Limite Res. 4.994	Política de Investimentos ¹		
							Min.	Máx.	Target
Renda Variável		70.507.991	0	70.507.991	6,6%	70%	0%	15%	-
Ações		70.828.653	0	70.828.653	6,6%	70%	0%	15%	-
	Novo Mercado	51.149.208	0	51.149.208	4,8%	70%	-	-	-
	Nível 2	4.678.810	0	4.678.810	0,4%		-	-	-
	Nível 1	7.273.985	0	7.273.985	0,7%		-	-	-
	Bovespa Mais	1.210.499	0	1.210.499	0,1%	50%	-	-	-
	Sem Selo de Governança	6.516.150	0	6.516.150	0,6%		-	-	-
Fundos de Índice		0	0	0	0,0%	-	-	-	-
Outros Ativos		0	0	0	0,0%	3%	-	-	-
Valores a Receber/Pagar		-320.662	0	-320.662	0,0%	-	-	-	-

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	4.860.500	2,9%	-	0,0%	4.860.500	0,5%
Até 63	-	0,0%	17.860.957	2,2%	17.860.957	1,8%
Até 84	3.923.522	2,3%	-	0,0%	3.923.522	0,4%
Até 105	-	0,0%	-	0,0%	-	0,0%
Até 126	179.259	0,1%	-	0,0%	179.259	0,0%
Até 252	15.624.574	9,2%	212.072.125	25,6%	227.696.700	22,8%
Até 504	37.613.799	22,2%	12.775.465	1,5%	50.389.264	5,0%
Até 756	20.001.598	11,8%	104.840.782	12,6%	124.842.380	12,5%
Até 1008	20.901.530	12,4%	200.304.316	24,2%	221.205.846	22,2%
Acima de 1008	66.046.680	39,0%	281.243.868	33,9%	347.290.548	34,8%
Total	169.151.462	100,0%	829.097.513	100,0%	998.248.975	100,0%

Fonte: Intrag

Risco de crédito

Debêntures

CARACTERÍSTICAS DA EMISSÃO

Título	Carteira	Emitente	Valor	Rating	Agência	Vcto	Aquisição
DEB	MBPREV I	CELEO	109.154,84	brAAA	S&P	15/11/2023	20/12/2018
DEB	MBPREV I	ECORODOVIAS	818.642,78	AA(bra)	FITCH	15/04/2024	25/03/2022
DEB	MBPREV I	SUL AMÉRICA	925.928,66	A+(bra)	FITCH	08/11/2026	25/03/2022
DEB	MBPREV II	CELEO	397.808,76	brAAA	S&P	15/11/2023	20/12/2018
DEB	MBPREV III	ECORODOVIAS	284.877,54	AA(bra)	FITCH	13/07/2023	23/03/2021
DEB	MBPREV III	ECORODOVIAS	1.034.441,25	AA(bra)	FITCH	13/07/2023	26/11/2021
DEB	MBPREV III	COGNA EDUCAÇÃO	530.750,24	AA+(bra)	FITCH	15/08/2023	19/08/2022
DEB	MBPREV III	MOVIDA	1.036.728,74	brAA+	S&P	15/10/2023	04/04/2022
DEB	MBPREV III	LIGHT SERVIÇOS ELETR	309.998,05	brAA+	S&P	15/04/2024	26/04/2022
DEB	MBPREV III	ECOVIAS	357.368,54	brAAA	S&P	17/04/2024	22/03/2022
DEB	MBPREV III	COPEL GERAÇÃO E TRA	544.958,97	AA(bra)	FITCH	15/07/2024	30/01/2020
DEB	MBPREV III	COGNA EDUCAÇÃO	1.418.830,95	AA+(bra)	FITCH	20/08/2024	12/12/2022
DEB	MBPREV III	C&A MODAS	178.582,91	AA-(bra)	FITCH	20/05/2025	31/05/2021
DEB	MBPREV III	C&A MODAS	480.956,25	AA-(bra)	FITCH	20/05/2025	12/05/2022
DEB	MBPREV III	SBF COM PRODUTOS E	266.908,44	brA+	S&P	25/05/2025	09/06/2021
DEB	MBPREV III	COUNAS	1.421.277,72	brAA+	S&P	15/06/2025	08/06/2021
DEB	MBPREV III	ENERGISA PARAIBA	621.314,95	AAA(bra)	FITCH	25/08/2025	08/11/2021
DEB	MBPREV III	BCBF PARTICIPAÇÕES	432.673,22	AA+(bra)	FITCH	22/09/2025	28/09/2020
DEB	MBPREV III	CAGECE	106.623,11	AA-(bra)	FITCH	15/03/2026	07/04/2021
DEB	MBPREV III	SANTOS BRASIL PARTIC	616.930,82	brAAA	S&P	25/03/2026	04/11/2022
DEB	MBPREV III	ELETROBRAS	691.503,85	brAAA	S&P	15/04/2026	12/05/2021
DEB	MBPREV III	CELPE	1.768.037,60	brAAA	S&P	15/04/2026	03/12/2021
DEB	MBPREV III	ELETROBRAS	1.006.487,50	brAAA	S&P	15/04/2026	24/06/2022
DEB	MBPREV III	ELETROBRAS	1.333.176,78	brAAA	S&P	25/04/2026	17/05/2019
DEB	MBPREV III	VIA VAREJO	259.181,96	brAA	S&P	30/04/2026	10/05/2021
DEB	MBPREV III	BRF	1.009.677,10	AA+(bra)	FITCH	30/04/2026	23/06/2022
DEB	MBPREV III	PAGUE MENOS	265.029,88	AA-(bra)	FITCH	15/07/2026	15/07/2022
DEB	MBPREV III	AERIS	232.312,19	AA(bra)	FITCH	31/07/2026	16/08/2021
DEB	MBPREV III	SANEAGO	367.887,53	A+(bra)	FITCH	11/08/2026	25/08/2021

RATING ATUAL: Dezembro 2022

FITCH			MOODY'S			S&P		
Data	Rating	Class	Data	Rating	Class	Data	Rating	Class
-	-	-	-	-	-	-	brAAA	🟢
-	AA(bra)	🟢	-	-	-	-	-	-
-	A+(bra)	🟢	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	brAAA	🟢
-	AA(bra)	🟢	-	-	-	-	-	-
-	AA(bra)	🟢	-	-	-	-	-	-
-	AA+(bra)	🟢	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	brAA+	🟢
-	-	-	-	-	-	-	brAA+	🟢
-	-	-	-	-	-	-	brAAA	🟢
-	AA(bra)	🟢	-	-	-	-	-	-
-	AA+(bra)	🟢	-	-	-	-	-	-
-	AA-(bra)	🟢	-	-	-	-	-	-
-	AA-(bra)	🟢	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	brA+	🟢
-	-	-	-	-	-	-	brAA+	🟢
-	AAA(bra)	🟢	-	-	-	-	-	-
-	AA+(bra)	🟢	-	-	-	-	-	-
-	AA-(bra)	🟢	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	brAAA	🟢
-	-	-	-	-	-	-	brAAA	🟢
-	-	-	-	-	-	-	brAAA	🟢
-	-	-	-	-	-	-	brAAA	🟢
-	-	-	-	-	-	-	brAAA	🟢
-	-	-	-	-	-	-	brAA	🟢
-	AA+(bra)	🟢	-	-	-	-	-	-
-	AA-(bra)	🟢	-	-	-	-	-	-
-	AA(bra)	🟢	-	-	-	-	-	-
-	A+(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	CIA ESTADUAL DISTRIB	160.066,77	brAA+	S&P	15/08/2026	25/08/2021
DEB	MBPREV III	MRS LOGÍSTICA	657.067,65	AAA(bra)	FITCH	15/08/2026	22/09/2021
DEB	MBPREV III	COGNA EDUCAÇÃO	826.820,98	AA+(bra)	FITCH	20/08/2026	20/08/2021
DEB	MBPREV III	VAMOS	893.318,36	AA-(bra)	FITCH	20/08/2026	04/10/2021
DEB	MBPREV III	MOVIDA	892.053,30	AA-(bra)	FITCH	15/09/2026	20/09/2021
DEB	MBPREV III	COPASA	592.936,99	AAA.br	MOODY'S	15/09/2026	29/09/2021
DEB	MBPREV III	VIA	518.239,50	brAA	S&P	15/09/2026	29/09/2021
DEB	MBPREV III	MAGAZINE LUIZA	521.836,13	brAAA	S&P	15/10/2026	15/10/2021
DEB	MBPREV III	MINERVA	215.955,29	brAAA	S&P	15/10/2026	21/10/2021
DEB	MBPREV III	LIGHT SERVIÇOS ELETRI	1.092.185,99	brAAA	S&P	15/10/2026	10/11/2021
DEB	MBPREV III	COPEL GERAÇÃO E TRA	1.035.920,84	AAA(bra)	FITCH	15/10/2026	11/11/2021
DEB	MBPREV III	LIGHT SERVIÇOS ELETRI	499.865,59	brAA+	S&P	15/10/2026	04/07/2022
DEB	MBPREV III	ANHANGUERA BANDEI	1.057.985,55	AAA.br	MOODY'S	04/11/2026	09/11/2021
DEB	MBPREV III	ANHANGUERA BANDEI	2.059.586,21	AAA.br	MOODY'S	04/11/2026	21/02/2022
DEB	MBPREV III	PAGUE MENOS	192.386,46	A+(bra)	FITCH	05/11/2026	25/02/2022
DEB	MBPREV III	LOCAMERICA	1.677.856,79	brAAA	S&P	10/11/2026	08/12/2021
DEB	MBPREV III	EQUATORIAL	1.008.997,87	brAA+	S&P	15/12/2026	28/06/2022
DEB	MBPREV III	COUNAS	1.003.301,40	brAA+	S&P	15/12/2026	29/06/2022
DEB	MBPREV III	EQUATORIAL	503.991,90	brAA+	S&P	15/12/2026	04/07/2022
DEB	MBPREV III	LOCALIZA	127.102,11	AAA(bra)	FITCH	25/02/2027	11/03/2022
DEB	MBPREV III	AES TIETÊ	1.009.827,55	AA(bra)	FITCH	15/03/2027	30/06/2022
DEB	MBPREV III	BK BRASIL	302.788,50	AA(bra)	FITCH	24/04/2027	28/04/2022
DEB	MBPREV III	LOCAMERICA	461.891,19	brAAA	S&P	10/05/2027	13/05/2022
DEB	MBPREV III	GUARARAPES	2.066.689,53	A+(bra)	FITCH	10/05/2027	26/05/2022
DEB	MBPREV III	LOG COMMERCIAL	700.337,61	brAA+	S&P	11/07/2027	11/07/2022
DEB	MBPREV III	ROTA BANDEIRAS	1.004.551,38	AAA(bra)	FITCH	15/07/2027	04/07/2022
DEB	MBPREV III	SIMPAR	697.493,76	brAA+	S&P	15/07/2027	19/07/2022
DEB	MBPREV III	NATURA	657.584,56	brAAA	S&P	21/07/2027	25/07/2022
DEB	MBPREV III	CM HOSPITALAR	357.749,65	Aa.br	MOODY'S	22/07/2027	25/07/2022

RATING ATUAL: Dezembro 2022

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

Fontes: Intrag e Agências de Rating

LEGENDA I		LEGENDA II	
🟢	GRAU DE INVESTIMENTO	Estável	🟢
🟡	GRAU ESPECULATIVO	Upgrade	🟡
		Downgrade	🔴

pps portfolio performance

Risco de crédito

Debêntures																	
CARACTERÍSTICAS DA EMISSÃO									RATING ATUAL: Dezembro 2022								
Título	Carteira	Emitente	Valor	Rating	Agência	Vcto	Aquisição		FITCH			MOODY'S			S&P		
Data	Rating	Class	Data	Rating	Class	Data	Rating	Class									
DEB	MBPREV III	TUPY	259.584,13	brAAA	S&P	06/09/2027	06/09/2022		-	-	-	-	-	-	-	brAAA	🟢
DEB	MBPREV III	LM TRANSPORTE	520.506,69	brAA+	S&P	25/09/2027	29/09/2022		-	-	-	-	-	-	-	brAA+	🟢
DEB	MBPREV III	RUMO MALHA PAULIST	261.464,17	AAA(bra)	FITCH	15/10/2027	22/10/2021		-	AAA(bra)	🟢	-	-	-	-	-	-
DEB	MBPREV III	AMERICANAS	3.569.591,03	AA+(bra)	FITCH	20/10/2027	11/11/2022		-	AA+(bra)	🟢	-	-	-	-	-	-
DEB	MBPREV III	GUARARAPES	618.386,78	A+(bra)	FITCH	25/10/2027	31/10/2022		-	A+(bra)	🟢	-	-	-	-	-	-
DEB	MBPREV III	CM HOSPITALAR	613.872,78	Aa.br	MOODYS	27/10/2027	08/11/2022		-	-	-	-	Aa.br	🟢	-	-	-
DEB	MBPREV III	MARFRIG GLOBAL FOO	605.780,09	brAAA	S&P	11/11/2027	15/12/2022		-	-	-	-	-	-	-	brAAA	🟢
DEB	MBPREV III	SENDAS DISTRIBUIDOR	274.521,64	AAA(bra)	FITCH	26/11/2027	07/01/2022		-	AAA(bra)	🟢	-	-	-	-	-	-
DEB	MBPREV III	SENDAS DISTRIBUIDOR	453.113,78	AAA(bra)	FITCH	26/11/2027	08/07/2022		-	AAA(bra)	🟢	-	-	-	-	-	-
DEB	MBPREV III	SENDAS DISTRIBUIDOR	987.869,68	AAA(bra)	FITCH	26/11/2027	24/08/2022		-	AAA(bra)	🟢	-	-	-	-	-	-
DEB	MBPREV III	LOCAMERICA	1.979.712,96	brAAA	S&P	15/12/2027	12/08/2022		-	-	-	-	-	-	-	brAAA	🟢
DEB	MBPREV III	SABESP	1.377.290,72	brAAA	S&P	15/07/2028	16/07/2021		-	-	-	-	-	-	-	brAAA	🟢
DEB	MBPREV III	ALGAR	270.539,25	brAAA	S&P	15/07/2028	12/08/2021		-	-	-	-	-	-	-	brAAA	🟢
DEB	MBPREV III	RGE SUL DISTRIBUIDOR	647.208,25	AAA.br	MOODYS	27/09/2028	08/10/2021		-	-	-	-	AAA.br	🟢	-	-	-
DEB	MBPREV III	ENERGISA	316.262,16	AAA(bra)	FITCH	15/10/2028	29/10/2021		-	AAA(bra)	🟢	-	-	-	-	-	-
DEB	MBPREV III	CCR	949.861,08	brAAA	S&P	15/01/2029	14/02/2022		-	-	-	-	-	-	-	brAAA	🟢
DEB	MBPREV III	ALGAR	678.641,92	brAAA	S&P	15/01/2029	23/09/2022		-	-	-	-	-	-	-	brAAA	🟢
DEB	MBPREV III	RAIA DROGASIL	353.422,27	AAA(bra)	FITCH	25/01/2029	16/02/2022		-	AAA(bra)	🟢	-	-	-	-	-	-
DEB	MBPREV III	LOCALIZA	120.538,93	AAA(bra)	FITCH	25/02/2029	11/03/2022		-	AAA(bra)	🟢	-	-	-	-	-	-
DEB	MBPREV III	HAPVIDA	2.562.169,10	AAA(bra)	FITCH	10/05/2029	18/05/2022		-	AAA(bra)	🟢	-	-	-	-	-	-
DEB	MBPREV III	HAPVIDA	208.074,24	AAA(bra)	FITCH	10/05/2029	02/09/2022		-	AAA(bra)	🟢	-	-	-	-	-	-
DEB	MBPREV III	NOVA TRANSPORTAD	967.502,93	AAA(bra)	FITCH	13/09/2029	06/10/2022		-	AAA(bra)	🟢	-	-	-	-	-	-
DEB	MBPREV III	USIMINAS	1.418.326,26	brAAA	S&P	09/12/2029	12/12/2022		-	-	-	-	-	-	-	brAAA	🟢
DEB	MBPREV IV	NCF PARTICIPAÇÕES	147.952,98	AA+(bra)	FITCH	23/12/2023	23/12/2020		-	AA+(bra)	🟢	-	-	-	-	-	-
DEB	MBPREV IV	ELETROBRAS	137.345,50	brAAA	S&P	25/04/2024	20/10/2022		-	-	-	-	-	-	-	brAAA	🟢
DEB	MBPREV IV	ELETROBRAS	137.345,50	brAAA	S&P	25/04/2024	20/10/2022		-	-	-	-	-	-	-	brAAA	🟢
DEB	MBPREV IV	ELETROBRAS	137.345,50	brAAA	S&P	25/04/2024	20/10/2022		-	-	-	-	-	-	-	brAAA	🟢
DEB	MBPREV IV	ELETROBRAS	86.476,80	brAAA	S&P	25/04/2024	21/10/2022		-	-	-	-	-	-	-	brAAA	🟢
DEB	MBPREV IV	COPEL GERAÇÃO E TRA	127.157,09	AA(bra)	FITCH	15/07/2024	30/01/2020		-	AA(bra)	🟢	-	-	-	-	-	-

Fontes: Intrag e Agências de Rating

LEGENDA I

🟢	GRAU DE INVESTIMENTO
🟡	GRAU ESPECULATIVO

LEGENDA II

Estável	🟢
Upgrade	🟡
Downgrade	🔴

Risco de crédito

Debêntures								RATING ATUAL: Dezembro 2022								
CARACTERÍSTICAS DA EMISSÃO																
Título	Carteira	Emitente	Valor	Rating	Agência	Vcto	Aquisição	FITCH			MOODY'S			S&P		
								Data	Rating	Class	Data	Rating	Class	Data	Rating	Class
DEB	MBPREV IV	ELETROBRAS	634.604,33	brAAA	S&P	25/04/2026	17/05/2019	-	-	-	-	-	-	-	brAAA	AAA
DEB	MBPREV IV	B3	99.133,22	AAA.br	MOODY'S	24/05/2026	08/06/2022	-	-	-	-	AAA.br	AAA	-	-	-
DEB	MBPREV IV	B3	721.526,33	AAA.br	MOODY'S	24/05/2026	10/06/2022	-	-	-	-	AAA.br	AAA	-	-	-
DEB	MBPREV IV	B3	98.111,23	AAA.br	MOODY'S	24/05/2026	14/06/2022	-	-	-	-	AAA.br	AAA	-	-	-
DEB	MBPREV IV	B3	3.065,98	AAA.br	MOODY'S	24/05/2026	14/06/2022	-	-	-	-	AAA.br	AAA	-	-	-
DEB	MBPREV IV	FERROVIA CENTRO ATL	700.057,91	brAAA	S&P	20/06/2026	30/06/2022	-	-	-	-	-	-	-	brAAA	AAA
DEB	MBPREV IV	CIA ESTADUAL DISTRIB	111.304,71	brAA+	S&P	15/08/2026	25/08/2021	-	-	-	-	-	-	-	brAA+	AA+
DEB	MBPREV IV	LOCALIZA	532.139,15	AAA(bra)	FITCH	05/10/2026	19/10/2021	-	AAA(bra)	AAA	-	-	-	-	-	-
DEB	MBPREV IV	LOCALIZA	237.654,38	AAA(bra)	FITCH	05/10/2026	19/10/2022	-	AAA(bra)	AAA	-	-	-	-	-	-
DEB	MBPREV IV	MAGAZINE LUIZA	301.370,48	brAAA	S&P	15/10/2026	15/10/2021	-	-	-	-	-	-	-	brAAA	AAA
DEB	MBPREV IV	DASA	702.339,62	AAA(bra)	FITCH	30/10/2026	19/10/2022	-	AAA(bra)	AAA	-	-	-	-	-	-
DEB	MBPREV IV	DASA	149.324,41	AAA(bra)	FITCH	30/10/2026	20/10/2022	-	AAA(bra)	AAA	-	-	-	-	-	-
DEB	MBPREV IV	DASA	315.125,99	AAA(bra)	FITCH	30/10/2026	24/10/2022	-	AAA(bra)	AAA	-	-	-	-	-	-
DEB	MBPREV IV	ANHANGUERA BANDEI	477.733,78	AAA.br	MOODY'S	04/11/2026	09/11/2021	-	-	-	-	AAA.br	AAA	-	-	-
DEB	MBPREV IV	REDE O'DOR SÃO LUIZ	210.468,54	AAA(bra)	FITCH	20/12/2026	03/09/2021	-	AAA(bra)	AAA	-	-	-	-	-	-
DEB	MBPREV IV	ALIANÇA ENERGIA	898.448,52	AAA(bra)	FITCH	15/01/2027	01/02/2022	-	AAA(bra)	AAA	-	-	-	-	-	-
DEB	MBPREV IV	ARTERIS	444.459,13	brAA+	S&P	11/03/2027	24/03/2022	-	-	-	-	-	-	-	brAA+	AA+
DEB	MBPREV IV	COMPANHIA ESTADUA	1.787.791,62	AAA.br	MOODY'S	25/05/2027	08/06/2022	-	-	-	-	AAA.br	AAA	-	-	-
DEB	MBPREV IV	TELEFÔNICA	529.511,85	AAA.br	MOODY'S	12/07/2027	14/07/2022	-	-	-	-	AAA.br	AAA	-	-	-
DEB	MBPREV IV	B3	842.785,65	AAA.br	MOODY'S	05/08/2027	09/08/2022	-	-	-	-	AAA.br	AAA	-	-	-
DEB	MBPREV IV	NOVA TRANSPORTAD	767.484,60	AAA(bra)	FITCH	13/09/2027	06/10/2022	-	AAA(bra)	AAA	-	-	-	-	-	-
DEB	MBPREV IV	AMERICANAS	365.071,81	AA+(bra)	FITCH	20/10/2027	11/11/2022	-	AA+(bra)	AA+	-	-	-	-	-	-
DEB	MBPREV IV	SENDAS DISTRIBUIDOR	165.325,30	AAA(bra)	FITCH	26/11/2027	17/10/2022	-	AAA(bra)	AAA	-	-	-	-	-	-
DEB	MBPREV IV	SENDAS DISTRIBUIDOR	165.325,30	AAA(bra)	FITCH	26/11/2027	17/10/2022	-	AAA(bra)	AAA	-	-	-	-	-	-
DEB	MBPREV IV	SENDAS DISTRIBUIDOR	134.860,27	AAA(bra)	FITCH	20/05/2028	17/10/2022	-	AAA(bra)	AAA	-	-	-	-	-	-
DEB	MBPREV IV	SENDAS DISTRIBUIDOR	185.304,19	AAA(bra)	FITCH	20/05/2028	19/10/2022	-	AAA(bra)	AAA	-	-	-	-	-	-
DEB	MBPREV IV	HAPVIDA	319.251,17	AAA(bra)	FITCH	10/05/2029	18/05/2022	-	AAA(bra)	AAA	-	-	-	-	-	-

Fontes: Intrag e Agências de Rating

LEGENDA I		LEGENDA II	
Ⓜ	GRAU DE INVESTIMENTO	Estável	Ⓜ
ⓂⓂ	GRAU ESPECULATIVO	Upgrade	Ⓜ
		Downgrade	Ⓜ

pps
portfolio
performanceMBPrev
Realização de eventos
educacionais

Risco de crédito

Letras Financeiras								RATING ATUAL: Dezembro 2022								
CARACTERÍSTICAS DA EMISSÃO																
Título	Carteira	Emitente	Valor	Rating	Agência	Vcto	Aquisição	FITCH			MOODY'S			S&P		
								Data	Rating	Class	Data	Rating	Class	Data	Rating	Class
LF	MBPREV I	BANCO VOTORANTIM	1.923.426,65	AA-.br	MOODY'S	10/02/2023	09/11/2021	-	-	-	-	AA-.br	⊕	-	-	-
LF	MBPREV I	BANCO ALFA	479.860,42	AA(bra)	FITCH	09/03/2023	09/11/2021	-	AA(bra)	⊕	-	-	-	-	-	-
LF	MBPREV I	BANCO ALFA	59.982,55	AA(bra)	FITCH	09/03/2023	05/10/2022	-	AA(bra)	⊕	-	-	-	-	-	-
LF	MBPREV I	BANCO BNP PARIBAS	532.341,08	brAAA	S&P	30/05/2023	28/05/2021	-	-	-	-	-	-	-	brAAA	⊕
LF	MBPREV I	BANCO BNP PARIBAS	414.043,06	brAAA	S&P	30/05/2023	09/11/2021	-	-	-	-	-	-	-	brAAA	⊕
LF	MBPREV I	BANCO BNP PARIBAS	236.596,04	brAAA	S&P	30/05/2023	05/10/2022	-	-	-	-	-	-	-	brAAA	⊕
LF	MBPREV I	BANCO SANTANDER	469.996,77	AAA.br	MOODY'S	12/06/2023	05/10/2022	-	-	-	-	AAA.br	⊕	-	-	-
LF	MBPREV I	BANCO SAFRA	180.028,65	AA+.br	MOODY'S	22/09/2023	05/10/2022	-	-	-	-	AA+.br	⊕	-	-	-
LF	MBPREV I	BANCO SANTANDER	1.825.452,42	AAA.br	MOODY'S	11/12/2023	23/03/2022	-	-	-	-	AAA.br	⊕	-	-	-
LF	MBPREV I	BANCO VOTORANTIM	2.974.146,27	AA-.br	MOODY'S	03/01/2024	05/10/2022	-	-	-	-	AA-.br	⊕	-	-	-
LF	MBPREV I	BANCO VOTORANTIM	943.221,64	AA-.br	MOODY'S	04/03/2024	30/08/2021	-	-	-	-	AA-.br	⊕	-	-	-
LF	MBPREV I	BANCO VOTORANTIM	117.902,70	AA-.br	MOODY'S	04/03/2024	05/10/2022	-	-	-	-	AA-.br	⊕	-	-	-
LF	MBPREV I	BANCO SAFRA	180.883,69	AA+.br	MOODY'S	22/03/2024	05/10/2022	-	-	-	-	AA+.br	⊕	-	-	-
LF	MBPREV I	BANCO SAFRA	2.652.960,81	AA+.br	MOODY'S	22/03/2024	05/10/2022	-	-	-	-	AA+.br	⊕	-	-	-
LF	MBPREV I	BANCO SAFRA	60.028,52	AA+.br	MOODY'S	06/05/2024	05/10/2022	-	-	-	-	AA+.br	⊕	-	-	-
LF	MBPREV I	BANCO VOTORANTIM	450.334,29	AA-.br	MOODY'S	20/05/2024	18/02/2022	-	-	-	-	AA-.br	⊕	-	-	-
LF	MBPREV I	BANCO VOTORANTIM	2.927.172,89	AA-.br	MOODY'S	20/05/2024	05/10/2022	-	-	-	-	AA-.br	⊕	-	-	-
LF	MBPREV I	BANCO SANTANDER	767.007,51	AAA.br	MOODY'S	27/05/2024	23/03/2022	-	-	-	-	AAA.br	⊕	-	-	-
LF	MBPREV I	BANCO SANTANDER	413.004,04	AAA.br	MOODY'S	27/05/2024	05/10/2022	-	-	-	-	AAA.br	⊕	-	-	-
LF	MBPREV I	BANCO ALFA	855.545,80	AA(bra)	FITCH	13/12/2024	14/12/2022	-	AA(bra)	⊕	-	-	-	-	-	-
LF	MBPREV I	BANCO SAFRA	734.510,60	AA+.br	MOODY'S	07/02/2025	07/02/2022	-	-	-	-	AA+.br	⊕	-	-	-
LF	MBPREV I	BANCO SAFRA	4.576.566,06	AA+.br	MOODY'S	07/02/2025	05/10/2022	-	-	-	-	AA+.br	⊕	-	-	-
LF	MBPREV I	BANCO SAFRA	670.288,99	AA+.br	MOODY'S	17/03/2025	17/03/2022	-	-	-	-	AA+.br	⊕	-	-	-
LF	MBPREV II	BANCO SAFRA	2.456.219,76	AA+.br	MOODY'S	30/01/2023	17/11/2021	-	-	-	-	AA+.br	⊕	-	-	-
LF	MBPREV II	BANCO VOTORANTIM	480.856,66	AA-.br	MOODY'S	10/02/2023	11/01/2022	-	-	-	-	AA-.br	⊕	-	-	-
LF	MBPREV II	BANCO ABC	1.255.637,69	AA.br	MOODY'S	22/03/2023	17/11/2021	-	-	-	-	AA.br	⊕	-	-	-
LF	MBPREV II	BANCO VOTORANTIM	179.258,99	AA-.br	MOODY'S	28/04/2023	11/01/2022	-	-	-	-	AA-.br	⊕	-	-	-
LF	MBPREV II	BANCO BNP PARIBAS	2.602.556,40	brAAA	S&P	30/05/2023	28/05/2021	-	-	-	-	-	-	-	brAAA	⊕
LF	MBPREV II	BANCO BNP PARIBAS	118.298,02	brAAA	S&P	30/05/2023	11/01/2022	-	-	-	-	-	-	-	brAAA	⊕

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	646.245,55	AAA.br	MOODY'S	12/06/2023	11/01/2022
LF	MBPREV II	BANCO CITIBANK	296.012,22	AAA(bra)	FITCH	10/07/2023	12/01/2022
LF	MBPREV II	BANCO SAFRA	1.140.181,45	AA+.br	MOODY'S	22/09/2023	17/11/2021
LF	MBPREV II	BANCO SANTANDER	1.648.795,73	AAA.br	MOODY'S	11/12/2023	15/12/2021
LF	MBPREV II	BANCO SANTANDER	647.741,18	AAA.br	MOODY'S	11/12/2023	11/01/2022
LF	MBPREV II	BANCO VOTORANTIM	237.931,70	AA-.br	MOODY'S	03/01/2024	12/01/2022
LF	MBPREV II	BANCO VOTORANTIM	3.183.373,03	AA-.br	MOODY'S	04/03/2024	30/08/2021
LF	MBPREV II	BANCO VOTORANTIM	117.902,70	AA-.br	MOODY'S	04/03/2024	12/01/2022
LF	MBPREV II	BANCO SAFRA	1.145.596,71	AA+.br	MOODY'S	22/03/2024	17/11/2021
LF	MBPREV II	BANCO SAFRA	120.057,04	AA+.br	MOODY'S	06/05/2024	17/11/2021
LF	MBPREV II	BANCO VOTORANTIM	1.519.878,23	AA-.br	MOODY'S	20/05/2024	18/02/2022
LF	MBPREV II	BANCO SANTANDER	236.002,31	AAA.br	MOODY'S	27/05/2024	11/01/2022
LF	MBPREV II	BANCO ALFA	239.921,23	AA(bra)	FITCH	22/07/2024	12/01/2022
LF	MBPREV II	BANCO ALFA	4.076.424,13	AA(bra)	FITCH	13/12/2024	14/12/2022
LF	MBPREV II	BANCO SAFRA	2.429.535,07	AA+.br	MOODY'S	07/02/2025	07/02/2022
LF	MBPREV II	BANCO SAFRA	1.675.722,47	AA+.br	MOODY'S	17/03/2025	17/03/2022
LF	MBPREV III	BANCO SAFRA	7.413.203,42	AA+.br	MOODY'S	14/04/2025	14/04/2022
LF	MBPREV IV	BANCO ABC	418.527,42	AA.br	MOODY'S	15/03/2023	28/10/2022
LF	MBPREV IV	BANCO VOTORANTIM	1.709.514,79	AA-.br	MOODY'S	24/03/2023	04/05/2022
LF	MBPREV IV	BANCO VOTORANTIM	419.889,94	AA-.br	MOODY'S	12/06/2023	29/11/2021
LF	MBPREV IV	BANCO CITIBANK	1.243.251,31	AAA(bra)	FITCH	10/07/2023	29/09/2021
LF	MBPREV IV	BANCO SAFRA	1.177.520,26	AA+.br	MOODY'S	21/07/2023	06/10/2022
LF	MBPREV IV	BANCO BRADESCO	2.794.047,01	AA+.br	MOODY'S	28/08/2023	26/08/2021
LF	MBPREV IV	BANCO SAFRA	466.935,80	AA+.br	MOODY'S	11/09/2023	19/10/2022
LF	MBPREV IV	BANCO ABC	1.338.100,94	AA.br	MOODY'S	28/09/2023	28/09/2021
LF	MBPREV IV	BANCO SAFRA	1.221.963,61	AA+.br	MOODY'S	02/10/2023	29/09/2021
LF	MBPREV IV	BANCO BRADESCO	355.441,53	AA+.br	MOODY'S	09/10/2023	08/04/2021
LF	MBPREV IV	BANCO ALFA	480.749,79	AA(bra)	FITCH	28/11/2023	28/05/2021
LF	MBPREV IV	BANCO SAFRA	704.067,76	AA+.br	MOODY'S	04/01/2024	31/08/2021

RATING ATUAL: Dezembro 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(bra)	😊	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	AA+.br	😊	-	-	-
-	-	-	-	AA+.br	😊	-	-	-
-	-	-	-	AA+.br	😊	-	-	-
-	-	-	-	AA.br	😊	-	-	-
-	-	-	-	AA-.br	😊	-	-	-
-	-	-	-	AA-.br	😊	-	-	-
-	AAA(bra)	😊	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	AA+.br	😊	-	-	-
-	-	-	-	AA+.br	😊	-	-	-
-	-	-	-	AA+.br	😊	-	-	-
-	-	-	-	AA.br	😊	-	-	-
-	-	-	-	AA+.br	😊	-	-	-
-	-	-	-	AA+.br	😊	-	-	-
-	AA(bra)	😊	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	AA+.br	😊	-	-	-

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 IV	BANCO ITAÚ	1.912.866,80	AA+.br	MOODY'S	01/02/2024	26/01/2022
LF	MBPREV IV	BANCO ALFA	1.727.732,75	AA(bra)	FITCH	11/03/2024	11/03/2022
LF	MBPREV IV	BANCO ITAÚ	1.914.792,42	AA+.br	MOODY'S	01/04/2024	21/01/2022
LF	MBPREV IV	BANCO ITAÚ	6.638.791,64	AA+.br	MOODY'S	01/04/2024	24/03/2022
LF	MBPREV IV	BANCO ITAÚ	163.806,71	AA+.br	MOODY'S	27/05/2024	08/11/2022
LF	MBPREV IV	BANCO ITAÚ	112.530,30	AA+.br	MOODY'S	02/09/2024	30/09/2022
LF	MBPREV IV	BANCO ITAÚ	104.718,12	AA+.br	MOODY'S	02/09/2024	30/09/2022
LF	MBPREV IV	BANCO HSBC	4.349.520,18	brAAA	S&P	04/10/2024	30/09/2022
LF	MBPREV IV	BANCO VOTORANTIM	874.239,39	AA-.br	MOODY'S	21/10/2024	19/10/2022
LF	MBPREV IV	BANCO VOTORANTIM	820.555,11	AA-.br	MOODY'S	25/10/2024	26/10/2022
LF	MBPREV IV	BANCO BRADESCO	2.753.695,76	AA+.br	MOODY'S	11/11/2027	11/11/2022

RATING ATUAL: Dezembro 2022

FITCH			MOODY'S			S&P		
Data	Rating	Class	Data	Rating	Class	Data	Rating	Class
-	-	-	-	AA+.br	🟢	-	-	-
-	AA(bra)	🟢	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	AA+.br	🟢	-	-	-
-	-	-	-	AA+.br	🟢	-	-	-
-	-	-	-	AA+.br	🟢	-	-	-
-	-	-	-	AA+.br	🟢	-	-	-
-	-	-	-	AA+.br	🟢	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	brAAA	🟢
-	-	-	-	AA-.br	🟢	-	-	-
-	-	-	-	AA-.br	🟢	-	-	-
-	-	-	-	AA+.br	🟢	-	-	-

Fontes: Intrag e Agências de Rating

LEGENDA I		LEGENDA II	
🟢	GRAU DE INVESTIMENTO	Estável	🟢
🟡	GRAU ESPECULATIVO	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	2.823.710,57	brAAA	S&P	31/07/2023	16/05/2022

RATING ATUAL: Dezembro 2022

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

Fontes: Intrag e Agências de Rating

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

Tesouro Federal

EMISSION	VLR LÍQUIDO	%TPF	%RF	%TOTAL
LFT	632.855.044	76,5%	61,2%	54,4%
LTN	3.844.312	0,5%	0,4%	0,3%
NTN-B	190.706.498	23,0%	18,5%	16,4%
NTN-F	0	0,0%	0,0%	0,0%
TOTAL	827.405.855	100,0%	80,1%	71,2%

Fontes: Intrag

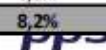
Risco de crédito

EMISSION	Valor	%CP	%RF	%TOTAL
DEBÊNTURE SIMPLES	74.311.880	43,9%	7,5%	6,4%
LETRA FINANCEIRA	92.015.871	54,4%	9,2%	7,9%
CERTIFICADO DE DEPÓSITO BANCÁRIO	2.823.711	1,7%	0,3%	0,2%
LETRAS COMERCIAIS	-	0,0%	0,0%	0,0%
TOTAL	169.151.462	100,0%	17,0%	14,6%

EMISSION	Valor	% NÃO FINANCEIRO	%CP	%RF	%TOTAL
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	4.164.286	5,6%	2,5%	0,4%	0,4%
COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	4.119.461	5,5%	2,4%	0,4%	0,4%
AMERICANAS S.A.	3.934.663	5,3%	2,3%	0,4%	0,3%
CONCESSIONARIA SISTEMA ANHANGUERA BANDEIRANTES S/A	3.595.306	4,8%	2,1%	0,4%	0,3%
HAPVIDA PARTICIPAÇÕES INVESTIMENTO SA	3.089.494	4,2%	1,8%	0,3%	0,3%
COGNA EDUCAÇÃO S.A.	2.776.402	3,7%	1,6%	0,3%	0,2%
GUARARAPES CONFECCOES SA (EX CONFECCOES GUARARAPES SA)	2.685.076	3,6%	1,6%	0,3%	0,2%
RODOVIAS COLINAS SA	2.424.579	3,3%	1,4%	0,2%	0,2%
SENDAS DISTRIBUIDORA S.A.	2.366.320	3,2%	1,4%	0,2%	0,2%
ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	2.137.960	2,9%	1,3%	0,2%	0,2%
OUTROS	43.018.333	57,9%	25,4%	4,3%	3,7%
TOTAL	74.311.880	100,0%	43,9%	7,5%	6,4%

EMISSION	Valor	% FINANCEIRO	%CP	%RF	%TOTAL
BCO SAFRA SA	29.006.255	30,6%	17,1%	2,9%	2,5%
BANCO VOTORANTIM S.A.	14.765.794	15,6%	8,7%	1,5%	1,3%
BANCO ITAU S/A	10.847.506	11,4%	6,4%	1,1%	0,9%
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	7.920.214	8,4%	4,7%	0,8%	0,7%
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S A	6.727.543	7,1%	4,0%	0,7%	0,6%
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	6.654.240	7,0%	3,9%	0,7%	0,6%
BRABESCO TERCEIROS	5.903.184	6,2%	3,5%	0,6%	0,5%
BANCO HSBC SA	4.349.520	4,6%	2,6%	0,4%	0,4%
BCO VOTORANTIM SA	4.113.795	4,3%	2,4%	0,4%	0,4%
BCO ABC BRASIL SA	3.012.266	3,2%	1,8%	0,3%	0,3%
BCO CITIBANK SA	1.539.264	1,6%	0,9%	0,2%	0,1%
TOTAL	94.839.582	100,0%	56,1%	9,5%	8,2%

Fontes: Intrag


 portfolio
performance

Os Maiores Emissores de Renda Variável

EMPRESA	R\$	%RV	%TOTAL
VALE SA	9.784.279	13,8%	0,8%
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	4.796.409	6,8%	0,4%
BRADESCO TERCEIROS	3.464.191	4,9%	0,3%
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	3.463.282	4,9%	0,3%
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	2.635.060	3,7%	0,2%
LOJAS RENNER SA	2.265.154	3,2%	0,2%
BBSA	2.056.560	2,9%	0,2%
ITAUSA SA	2.039.895	2,9%	0,2%
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO	1.837.038	2,6%	0,2%
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	1.759.601	2,5%	0,2%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	70.828.653	100,0%	6,1%

Fontes: Intrag

Os Maiores Emissores Instituições Financeiras

EMPRESA	R\$	% Inst. Financ.	%TOTAL
BCO SAFRA SA	29.006.255	27,6%	2,5%
BANCO VOTORANTIM S.A.	14.765.794	14,1%	1,3%
BANCO ITAU S/A	10.847.506	10,3%	0,9%
BRDESCO TERCEIROS	9.367.376	8,9%	0,8%
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	7.920.214	7,5%	0,7%
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	6.823.887	6,5%	0,6%
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S A	6.727.543	6,4%	0,6%
BANCO HSBC SA	4.349.520	4,1%	0,4%
BCO VOTORANTIM SA	4.113.795	3,9%	0,4%
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	3.463.282	3,3%	0,3%
TOTAL INST. FINANCEIRAS	104.975.435	100,0%	9,0%

Fontes: Intrag

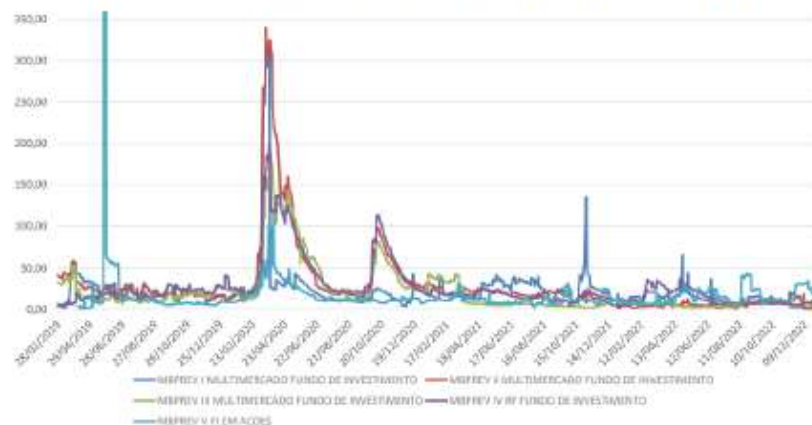
Rentabilidade dos Investimentos

MB Prev / Benchmarks	Retorno dos Investimentos*						
	3º Tri/22	4º Tri/22	2º Sem/22	1º Tri/22	2º Tri/22	1º Sem/22	12 Meses
Perfil Conservador							
MB Prev	3,36%	3,21%	6,68%	2,63%	2,88%	5,59%	12,64%
Benchmark: IMA-S	3,38%	3,23%	6,71%	2,68%	2,89%	5,65%	12,74%
Perfil Moderado							
MB Prev	4,19%	2,25%	6,54%	2,83%	1,11%	3,97%	10,77%
Benchmark: 82,5% (CDI + 1,5% a.a.) + 8,5% IBX + 7% IHFA + 2% MSCI ACWI	4,25%	3,17%	7,56%	3,55%	1,04%	4,62%	12,53%
Perfil Agressivo							
MB Prev	4,59%	1,73%	6,40%	2,59%	-0,07%	2,52%	9,08%
Benchmark: 70% (CDI + 1,5% a.a.) + 15% IBX + 10% IHFA + 5% MSCI ACWI	4,52%	3,01%	7,67%	3,67%	-0,79%	2,86%	10,75%
Total							
Meta Atuarial: (INPC + 2,51% a.a.) até 2021, a partir de 2022 (INPC + 2,70% a.a.)	-0,57%	2,23%	1,65%	4,11%	2,81%	7,03%	8,79%

Rentabilidade da Cota Contábil

MB Prev / Benchmarks	Retorno dos Investimentos*						
	3º Tri/22	4º Tri/22	2º Sem/22	1º Tri/22	2º Tri/22	1º Sem/22	12 Meses
Perfil Conservador							
MB Prev	3,38%	3,22%	6,71%	2,58%	2,88%	5,54%	12,63%
Benchmark: IMA-S	3,38%	3,23%	6,71%	2,68%	2,89%	5,65%	12,74%
Perfil Moderado							
MB Prev	4,21%	2,26%	6,57%	2,87%	1,13%	4,03%	10,86%
Benchmark: 77% IMA-S + 13% IMA-B + 10% IbrX-100	4,20%	3,15%	7,46%	3,87%	0,92%	4,82%	12,66%
Perfil Agressivo							
MB Prev	4,60%	1,75%	6,43%	2,60%	-0,06%	2,54%	9,13%
Benchmark: 68% IMA-S + 12% IMA-B + 20% IbrX-100	4,43%	2,99%	7,55%	4,48%	-1,15%	3,28%	11,08%
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%

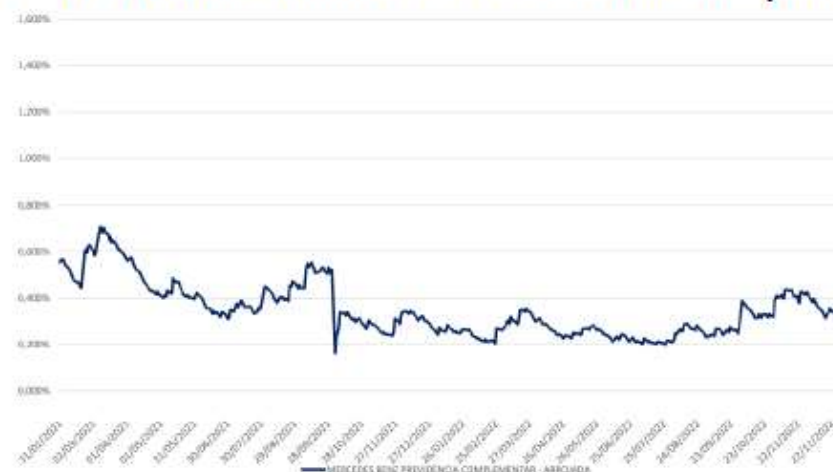
Consumo do Limite de Risco do Mercado



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

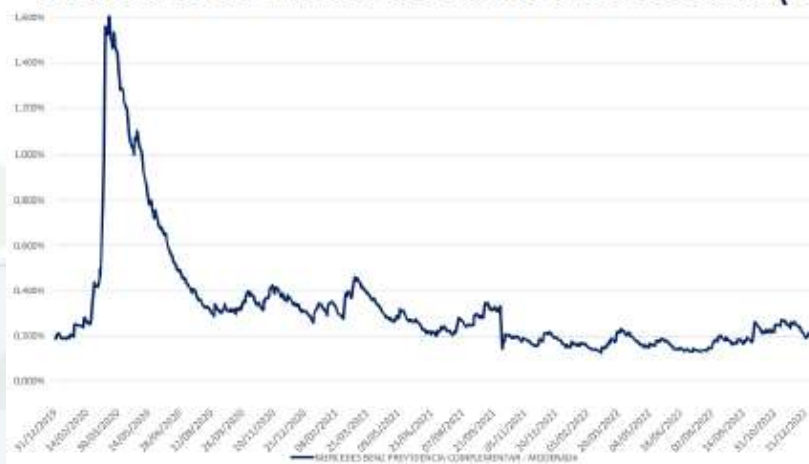
Consumo do Limite de Risco do Mercado (Consolidada) – Perfil Arrojado



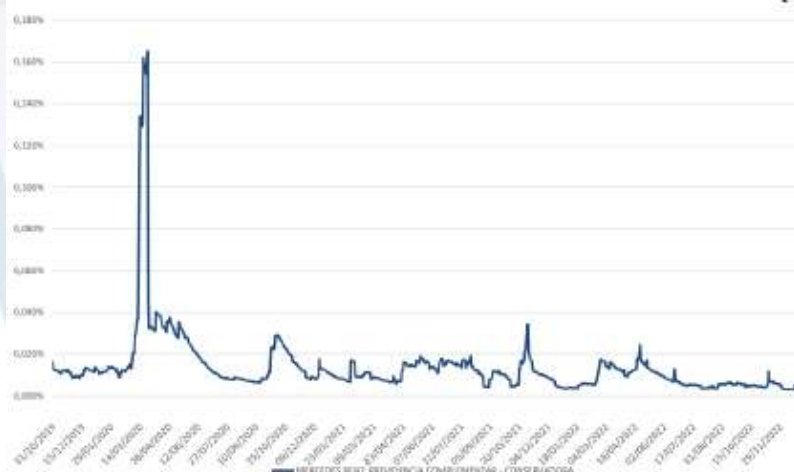
Obs.: o limite de VaR praticado é de 0,7% ao dia

Fonte: Intrag

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



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



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				10.580,50	37.766,70	35.194,08	13.742,26	4.063,73	29.351,84	130.699,11
Agosto				11.585,07	41.923,12	38.873,23	15.233,78	4.930,32	32.330,15	144.875,67
Setembro				10.584,92	38.786,50	35.824,13	14.104,06	4.530,93	29.955,50	133.786,04
Outubro				10.175,39	37.118,04	34.429,69	13.647,79	4.491,64	28.858,44	128.720,99
Novembro				10.594,12	36.093,47	33.857,97	14.270,79	4.682,57	28.766,85	128.265,77
Dezembro				11.608,03	39.953,29	37.572,42	15.895,53	5.279,54	31.733,16	142.041,97
Total	0,00	0,00		123.369,06	451.923,99	422.641,09	151.931,70	54.677,60	348.767,11	1.553.310,55

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

Taxa de Custódia	Taxas bancárias	Despesas B3	Taxa de Fiscalização CVM	Auditoria	Despesas ANBID	Despesas com Cartório	Total	Patrimônio Médio	% Debitado
34.698,26	2.044,54	24.983,62	-	-	-	-	186.947,82	1.066.818.690,79	0,21%
31.944,02	1.604,88	25.082,05	-	-	3.526,00	-	176.113,14	1.072.412.371,39	0,20%
36.602,46	1.367,12	25.291,95	-	24.744,00	-	-	219.749,60	1.085.791.660,15	0,24%
32.294,20	1.976,38	26.297,78	-	-	3.336,00	-	180.047,87	1.085.879.645,51	0,20%
37.311,90	1.463,71	26.000,10	120.799,45	-	-	-	313.594,82	1.096.349.939,86	0,34%
35.933,69	2.028,39	26.046,71	-	-	3.450,00	-	197.294,96	1.097.766.871,79	0,22%
35.933,69	1.857,50	25.035,17	-	-	-	-	193.525,47	1.110.770.522,56	0,21%
39.975,59	1.783,20	28.344,49	-	-	3.640,00	-	218.618,95	1.127.489.509,05	0,23%
37.050,95	1.835,21	25.027,55	-	-	-	-	197.699,75	1.139.226.635,04	0,21%
35.740,85	1.671,75	25.554,22	-	-	3.640,00	-	195.327,81	1.153.125.483,16	0,20%
35.750,73	1.656,89	26.314,26	-	-	-	-	191.987,65	1.154.878.201,47	0,20%
39.216,45	884,17	26.010,34	-	28.748,00	3.640,00	-	240.540,93	1.160.336.504,76	0,25%
432.452,79	20.173,74	309.988,24	120.799,45	53.492,00	21.232,00	0,00	2.511.448,77	1.112.570.503	0,23%
								Até Dezembro/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	20.982,61	3.701,35	-	24.683,96
Agosto	23.026,42	3.701,35	-	26.727,77
Setembro	21.397,40	3.701,35	-	25.098,75
Outubro	20.644,28	3.701,35	-	24.345,63
Novembro	20.568,01	3.701,35	-	24.269,36
Dezembro	22.615,34	3.701,35	-	26.316,69
Total	249.410,09	44.416,20	0,00	293.826,29

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.