

Relatório de Acompanhamento da Gestão Financeira 2º SEMESTRE DE 2023



Elaborado e apresentado pela PPS

Mensalmente o Conselho Fiscal recebe o Relatório de Investimentos

➤ 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/2023		1º Semestre/2023		Limite 4.994	Política de Investimentos	
	R\$	%	R\$	%		Mínimo	Máximo
Renda Fixa	1.092.318.363	85,6%	1.055.623.587	86,4%	100,0%	54%	100%
Renda Variável	83.467.039	6,5%	70.851.533	5,8%	70,0%	0%	25%
Investimentos Estruturados	90.782.263	7,1%	87.179.166	7,1%	20%	0%	15%
Investimento no Exterior	8.787.925	0,7%	8.037.444	0,7%	10%	0%	10%
Total	1.275.355.590	100%	1.221.691.730	100%			

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

Segmentos	2º Semestre/2023		1º Semestre/2023		Limite 4.994	Política de Investimentos	
	R\$	%	R\$	%		Mínimo	Máximo
Renda Fixa	1.086.416.816	85,6%	1.049.101.676	86,3%	100,0%	54%	100%
Renda Variável	83.467.039	6,6%	70.851.533	5,8%	70,0%	0%	25%
Investimentos Estruturados	90.782.263	7,2%	87.179.166	7,2%	20%	0%	15%
Investimento no Exterior	8.787.925	0,7%	8.037.444	0,7%	10%	0%	10%
Total	1.269.454.043	100%	1.215.169.819	100%			

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

Segmentos	2º Semestre/2023		1º Semestre/2023		Limite 4.994	Política de Investimentos	
	R\$	%	R\$	%		Mínimo	Máximo
Renda Fixa	5.901.547	100,0%	6.521.911	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	5.901.547	100%	6.521.911	100%			

Fontes: MB Prev e Intrag

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

Renda Fixa	Entidade	Plano de Aposentadoria	PGA
Fundos de Investimentos	1.091.841.933	1.085.990.353	5.851.579
Caixa (Administrado + Própria)	410.631	359.008	51.624
Total RF	1.092.252.564	1.086.349.361	5.903.203
Renda Variável	Entidade	Plano de Aposentadoria	PGA
Fundos de Investimentos	83.535.932	83.535.932	0
Total RV	83.535.932	83.535.932	0
Investimentos Estruturados	Entidade	Plano de Aposentadoria	PGA
Fundos de Investimentos	90.782.263	90.782.263	0
Total MM	90.782.263	90.782.263	0
Investimento no Exterior	Entidade	Plano de Aposentadoria	PGA
Fundos de Investimentos	8.787.925	8.787.925	0
Total IE	8.787.925	8.787.925	0
Total do DI	1.275.358.685	1.269.455.481	5.903.203

Fontes: MB Prev e Intrag

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

Segmentos	2º Semestre/2023	%	1º Semestre/2023	%
Renda Fixa	75.228.747	66,0%	81.384.979	69,6%
Renda Variável	18.969.843	16,7%	16.903.682	14,4%
Investimentos Estruturados	16.831.957	14,8%	16.071.934	13,7%
Investimento no Exterior	2.870.622	2,5%	2.625.473	2,2%
Total	113.901.168	100,0%	116.986.069	97,8%

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

Segmentos	2º Semestre/2023	%	1º Semestre/2023	%
Renda Fixa	587.764.361	85,7%	531.105.016	79,8%
Renda Variável	70.483.393	10,3%	57.516.378	8,6%
Investimentos Estruturados	27.494.602	4,0%	71.107.232	10,7%
Investimento no Exterior	-	0,0%	5.411.971	0,8%
Total	685.742.356	100,0%	665.140.597	99,2%

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

Segmentos	2º Semestre/2023	%	1º Semestre/2023	%
Renda Fixa	469.461.380	100,0%	433.012.437	100,0%
Renda Variável	-	0,0%	-	0,0%
Investimentos Estruturados	-	0,0%	-	0,0%
Investimento no Exterior	-	0,0%	-	0,0%
Total	469.461.380	100,0%	433.012.437	100,0%

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

Segmentos	2º Semestre/2023	%	1º Semestre/2023	%
Renda Fixa	5.850.188	100,0%	6.448.559	100,0%
Renda Variável	-	0,0%	-	-
Investimentos Estruturados	-	0,0%	-	-
Investimento no Exterior	-	0,0%	-	-
Total	5.850.188	100,0%	6.448.559	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	85,6%	54%	100%	100%
Renda Variável	6,5%	0%	25%	70%
Investimentos Estruturados	7,1%	0%	15%	20%
Investimento no Exterior	0,7%	0%	10%	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
Bradesco (MB II)	367.646.088	28,8%	28,8%
Santander (MB IV)	256.529.340	20,1%	20,1%
Western (MB III)	248.887.603	19,5%	19,5%
Bradesco (MB I)	218.780.844	17,2%	17,2%
BNP (MB V)	42.162.199	3,3%	3,3%
Absolute (Absolute Vertex II FC	35.087.862	2,8%	2,8%
JGP (JGP Strategy Estruturado FC	29.981.846	2,4%	2,4%
Gauss (Gauss FC FIM)	25.712.555	2,0%	2,0%
Arx Investimentos (Arx Income F	14.720.028	1,2%	1,2%
Moat Capital (Moat Capital FIC FI	13.382.606	1,0%	1,0%
Bahia AM (Bahia AM Valuation F	13.291.977	1,0%	1,0%
Schroder (Schroder Sust Ações G	8.787.925	0,7%	0,7%
Intrag	405.594	0,0%	0,0%
Total	1.275.376.468	100,0%	100,0%

Fontes: MB Prev e Intrag

Enquadramento

Fontes: MB Prev, DI, Balancete e Intrag

Valores a Receber/Pagar		Total (R\$)	Carteira	Fundos	Entidade	Limite Res. 4.994	Política de Investimentos ¹	
							Mín.	Máx.
Total dos recursos garantidores		1.275.355.590	405.594	1.274.949.996	100,0%	-	-	-
Renda Fixa		1.095.163.470	405.594	1.094.757.875	85,9%	100%	54%	100%
Títulos Públicos		952.012.839	0	952.012.839	74,6%	100%	54%	100%
Títulos Privados		141.285.868	0	141.285.868	11,1%	80%	0%	30%
	CCB, CCB 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%	-	-
	Tít. De Cias Abertas (exceto debêntu	0	0	0	0,0%	20%	-	-
	Títulos de Cias Securitizadoras	0	0	0	0,0%	20%	-	-
	CDB, DEB, NC, DPGE, LF	141.285.868	0	141.285.868	11,1%	80%	0%	30%
Derivativos		25.580	0	25.580	0,0%	-	-	-
Valores a Receber/Pagar		-232.583	-5.037	-227.546	0,0%	-	-	-
Caixa		2.071.766	410.631	1.661.135	0,2%	-	-	-
Renda Variável		80.621.932	0	80.621.932	6,3%	70%	0%	25%
Ações		80.181.471	0	80.181.471	6,3%	70%	0%	25%
	Novo Mercado	47.875.360	0	47.875.360	3,8%	70%	-	-
	Nível 2	12.782.706	0	12.782.706	1,0%		-	-
	Nível 1	17.265.554	0	17.265.554	1,4%	50%	-	-
	Bovespa Mais	2.257.850	0	2.257.850	0,2%		-	-
Outros Ativos		-57.125	0	-57.125	0,0%	3%	-	-
Valores a Receber/Pagar		497.586	0	497.586	0,0%	-	-	-
Investimentos Estruturados		90.782.263	0	90.782.263	7,1%	20%	0%	15%
Fundos Multimercados		90.782.263	-	90.782.263	7,1%	10%	0%	10%
Investimento no Exterior		8.787.925	0	8.787.925	0,7%	10%	0%	10%
Fundos de Investimento no Exterior		8.787.925	-	8.787.925	0,7%	10%	0	10%

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	4.460.983	3,2%	-	0,0%	4.460.983	0,4%
Até 42	2.174.023	1,5%	-	0,0%	2.174.023	0,2%
Até 63	2.408.919	1,7%	770.558	0,1%	3.179.477	0,3%
Até 84	11.476.686	8,1%	-	0,0%	11.476.686	1,0%
Até 105	9.729.373	6,9%	-	0,0%	9.729.373	0,9%
Até 126	1.812.143	1,3%	-	0,0%	1.812.143	0,2%
Até 252	9.853.620	7,0%	93.806.925	9,9%	103.660.545	9,5%
Até 504	30.292.763	21,4%	91.206.544	9,6%	121.499.306	11,1%
Até 756	2.189.442	1,5%	119.040.609	12,5%	121.230.051	11,1%
Até 1008	17.019.320	12,0%	179.448.940	18,8%	196.468.260	18,0%
Acima de 1008	49.868.596	35,3%	467.739.263	49,1%	517.607.860	47,3%
Total	141.285.868	100,0%	952.012.839	100,0%	1.093.298.707	100,0%

Fonte: Intrag

Risco de crédito

Debêntures

CARACTERÍSTICAS DA EMISSÃO

Título	Carteira	Emitente	Valor	Rating	Agência	Vcto	Aquisição
DEB	MBPREV I	ECORODOVIAS	815.255,14	AA(bra)	FITCH	15/04/2024	25/03/2022
DEB	MBPREV I	SUL AMÉRICA	920.966,72	A+(bra)	FITCH	08/11/2026	25/03/2022
DEB	MBPREV III	LIGHT SERVIÇOS ELETRI	143.020,78	brAA+	S&P	15/04/2024	26/04/2022
DEB	MBPREV III	ECOVIAS	356.358,96	brAAA	S&P	17/04/2024	22/03/2022
DEB	MBPREV III	COPEL GERAÇÃO E TRA	270.905,95	AA(bra)	FITCH	15/07/2024	30/01/2020
DEB	MBPREV III	COGNA EDUCAÇÃO	1.406.650,73	AA+(bra)	FITCH	20/08/2024	12/12/2022
DEB	MBPREV III	COLINAS	711.248,99	brAA+	S&P	15/06/2025	08/06/2021
DEB	MBPREV III	HAPVIDA	285.654,33	--	FITCH	22/09/2025	28/09/2020
DEB	MBPREV III	SANTOS BRASIL PARTIC	617.875,73	brAAA	S&P	25/03/2026	04/11/2022
DEB	MBPREV III	ELETROBRAS	407.327,75	brAAA	S&P	15/04/2026	24/06/2022
DEB	MBPREV III	ELETROBRAS	1.339.879,77	brAAA	S&P	25/04/2026	17/05/2019
DEB	MBPREV III	VIA VAREJO	174.233,14	brAA	S&P	30/04/2026	10/05/2021
DEB	MBPREV III	ECORODOVIAS	989.031,08	brAAA	S&P	20/06/2026	22/06/2022
DEB	MBPREV III	PAGUE MENOS	263.445,48	AA-(bra)	FITCH	15/07/2026	15/07/2023
DEB	MBPREV III	MRS LOGÍSTA	656.160,56	AAA(bra)	FITCH	15/08/2026	22/09/2021
DEB	MBPREV III	COGNA EDUCAÇÃO	817.825,75	AA+(bra)	FITCH	20/08/2026	20/08/2021
DEB	MBPREV III	VAMOS	888.855,95	AA-(bra)	FITCH	20/08/2026	04/10/2021
DEB	MBPREV III	MOVIDA	891.822,50	AA-(bra)	FITCH	15/09/2026	20/09/2021
DEB	MBPREV III	COPASA	502.699,97	AAA.br	MOODYS	15/09/2026	29/09/2021
DEB	MBPREV III	VIA	311.867,80	brAA	S&P	15/09/2026	29/09/2021
DEB	MBPREV III	MAGAZINE LUIZA	447.524,22	brAAA	S&P	15/10/2026	15/10/2021
DEB	MBPREV III	MINERVA	211.636,62	brAAA	S&P	15/10/2026	21/10/2021
DEB	MBPREV III	LIGHT SERVIÇOS ELETRI	523.539,84	brAA+	S&P	15/10/2026	10/11/2021
DEB	MBPREV III	COPEL GERAÇÃO E TRA	1.038.214,74	AAA(bra)	FITCH	15/10/2026	11/11/2021
DEB	MBPREV III	LIGHT SERVIÇOS ELETRI	239.610,79	brAA+	S&P	15/10/2026	04/07/2022
DEB	MBPREV III	ANHANGUERA BANDEI	1.058.241,31	AAA.br	MOODYS	04/11/2026	09/11/2021
DEB	MBPREV III	ANHANGUERA BANDEI	2.060.084,10	AAA.br	MOODYS	04/11/2026	21/02/2022

RATING ATUAL: Dezembro 2023

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

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	PAGUE MENOS	191.316,75	A+(bra)	FITCH	05/11/2026	25/02/2022
DEB	MBPREV III	LOCALIZA	1.676.275,20	--	S&P	10/11/2026	08/12/2021
DEB	MBPREV III	COLINAS	991.535,54	brAA+	S&P	15/12/2026	29/06/2022
DEB	MBPREV III	LOCALIZA	126.503,62	AAA(bra)	FITCH	25/02/2027	11/03/2022
DEB	MBPREV III	AES TIETÊ	1.010.546,28	AA(bra)	FITCH	15/03/2027	30/06/2022
DEB	MBPREV III	LOCALIZA	461.360,91	--	S&P	10/05/2027	13/05/2022
DEB	MBPREV III	LOG COMMERCIAL	694.950,07	brAA+	S&P	11/07/2027	11/07/2022
DEB	MBPREV III	SIMPAR	690.049,27	brAA+	S&P	15/07/2027	19/07/2022
DEB	MBPREV III	NATURA	660.222,91	brAAA	S&P	21/07/2027	25/07/2022
DEB	MBPREV III	CM HOSPITALAR	355.307,12	Aa.br	MOODYS	22/07/2027	25/07/2022
DEB	MBPREV III	TUPY	259.671,03	brAAA	S&P	06/09/2027	06/09/2022
DEB	MBPREV III	LM TRANSPORTE	516.454,17	brAA+	S&P	25/09/2027	29/09/2022
DEB	MBPREV III	RUMO MALHA PAULIST	259.298,18	AAA(bra)	FITCH	15/10/2027	22/10/2021
DEB	MBPREV III	AMERICANAS	668.800,00	AA+(bra)	FITCH	20/10/2027	11/11/2022
DEB	MBPREV III	CM HOSPITALAR	607.392,69	Aa.br	MOODYS	27/10/2027	08/11/2022
DEB	MBPREV III	SENDAS DISTRIBUIDOR	4.060,89	AAA(bra)	FITCH	26/11/2027	07/01/2022
DEB	MBPREV III	SENDAS DISTRIBUIDOR	450.758,66	AAA(bra)	FITCH	26/11/2027	08/07/2022
DEB	MBPREV III	SENDAS DISTRIBUIDOR	982.735,09	AAA(bra)	FITCH	26/11/2027	24/08/2022
DEB	MBPREV III	LOCALIZA	1.977.746,19	--	S&P	15/12/2027	12/08/2022
DEB	MBPREV III	SABESP	1.382.595,61	brAAA	S&P	15/07/2028	16/07/2021
DEB	MBPREV III	ALGAR	272.794,74	brAAA	S&P	15/07/2028	12/08/2021
DEB	MBPREV III	TIM BRASIL	1.039.061,73	AAA(bra)	FITCH	25/07/2028	11/09/2023
DEB	MBPREV III	RGE SUL DISTRIBUIDOR	650.555,77	AAA.br	MOODYS	27/09/2028	08/10/2021
DEB	MBPREV III	B3	1.263.403,70	AAA(bra)	FITCH	11/10/2028	26/10/2023
DEB	MBPREV III	CCR	955.037,28	brAAA	S&P	15/01/2029	14/02/2022
DEB	MBPREV III	ALGAR	683.275,14	brAAA	S&P	15/01/2029	23/09/2022
DEB	MBPREV III	ALGAR	273.741,14	brAAA	S&P	15/01/2029	16/11/2023

RATING ATUAL: Dezembro 2023								
FITCH			MOODY'S			S&P		
Data	Rating	Class	Data	Rating	Class	Data	Rating	Class
-	AA-(bra)	☺⇌	-	--	-	-	--	-
-	--	-	-	--	-	-	brAAA	☺⇌
-	--	-	-	--	-	-	brAA+	☺⇌
-	AAA(bra)	☺⇌	-	--	-	-	--	-
-	AA-(bra)	☺⇌	-	--	-	-	--	-
-	--	-	-	--	-	-	brAAA	☺⇌
-	--	-	-	--	-	-	brAA+	☺⇌
-	--	-	-	--	-	-	brAA+	☺⇌
-	--	-	-	--	-	-	brAAA	☺⇌
-	--	-	-	Aa.br	☺⇌	-	--	-
-	--	-	-	--	-	-	brAAA	☺⇌
-	--	-	-	AA+.br	☺⇌	-	brAA+	☺⇌
-	AAA(bra)	☺⇌	-	--	-	-	--	-
-	D(bra)	☹⇌	-	--	-	-	--	-
-	--	-	-	Aa.br	☺⇌	-	--	-
-	AAA(bra)	☺⇌	-	--	-	-	--	-
-	AAA(bra)	☺⇌	-	--	-	-	--	-
-	AAA(bra)	☺⇌	-	--	-	-	--	-
-	--	-	-	--	-	-	brAAA	☺⇌
-	--	-	-	--	-	-	brAAA	☺⇌
-	--	-	-	--	-	-	brAAA	☺⇌
-	AAA(bra)	☺⇌	-	--	-	-	--	-
-	--	-	-	AAA.br	☺⇌	-	--	-
-	AAA(bra)	☺⇌	-	--	-	-	--	-
-	--	-	-	--	-	-	brAAA	☺⇌
-	--	-	-	--	-	-	brAAA	☺⇌
-	--	-	-	--	-	-	brAAA	☺⇌

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	RAIA DROGASIL	353.968,72	AAA(bra)	FITCH	25/01/2029	16/02/2022
DEB	MBPREV III	LOCALIZA	120.197,17	AAA(bra)	FITCH	25/02/2029	11/03/2022
DEB	MBPREV III	HAPVIDA	12.138,68	AAA(bra)	FITCH	10/05/2029	18/05/2022
DEB	MBPREV III	HAPVIDA	206.357,58	AAA(bra)	FITCH	10/05/2029	02/09/2022
DEB	MBPREV III	HAPVIDA	745.517,33	AAA(bra)	FITCH	10/05/2029	09/01/2023
DEB	MBPREV III	NOVA TRANSPORTAD	982.320,55	AAA(bra)	FITCH	13/09/2029	06/10/2022
DEB	MBPREV III	USIMINAS	1.378.074,75	brAAA	S&P	09/12/2029	12/12/2022
DEB	MBPREV III	COPASA	612.865,37	AAA.br	MOODYS	15/09/2030	28/09/2023
DEB	MBPREV III	REDE D'OR SÃO LUIZ	1.326.019,03	AAA(bra)	FITCH	25/07/2031	04/08/2023
DEB	MBPREV IV	ELETROBRAS	137.068,55	brAAA	S&P	25/04/2024	20/10/2022
DEB	MBPREV IV	ELETROBRAS	137.068,55	brAAA	S&P	25/04/2024	20/10/2022
DEB	MBPREV IV	ELETROBRAS	137.068,55	brAAA	S&P	25/04/2024	20/10/2022
DEB	MBPREV IV	ELETROBRAS	86.302,42	brAAA	S&P	25/04/2024	21/10/2022
DEB	MBPREV IV	COPEL GERAÇÃO E TRA	63.211,39	AA(bra)	FITCH	15/07/2024	30/01/2020
DEB	MBPREV IV	LOCALIZA	307.035,96	AAA(bra)	FITCH	10/05/2025	31/10/2023
DEB	MBPREV IV	ELETROBRAS	637.795,02	brAAA	S&P	25/04/2026	17/05/2019
DEB	MBPREV IV	B3	99.102,08	AAA.br	MOODYS	24/05/2026	08/06/2022
DEB	MBPREV IV	B3	721.299,65	AAA.br	MOODYS	24/05/2026	10/06/2022
DEB	MBPREV IV	B3	98.080,41	AAA.br	MOODYS	24/05/2026	14/06/2022
DEB	MBPREV IV	B3	3.065,01	AAA.br	MOODYS	24/05/2026	14/06/2022
DEB	MBPREV IV	FERROVIA CENTRO ATL	699.506,05	brAAA	S&P	20/06/2026	30/06/2022
DEB	MBPREV IV	CIA ESTADUAL DISTRIB	82.899,46	brAA+	S&P	15/08/2026	25/08/2021
DEB	MBPREV IV	LOCALIZA	530.637,04	AAA(bra)	FITCH	05/10/2026	19/10/2022
DEB	MBPREV IV	LOCALIZA	236.983,53	AAA(bra)	FITCH	05/10/2026	19/10/2022
DEB	MBPREV IV	MAGAZINE LUIZA	258.453,91	brAAA	S&P	15/10/2026	15/10/2021
DEB	MBPREV IV	DASA	684.375,16	AAA(bra)	FITCH	30/10/2026	19/10/2022
DEB	MBPREV IV	DASA	145.504,98	AAA(bra)	FITCH	30/10/2026	20/10/2022

RATING ATUAL: Dezembro 2023								
FITCH			MOODY'S			S&P		
Data	Rating	Class	Data	Rating	Class	Data	Rating	Class
-	AAA(bra)	😊⇒	-	--	-	-	--	-
-	AAA(bra)	😊⇒	-	--	-	-	--	-
-	AAA(bra)	😊⇒	-	--	-	-	--	-
-	AAA(bra)	😊⇒	-	--	-	-	--	-
-	AAA(bra)	😊⇒	-	--	-	-	--	-
-	AAA(bra)	😊⇒	-	--	-	-	--	-
-	--	-	-	--	-	-	brAAA	😊⇒
-	--	-	-	AAA.br	😊⇒	-	--	-
-	AAA(bra)	😊⇒	-	--	-	-	--	-
-	--	-	-	--	-	-	brAAA	😊⇒
-	--	-	-	--	-	-	brAAA	😊⇒
-	--	-	-	--	-	-	brAAA	😊⇒
-	--	-	-	--	-	-	brAAA	😊⇒
-	AAA(bra)	😊⇒	-	--	-	-	--	-
-	AAA(bra)	😊⇒	-	--	-	-	--	-
-	--	-	-	--	-	-	brAAA	😊⇒
-	--	-	-	AAA.br	😊⇒	-	--	-
-	--	-	-	AAA.br	😊⇒	-	--	-
-	--	-	-	AAA.br	😊⇒	-	--	-
-	--	-	-	AAA.br	😊⇒	-	--	-
-	--	-	-	--	-	-	brAAA	😊⇒
-	--	-	-	--	-	-	brAA+	😊⇒
-	AAA(bra)	😊⇒	-	--	-	-	--	-
-	AAA(bra)	😊⇒	-	--	-	-	--	-
-	--	-	-	--	-	-	brAA-	😊⇒
-	AA(bra)	😊⇒	-	--	-	-	--	-
-	AA(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 IV	DASA	307.065,69	AAA(bra)	FITCH	30/10/2026	24/10/2022
DEB	MBPREV IV	ANHANGUERA BANDEI	477.849,27	AAA.br	MOODYS	04/11/2026	09/11/2021
DEB	MBPREV IV	PAULISTA FORÇA E LUZ	281.189,74	AAA(bra)	FITCH	12/12/2026	01/12/2023
DEB	MBPREV IV	REDE D'OR SÃO LUIZ	210.825,90	AAA(bra)	FITCH	20/12/2026	03/09/2021
DEB	MBPREV IV	ALIANÇA ENERGIA	898.001,84	AAA(bra)	FITCH	15/01/2027	01/02/2022
DEB	MBPREV IV	ARTERIS	435.581,55	brAA+	S&P	11/03/2027	24/03/2022
DEB	MBPREV IV	COMPANHIA ESTADUA	1.684.687,37	AAA.br	MOODYS	25/05/2027	08/06/2022
DEB	MBPREV IV	TELEFÔNICA	526.351,67	AAA.br	MOODYS	12/07/2027	14/07/2022
DEB	MBPREV IV	B3	846.175,55	AAA.br	MOODYS	05/08/2027	09/08/2022
DEB	MBPREV IV	NOVA TRANSPORTAD	773.430,11	AAA(bra)	FITCH	13/09/2027	06/10/2022
DEB	MBPREV IV	IGUATEMI	168.714,29	AAA(bra)	FITCH	28/09/2027	07/12/2023
DEB	MBPREV IV	AMERICANAS	68.400,00	AA+(bra)	FITCH	20/10/2027	11/11/2022
DEB	MBPREV IV	SENDAS DISTRIBUIDOR	164.466,00	AAA(bra)	FITCH	26/11/2027	17/10/2022
DEB	MBPREV IV	SENDAS DISTRIBUIDOR	164.466,00	AAA(bra)	FITCH	26/11/2027	17/10/2022
DEB	MBPREV IV	SENDAS DISTRIBUIDOR	133.794,48	AAA(bra)	FITCH	20/05/2028	17/10/2022
DEB	MBPREV IV	SENDAS DISTRIBUIDOR	183.839,74	AAA(bra)	FITCH	20/05/2028	19/10/2022
DEB	MBPREV IV	COPEL DISTRIBUIÇÃO	275.468,61	AAA(bra)	FITCH	15/06/2028	06/12/2023
DEB	MBPREV IV	COPEL DISTRIBUIÇÃO	384.616,55	AAA(bra)	FITCH	15/06/2028	20/12/2023
DEB	MBPREV IV	COELBA	113.893,13	brAAA	S&P	15/08/2028	06/12/2023
DEB	MBPREV IV	ENGIE	761.493,60	AAA(bra)	FITCH	15/11/2028	07/12/2023
DEB	MBPREV IV	HAPVIDA	316.617,26	AAA(bra)	FITCH	10/05/2029	18/05/2022
DEB	MBPREV IV	REDE D'OR SÃO LUIZ	304.904,65	AAA(bra)	FITCH	20/06/2029	08/12/2023
DEB	MBPREV IV	COMPASS GÁS E ENERG	86.349,96	AAA(bra)	FITCH	01/11/2030	12/12/2023
DEB	MBPREV IV	COMPASS GÁS E ENERG	259.049,88	AAA(bra)	FITCH	01/11/2030	14/12/2023

RATING ATUAL: Dezembro 2023								
FITCH			MOODY'S			S&P		
Data	Rating	Class	Data	Rating	Class	Data	Rating	Class
-	AA(bra)	😊⇒	-	--	-	-	--	-
-	--	-	-	AAA.br	😊⇒	-	--	-
-	AAA(bra)	😊⇒	-	--	-	-	--	-
-	AAA(bra)	😊⇒	-	--	-	-	--	-
-	AAA(bra)	😊⇒	-	--	-	-	--	-
-	--	-	-	--	-	-	brAA+	😊⇒
-	--	-	-	AAA.br	😊⇒	-	--	-
-	--	-	-	AAA.br	😊⇒	-	--	-
-	--	-	-	AAA.br	😊⇒	-	--	-
-	AAA(bra)	😊⇒	-	--	-	-	--	-
-	AAA(bra)	😊⇒	-	--	-	-	--	-
-	D(bra)	😞⇒	-	--	-	-	--	-
-	AAA(bra)	😊⇒	-	--	-	-	--	-
-	AAA(bra)	😊⇒	-	--	-	-	--	-
-	AAA(bra)	😊⇒	-	--	-	-	--	-
-	AAA(bra)	😊⇒	-	--	-	-	--	-
-	AAA(bra)	😊⇒	-	--	-	-	--	-
-	AAA(bra)	😊⇒	-	--	-	-	--	-
-	AAA(bra)	😊⇒	-	--	-	-	--	-
-	--	-	-	--	-	-	brAAA	😊⇒
-	AAA(bra)	😊⇒	-	--	-	-	--	-
-	AAA(bra)	😊⇒	-	--	-	-	--	-
-	AAA(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

Letras Financeiras							
CARACTERÍSTICAS DA EMISSÃO							
Título	Carteira	Emitente	Valor	Rating	Agência	Vcto	Aquisição
LF	MBPREV I	BANCO VOTORANTIM	3.388.849,45	AA-.br	MOODY'S	03/01/2024	05/10/2022
LF	MBPREV I	BANCO VOTORANTIM	1.075.478,45	AA-.br	MOODY'S	04/03/2024	30/08/2021
LF	MBPREV I	BANCO VOTORANTIM	134.434,81	AA-.br	MOODY'S	04/03/2024	05/10/2022
LF	MBPREV I	BANCO SAFRA	206.002,94	AA+.br	MOODY'S	22/03/2024	05/10/2022
LF	MBPREV I	BANCO SAFRA	3.021.376,39	AA+.br	MOODY'S	22/03/2024	05/10/2022
LF	MBPREV I	BANCO SAFRA	68.418,42	AA+.br	MOODY'S	06/05/2024	05/10/2022
LF	MBPREV I	BANCO VOTORANTIM	514.106,65	AA-.br	MOODY'S	20/05/2024	18/02/2022
LF	MBPREV I	BANCO VOTORANTIM	3.341.693,22	AA-.br	MOODY'S	20/05/2024	05/10/2022
LF	MBPREV I	BANCO SANTANDER	871.866,05	AAA.br	MOODY'S	27/05/2024	23/03/2022
LF	MBPREV I	BANCO SANTANDER	469.466,33	AAA.br	MOODY'S	27/05/2024	05/10/2022
LF	MBPREV I	BANCO ALFA	974.852,82	AA(bra)	FITCH	13/12/2024	14/12/2022
LF	MBPREV I	BANCO SAFRA	839.157,58	AA+.br	MOODY'S	07/02/2025	07/02/2022
LF	MBPREV I	BANCO SAFRA	5.228.597,22	AA+.br	MOODY'S	07/02/2025	05/10/2022
LF	MBPREV I	BANCO SAFRA	765.803,80	AA+.br	MOODY'S	17/03/2025	17/03/2022
LF	MBPREV I	BANCO CITIBANK	1.610.207,99	AAA(bra)	FITCH	13/07/2026	12/07/2023
LF	MBPREV II	BANCO VOTORANTIM	271.107,96	AA-.br	MOODY'S	03/01/2024	12/01/2022
LF	MBPREV II	BANCO VOTORANTIM	3.629.739,78	AA-.br	MOODY'S	04/03/2024	30/08/2021
LF	MBPREV II	BANCO VOTORANTIM	134.434,81	AA-.br	MOODY'S	04/03/2024	12/01/2022
LF	MBPREV II	BANCO SAFRA	1.304.685,26	AA+.br	MOODY'S	22/03/2024	17/11/2021
LF	MBPREV II	BANCO SAFRA	136.836,83	AA+.br	MOODY'S	06/05/2024	17/11/2021
LF	MBPREV II	BANCO VOTORANTIM	1.735.109,94	AA-.br	MOODY'S	20/05/2024	18/02/2022
LF	MBPREV II	BANCO SANTANDER	268.266,48	AAA.br	MOODY'S	27/05/2024	11/01/2022
LF	MBPREV II	BANCO ALFA	273.971,92	AA(bra)	FITCH	22/07/2024	12/01/2022
LF	MBPREV II	BANCO ALFA	4.644.886,98	AA(bra)	FITCH	13/12/2024	14/12/2022
LF	MBPREV II	BANCO SAFRA	2.775.675,07	AA+.br	MOODY'S	07/02/2025	07/02/2022
LF	MBPREV II	BANCO SAFRA	1.914.509,49	AA+.br	MOODY'S	17/03/2025	17/03/2022
LF	MBPREV II	BANCO CITIBANK	4.347.561,57	AAA(bra)	FITCH	13/07/2026	12/07/2023

RATING ATUAL: Dezembro 2023								
FITCH			MOODY'S			S&P		
Data	Rating	Class	Data	Rating	Class	Data	Rating	Class
-	--	-	-	AA-.br	😊⇌	-	brAAA	😊⇌
-	--	-	-	AA-.br	😊⇌	-	brAAA	😊⇌
-	--	-	-	AA-.br	😊⇌	-	brAAA	😊⇌
-	--	-	-	AAA.br	😊⇌	-	brAAA	😊⇌
-	--	-	-	AAA.br	😊⇌	-	brAAA	😊⇌
-	--	-	-	AAA.br	😊⇌	-	brAAA	😊⇌
-	--	-	-	AA-.br	😊⇌	-	brAAA	😊⇌
-	--	-	-	AA-.br	😊⇌	-	brAAA	😊⇌
-	--	-	-	AAA.br	😊⇌	-	brAAA	😊⇌
-	--	-	-	AAA.br	😊⇌	-	brAAA	😊⇌
-	AA+(bra)	😊⇌	-	AAA.br	😊⇌	-	--	-
-	--	-	-	AAA.br	😊⇌	-	brAAA	😊⇌
-	--	-	-	AAA.br	😊⇌	-	brAAA	😊⇌
-	--	-	-	AAA.br	😊⇌	-	brAAA	😊⇌
-	AAA(bra)	😊⇌	-	--	-	-	brAAA	😊⇌
-	--	-	-	AA-.br	😊⇌	-	brAAA	😊⇌
-	--	-	-	AA-.br	😊⇌	-	brAAA	😊⇌
-	--	-	-	AA-.br	😊⇌	-	brAAA	😊⇌
-	--	-	-	AAA.br	😊⇌	-	brAAA	😊⇌
-	--	-	-	AAA.br	😊⇌	-	brAAA	😊⇌
-	--	-	-	AA-.br	😊⇌	-	brAAA	😊⇌
-	--	-	-	AAA.br	😊⇌	-	brAAA	😊⇌
-	AA+(bra)	😊⇌	-	AAA.br	😊⇌	-	--	-
-	AA+(bra)	😊⇌	-	AAA.br	😊⇌	-	--	-
-	--	-	-	AAA.br	😊⇌	-	brAAA	😊⇌
-	--	-	-	AAA.br	😊⇌	-	brAAA	😊⇌
-	AAA(bra)	😊⇌	-	--	-	-	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	Vcto	Aquisição
LF	MBPREV III	BANCO SAFRA	5.943.255,26	AA+.br	MOODY'S	14/04/2025	14/04/2022
LF	MBPREV IV	BANCO SAFRA	801.025,21	AA+.br	MOODY'S	04/01/2024	31/08/2021
LF	MBPREV IV	BANCO ITAÚ	2.174.023,32	AA+.br	MOODY'S	01/02/2024	26/01/2022
LF	MBPREV IV	BANCO SAFRA	2.408.919,37	AA+.br	MOODY'S	22/02/2024	03/05/2023
LF	MBPREV IV	BANCO ALFA	1.970.533,57	AA(bra)	FITCH	11/03/2024	11/03/2022
LF	MBPREV IV	BANCO ITAÚ	2.178.002,71	AA+.br	MOODY'S	01/04/2024	21/01/2022
LF	MBPREV IV	BANCO ITAÚ	7.551.370,08	AA+.br	MOODY'S	01/04/2024	24/03/2022
LF	MBPREV IV	BANCO ITAÚ	185.692,82	AA+.br	MOODY'S	27/05/2024	08/11/2022
LF	MBPREV IV	BANCO ITAÚ	128.160,16	AA+.br	MOODY'S	02/09/2024	30/09/2022
LF	MBPREV IV	BANCO ITAÚ	119.262,91	AA+.br	MOODY'S	02/09/2024	30/09/2022
LF	MBPREV IV	BANCO HSBC	4.959.974,14	brAAA	S&P	04/10/2024	30/09/2022
LF	MBPREV IV	BANCO VOTORANTIM	1.000.210,52	AA-.br	MOODY'S	21/10/2024	19/10/2022
LF	MBPREV IV	BANCO VOTORANTIM	938.804,02	AA-.br	MOODY'S	25/10/2024	26/10/2022
LF	MBPREV IV	BANCO BTG PACTUAL	428.330,90	AA.br	MOODY'S	01/07/2025	30/06/2023
LF	MBPREV IV	BANCO BRADESCO	764.207,72	AA+.br	MOODY'S	23/12/2025	06/07/2023
LF	MBPREV IV	BANCO CITIBANK	858.777,59	AAA(bra)	FITCH	13/07/2026	12/07/2023
LF	MBPREV IV	BANCO BRADESCO	3.156.420,69	AA+.br	MOODY'S	11/11/2027	11/11/2022
LF	MBPREV IV	BANCO BRADESCO	3.686.261,35	AA+.br	MOODY'S	15/09/2028	15/09/2023

RATING ATUAL: Dezembro 2023								
FITCH			MOODY'S			S&P		
Data	Rating	Class	Data	Rating	Class	Data	Rating	Class
-	--	-	-	AAA.br	☺⇌	-	brAAA	☺⇌
-	--	-	-	AAA.br	☺⇌	-	brAAA	☺⇌
-	AAA(bra)	☺⇌	-	AA+.br	☺⇌	-	--	-
-	--	-	-	AAA.br	☺⇌	-	brAAA	☺⇌
-	AA+(bra)	☺⇌	-	AAA.br	☺⇌	-	--	-
-	AAA(bra)	☺⇌	-	AA+.br	☺⇌	-	--	-
-	AAA(bra)	☺⇌	-	AA+.br	☺⇌	-	--	-
-	AAA(bra)	☺⇌	-	AA+.br	☺⇌	-	--	-
-	AAA(bra)	☺⇌	-	AA+.br	☺⇌	-	--	-
-	AAA(bra)	☺⇌	-	AA+.br	☺⇌	-	--	-
-	--	-	-	--	-	-	brAAA	☺⇌
-	--	-	-	AA-.br	☺⇌	-	brAAA	☺⇌
-	--	-	-	AA-.br	☺⇌	-	brAAA	☺⇌
-	AAA(bra)	☺⇌	-	AA.br	☺⇌	-	brAAA	☺⇌
-	AAA(bra)	☺⇌	-	AA+.br	☺⇌	-	brAAA	☺⇌
-	AAA(bra)	☺⇌	-	--	-	-	brAAA	☺⇌
-	AAA(bra)	☺⇌	-	AA+.br	☺⇌	-	brAAA	☺⇌
-	AAA(bra)	☺⇌	-	AA+.br	☺⇌	-	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	671.271.385	70,6%	61,5%	52,6%
LTN	84.931.344	8,9%	7,8%	6,7%
NTN-B	194.597.530	20,5%	17,8%	15,3%
NTN-F	0	0,0%	0,0%	0,0%
TOTAL	950.800.260	100,0%	87,0%	74,6%

Fontes: Intrag

Risco de crédito

EMISSION	Valor	%CP	%RF	%TOTAL
DEBÊNTURE SIMPLES	58.085.538	41,1%	5,3%	4,6%
LETRA FINANCEIRA	83.200.330	58,9%	7,6%	6,5%
CERTIFICADO DE DEPÓSITO BANCÁRIO	-	0,0%	0,0%	0,0%
LETRAS COMERCIAIS	-	0,0%	0,0%	0,0%
TOTAL	141.285.868	100,0%	12,9%	11,1%

EMISSION	Valor	% NÃO FINANCEIRO	%CP	%RF	%TOTAL
LOCALIZA RENT A CAR SA	5.436.740	9,4%	3,8%	0,5%	0,4%
CONCESSIONARIA SISTEMA ANHANGUERA BANDEIRANTES S/A	3.596.175	6,2%	2,5%	0,3%	0,3%
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	3.031.126	5,2%	2,1%	0,3%	0,2%
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	2.882.511	5,0%	2,0%	0,3%	0,2%
COGNA EDUCAÇÃO S.A.	2.224.476	3,8%	1,6%	0,2%	0,2%
SENDAS DISTRIBUIDORA S.A.	2.084.121	3,6%	1,5%	0,2%	0,2%
REDE D OR SAO LUIZ SA	1.841.750	3,2%	1,3%	0,2%	0,1%
ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	1.804.286	3,1%	1,3%	0,2%	0,1%
NOVA TRANSPORTADORA SUDESTE SA - NTS	1.755.751	3,0%	1,2%	0,2%	0,1%
RODOVIAS COLINAS SA	1.702.785	2,9%	1,2%	0,2%	0,1%
OUTROS	31.725.818	54,6%	22,5%	2,9%	2,5%
TOTAL	58.085.538	100,0%	41,1%	5,3%	4,6%

EMISSION	Valor	% FINANCEIRO	%CP	%RF	%TOTAL
BCO SAFRA SA	25.414.263	30,5%	18,0%	2,3%	2,0%
BANCO VOTORANTIM S.A.	16.163.970	19,4%	11,4%	1,5%	1,3%
BANCO ITAU S/A	12.336.512	14,8%	8,7%	1,1%	1,0%
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	7.864.245	9,5%	5,6%	0,7%	0,6%
BRADESCO PROPRIO	7.606.890	9,1%	5,4%	0,7%	0,6%
BCO CITIBANK SA	6.816.547	8,2%	4,8%	0,6%	0,5%
BANCO HSBC SA	4.959.974	6,0%	3,5%	0,5%	0,4%
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	1.609.599	1,9%	1,1%	0,1%	0,1%
BANCO BTG PACTUAL S A	428.331	0,5%	0,3%	0,0%	0,0%
TOTAL	83.200.330	100,0%	58,9%	7,6%	6,5%

Fontes: Intrag

PPS performance

Os Maiores Emissores de Renda Variável

EMPRESA	R\$	%RV	%TOTAL
VALE SA	8.394.778	10,5%	0,7%
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	6.473.831	8,1%	0,5%
BRADESCO PROPRIOS	4.312.133	5,4%	0,3%
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	4.275.783	5,3%	0,3%
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	2.770.947	3,5%	0,2%
ITAUSA SA	2.573.030	3,2%	0,2%
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	2.101.848	2,6%	0,2%
CIA PARANAENSE ENERGIA COPEL	1.784.685	2,2%	0,1%
ALLOS S.A.	1.741.062	2,2%	0,1%
BCO BRASIL SA	1.640.626	2,0%	0,1%
OUTROS	44.112.747	55,0%	3,5%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	80.181.471	100,0%	6,3%

Fontes: Intrag

Os Maiores Emissores Instituições Financeiras

EMPRESA	R\$	% Inst. Financ.	%TOTAL
BCO SAFRA SA	25.414.263	26,7%	2,0%
BANCO VOTORANTIM S.A.	16.163.970	17,0%	1,3%
BANCO ITAU S/A	12.336.512	13,0%	1,0%
BRDESCO PROPRIOS	11.919.023	12,5%	0,9%
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	7.864.245	8,3%	0,6%
BCO CITIBANK SA	6.816.547	7,2%	0,5%
BANCO HSBC SA	4.959.974	5,2%	0,4%
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	4.275.783	4,5%	0,3%
BANCO BTG PACTUAL S A	1.955.260	2,1%	0,2%
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	1.792.578	1,9%	0,1%
TOTAL INST. FINANCEIRAS	95.138.782	100,0%	7,5%

Fontes: Intrag

Rentabilidade dos Investimentos

MB Prev / Benchmarks	Retorno dos Investimentos*						
	3º Tri/23	4º Tri/23	2º Sem/23	1º Tri/23	2º Tri/23	1º Sem/23	12 Meses
Perfil Conservador							
MB Prev	3,26%	2,82%	6,17%	3,07%	3,24%	6,41%	12,97%
Benchmark: IMA-S	3,28%	2,82%	6,20%	3,30%	3,24%	6,64%	13,25%
Perfil Moderado							
MB Prev	1,95%	4,10%	6,13%	1,61%	4,48%	6,16%	12,67%
Benchmark MBPREV MOD*	2,34%	4,06%	6,49%	2,49%	3,98%	6,57%	13,49%
Perfil Agressivo							
MB Prev	1,51%	5,15%	6,73%	0,80%	5,27%	6,11%	13,26%
Benchmark MBPREV ARR**	2,00%	5,00%	7,10%	1,68%	4,66%	6,42%	13,97%
Total							
Meta Atuarial: INPC + 4% a.a.	1,21%	1,76%	2,99%	2,89%	1,78%	4,72%	7,86%

*BENCH. MBPREV (MOD)

2023: 57,75% IMA-S + 24,75% IMA-B 5 + 8,5% IBX + 7% IHFA + 2% MSCI ACWI

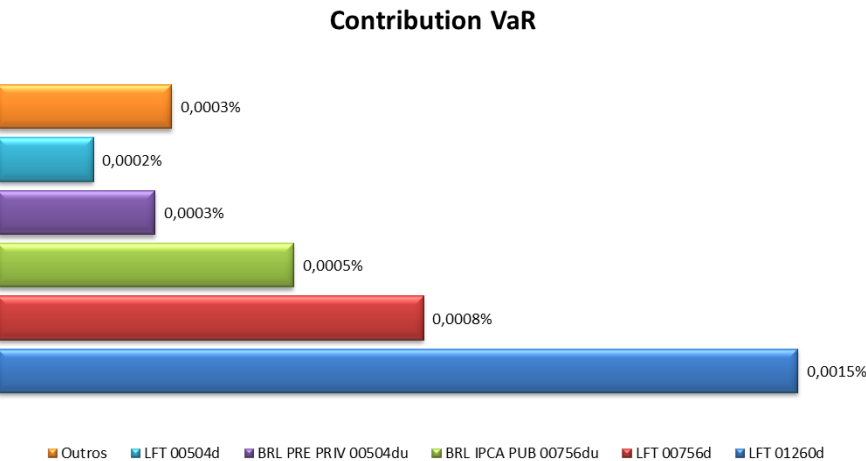
**BENCH. MBPREV (ARR)

2023: 49% IMA-S + 21% IMA-B 5 + 15% IBX + 10% IHFA + 5% MSCI ACWI

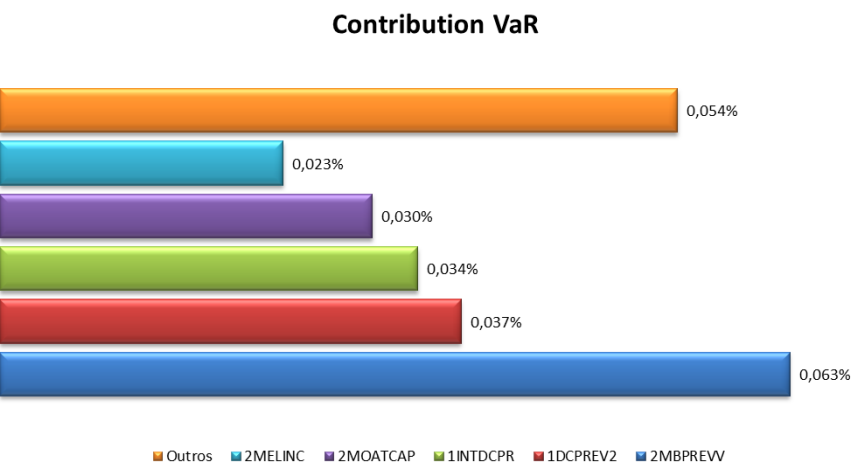
Rentabilidade da Cota Contábil

MB Prev / Benchmarks	Retorno dos Investimentos*						
	3º Tri/23	4º Tri/23	2º Sem/23	1º Tri/23	2º Tri/23	1º Sem/23	12 Meses
Perfil Conservador							
MB Prev	3,26%	2,84%	6,19%	3,05%	3,21%	6,37%	12,95%
Perfil Moderado							
MB Prev	1,97%	4,12%	6,17%	1,63%	4,50%	6,20%	12,76%
Perfil Agressivo							
MB Prev	1,52%	5,20%	6,80%	0,79%	5,23%	6,07%	13,28%

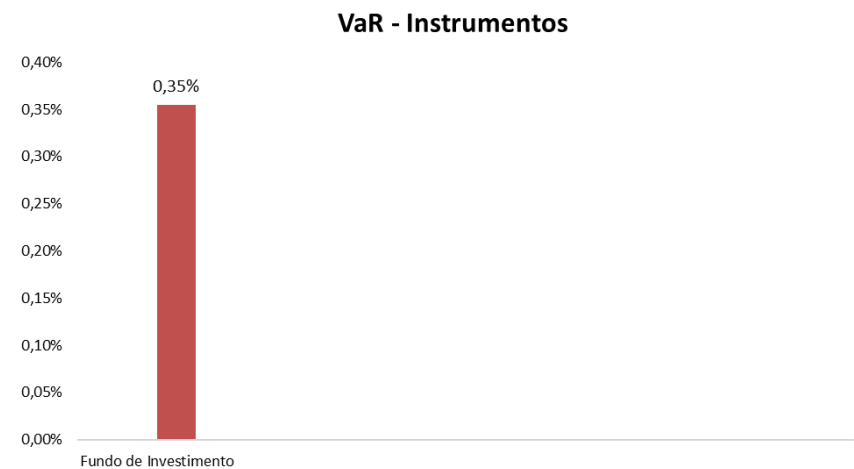
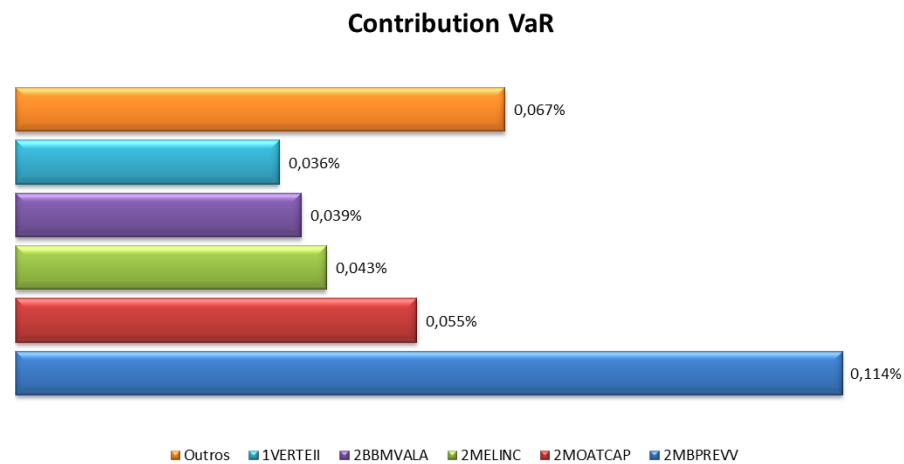
Risco do Mercado – Conservador



Risco do Mercado – Moderado



Risco do Mercado – Arrojado



Custo da Administração – Taxa de Gestão e Administração

Mês	MBPrev I (BRAM)	MBPrev II (BRAM)	MBPrev III (SAM)	MBPrev IV (SAM)	MBPrev V (BNP)	Intrag	Total
Janeiro	11.547,77	40.356,03	37.886,41	16.101,27	8.333,59	31.994,67	146.219,74
Fevereiro	9.438,61	33.378,74	31.099,89	13.270,66	6.709,74	26.590,41	120.488,05
Março	12.189,80	43.318,06	39.739,73	17.145,16	8.109,61	33.862,60	154.364,96
Abril	9.830,37	34.384,47	30.931,78	13.552,97	6.385,61	27.018,94	122.104,14
Mai	16.660,16	42.839,90	29.391,09	20.620,65	7.727,01	33.013,26	150.252,07
Junho	16.798,42	41.822,35	27.447,86	19.815,78	7.932,52	31.956,48	145.773,41
Julho	17.102,38	42.482,53	27.517,70	19.748,42	8.090,48	32.228,77	147.170,28
Agosto	19.303,62	47.105,39	29.822,18	21.707,31	8.787,49	35.425,04	162.151,03
Setembro	17.009,65	41.502,83	22.433,35	18.800,90	7.596,49	31.149,54	138.492,76
Outubro	17.744,72	43.651,56	27.346,03	19.939,89	7.817,98	32.752,80	149.252,98
Novembro	17.593,68	40.593,74	25.639,24	19.967,43	7.923,43	31.458,86	143.176,38
Dezembro	17.514,11	40.742,58	25.964,14	20.238,04	8.403,02	31.676,65	144.538,54
Total	182.733,29	492.178,18	355.219,40	220.908,48	93.816,97	379.128,02	1.723.984,34

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

Mês	Taxa de Custódia	Taxas bancárias	Despesas B3	Taxa de Fiscalização CVM	Auditoria	Despesas ANBID	Despesas com Cartório	Total de Despesas Investimentos	Patrimônio	% Debitado Investimentos
Janeiro	39.675,66	2.058,11	31.734,91	-	-	-	-	219.688,42	1.170.869.876,27	0,23%
Fevereiro	33.026,18	2.072,20	27.222,06	-	-	3.458,00	-	186.266,49	1.170.733.123,28	0,19%
Março	43.610,24	892,64	29.419,59	-	21.252,00	-	-	249.539,43	1.179.101.403,94	0,25%
Abril	35.201,30	1.267,23	27.645,23	-	5.235,60	3.458,00	-	194.911,50	1.188.114.477,11	0,20%
Mai	42.590,49	940,46	29.893,68	141.038,08	-	-	-	364.714,78	1.201.965.419,67	0,36%
Junho	41.352,96	1.562,12	38.242,18	-	-	3.385,00	-	230.315,67	1.221.585.005,44	0,23%
Julho	41.697,85	1.203,47	34.136,45	-	-	-	-	224.208,05	1.232.733.590,76	0,22%
Agosto	45.603,16	1.067,98	36.844,64	-	-	3.385,00	-	249.051,81	1.233.729.975,50	0,24%
Setembro	40.296,96	1.442,57	33.261,63	-	-	-	-	213.493,92	1.238.965.280,74	0,21%
Outubro	42.221,76	996,25	33.333,41	-	-	3.385,00	-	229.189,40	1.239.986.626,49	0,22%
Novembro	40.758,75	1.075,95	33.261,63	-	4.062,00	-	-	222.334,71	1.261.386.093,59	0,21%
Dezembro	41.086,68	1.004,22	33.621,04	-	24.744,00	3.385,00	-	248.379,48	1.274.949.995,79	0,23%
Total do Período	487.121,99	15.583,20	388.616,45	141.038,08	55.293,60	20.456,00	0,00	2.832.093,66	1.261.386.093,59	0,22%
Custo Anualizado:										0,24%

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

Mês	Taxa de Controladoria	Taxa Cálculo Risco	Extrato CBLB B3	Total
Janeiro	22.925,77	3.972,30	-	26.898,07
Fevereiro	19.219,10	3.972,30	-	23.191,40
Março	24.209,25	3.972,30	-	28.181,55
Abril	19.513,75	3.972,30	-	23.486,05
Maio	23.629,50	3.972,30	-	27.601,80
Junho	22.905,19	3.972,30	-	26.877,49
Julho	23.086,73	3.972,30	-	27.059,03
Agosto	25.277,47	3.972,30	-	29.249,77
Setembro	22.344,84	3.972,30	-	26.317,14
Outubro	23.442,61	3.972,30	-	27.414,91
Novembro	22.560,76	3.972,30	-	26.533,06
Dezembro	22.707,44	3.972,30	-	26.679,74
Total	271.822,41	47.667,60	0,00	319.490,01

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.