

Relatório de Acompanhamento da Gestão Financeira 1º SEMESTRE DE 2024



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	1º Semestre/2024		2º Semestre/2023		Limite 4.994	Política de Investimentos	
	R\$	%	R\$	%		Mínimo	Máximo
Renda Fixa	1.134.398.055	86,9%	1.092.318.363	85,6%	100,0%	54%	100%
Renda Variável	67.547.282	5,2%	83.467.039	6,5%	70,0%	0%	25%
Investimentos Estruturados	91.991.675	7,0%	90.782.263	7,1%	20%	0%	15%
Investimento no Exterior	10.983.824	0,8%	8.787.925	0,7%	10%	0%	10%
Total	1.304.920.837	100%	1.275.355.590	100%			

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

Segmentos	1º Semestre/2024		2º Semestre/2023		Limite 4.994	Política de Investimentos	
	R\$	%	R\$	%		Mínimo	Máximo
Renda Fixa	1.127.661.569	86,9%	1.086.416.816	85,6%	100,0%	54%	100%
Renda Variável	67.547.282	5,2%	83.467.039	6,6%	70,0%	0%	25%
Investimentos Estruturados	91.991.675	7,1%	90.782.263	7,2%	20%	0%	15%
Investimento no Exterior	10.983.824	0,8%	8.787.925	0,7%	10%	0%	10%
Total	1.298.184.350	100%	1.269.454.043	100%			

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

Segmentos	1º Semestre/2024		2º Semestre/2023		Limite 4.994	Política de Investimentos	
	R\$	%	R\$	%		Mínimo	Máximo
Renda Fixa	6.736.487	100,0%	5.901.547	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	6.736.487	100%	5.901.547	100%			

Fontes: MB Prev e Intrag

pps portfolio
performance

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

Renda Fixa	Entidade	Plano de Aposentadoria	PGA
Fundos de Investimentos	1.134.257.769	1.127.595.483	6.662.286
Caixa (Administrado + Própria)	138.977	62.408	76.569
Total RF	1.134.396.746	1.127.657.891	6.738.856
Renda Variável	Entidade	Plano de Aposentadoria	PGA
Fundos de Investimentos	67.547.282	67.547.282	0
Total RV	67.547.282	67.547.282	0
Investimentos Estruturados	Entidade	Plano de Aposentadoria	PGA
Fundos de Investimentos	91.991.675	91.991.675	0
Total MM	91.991.675	91.991.675	0
Investimento no Exterior	Entidade	Plano de Aposentadoria	PGA
Fundos de Investimentos	10.983.824	10.983.824	0
Total IE	10.983.824	10.983.824	0
Total do DI	1.304.919.528	1.298.180.672	6.738.856

Fontes: MB Prev e Intrag

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

Segmentos	1º Semestre/2024	%	2º Semestre/2023	%
Renda Fixa	82.833.824	72,8%	75.228.747	66,0%
Renda Variável	11.694.814	10,3%	18.969.843	16,7%
Investimentos Estruturados	15.704.308	13,8%	16.831.957	14,8%
Investimento no Exterior	3.587.923	3,2%	2.870.622	2,5%
Total	113.820.869	100,0%	113.901.168	97,5%

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

Segmentos	1º Semestre/2024	%	2º Semestre/2023	%
Renda Fixa	575.448.826	80,5%	541.308.657	78,9%
Renda Variável	55.852.468	7,8%	64.566.090	9,4%
Investimentos Estruturados	76.287.368	10,7%	73.950.306	10,8%
Investimento no Exterior	7.395.901	1,0%	5.917.303	0,9%
Total	714.984.562	100,0%	685.742.356	99,1%

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

Segmentos	1º Semestre/2024	%	2º Semestre/2023	%
Renda Fixa	469.317.755	100,0%	469.461.380	100,0%
Renda Variável	-	0,0%	-	0,0%
Investimentos Estruturados	-	0,0%	-	0,0%
Investimento no Exterior	-	0,0%	-	0,0%
Total	469.317.755	100,0%	469.461.380	100,0%

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

Segmentos	1º Semestre/2024	%	2º Semestre/2023	%
Renda Fixa	6.661.720	100,0%	5.850.188	100,0%
Renda Variável	-	0,0%	-	-
Investimentos Estruturados	-	0,0%	-	-
Investimento no Exterior	-	0,0%	-	-
Total	6.661.720	100,0%	5.850.188	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	86,9%	54%	100%	100%
Renda Variável	5,2%	0%	25%	70%
Investimentos Estruturados	7,0%	0%	15%	20%
Investimento no Exterior	0,8%	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)	373.470.091	28,6%	28,6%
Western (MB III)	284.822.103	21,8%	21,8%
Santander (MB IV)	267.206.895	20,5%	20,5%
Bradesco (MB I)	208.765.305	16,0%	16,0%
Absolute (Absolute Vertex II FC FIM)	36.320.023	2,8%	2,8%
BNP (MB V)	36.288.579	2,8%	2,8%
JGP (JGP Strategy Estruturado FC FIM)	30.887.692	2,4%	2,4%
Gauss (Gauss FC FIM)	24.783.960	1,9%	1,9%
Arx Investimentos (Arx Income FIA)	20.177.434	1,5%	1,5%
Moat Capital (Moat Capital FIC FIA)	11.081.269	0,8%	0,8%
Schroder (Schroder Sust Ações Globais FIA IE)	10.983.824	0,8%	0,8%
Intrag	133.662	0,0%	0,0%
Total	1.304.920.837	100,0%	100,0%

Fontes: MB Prev e Intrag

pps portfolio
performance

Enquadramento

Valores a Receber/Pagar		Total (R\$)	Carteira	Fundos	Entidade	Limite Res. 4.994	Política de Investimentos¹	
							Mín.	Máx.
Total dos recursos garantidores		1.304.920.837	133.662	1.304.787.175	100,0%	-	-	-
Renda Fixa		1.135.873.651	133.662	1.135.739.990	87,0%	100%	54%	100%
Títulos Públicos		1.006.696.683	0	1.006.696.683	77,1%	100%	54%	100%
Títulos Privados		129.380.487	0	129.380.487	9,9%	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%	-	-
	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	129.380.487	0	129.380.487	9,9%	80%	0%	30%
Derivativos		-294.908	0	-294.908	0,0%	-	-	-
Valores a Receber/Pagar		-95.213	-5.316	-89.897	0,0%	-	-	-
Caixa		186.602	138.977	47.624	0,0%	-	-	-
Renda Variável		66.071.686	0	66.071.686	5,1%	70%	0%	25%
Ações		65.600.152	0	65.600.152	5,0%	70%	0%	25%
	Novo Mercado	41.774.405	0	41.774.405	3,2%	70%	-	-
	Nível 2	8.951.425	0	8.951.425	0,7%		-	-
	Nível 1	12.130.993	0	12.130.993	0,9%	50%	-	-
	Bovespa Mais	2.743.329	0	2.743.329	0,2%		-	-
Outros Ativos		1.665	0	1.665	0,0%	3%	-	-
Valores a Receber/Pagar		469.869	0	469.869	0,0%	-	-	-
Investimentos Estruturados		91.991.675	0	91.991.675	7,0%	20%	0%	15%
Fundos Multimercados		91.991.675	-	91.991.675	7,0%	10%	0%	10%
Investimento no Exterior		10.983.824	0	10.983.824	0,8%	10%	0%	10%
Fundos de Investimento no Exterior		10.983.824	-	10.983.824	0,8%	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	330.951	0,3%	442.253	0,0%	773.204	0,1%
Até 42	-	0,0%	-	0,0%	-	0,0%
Até 63	-	0,0%	50.963.117	5,1%	50.963.117	4,5%
Até 84	260.802	0,2%	730	0,0%	261.532	0,0%
Até 105	5.231.873	4,0%	-	0,0%	5.231.873	0,5%
Até 126	2.048.656	1,6%	-	0,0%	2.048.656	0,2%
Até 252	9.349.092	7,2%	804.787	0,1%	10.153.879	0,9%
Até 504	10.134.479	7,8%	118.419.689	11,8%	128.554.167	11,3%
Até 756	31.859.061	24,6%	106.813.147	10,6%	138.672.208	12,2%
Até 1008	18.555.795	14,3%	244.091.624	24,2%	262.647.419	23,1%
Acima de 1008	51.609.779	39,9%	485.319.578	48,2%	536.929.357	47,3%
Total	129.380.487	100,0%	1.006.854.925	100,0%	1.136.235.413	100,0%

Fonte: Intrag

Risco de crédito

Debêntures

CARACTERÍSTICAS DA EMISSÃO

Título	Carteira	Emitente	Valor	Rating	Agência	Vcto	Aquisição
DEB	MBPREV I	REDE D'OR SÃO LUIZ	921.366,68	--	--	08/11/2026	25/03/2022
DEB	MBPREVI III	COPEL GERAÇÃO E TRA	268.338,65	AA(bra)	FITCH	15/07/2024	30/01/2020
DEB	MBPREVI III	COLINAS	357.827,85	brAA+	S&P	15/06/2025	08/06/2021
DEB	MBPREVI III	HAPVIDA	284.054,12	--	--	22/09/2025	28/09/2020
DEB	MBPREVI III	ALUPAR	607.709,86	AAA(bra)	FITCH	15/10/2025	22/02/2024
DEB	MBPREVI III	ALUPAR	607.709,86	AAA(bra)	FITCH	15/10/2025	11/03/2024
DEB	MBPREVI III	SANTOS BRASIL PARTIC	617.765,28	brAAA	S&P	25/03/2026	04/11/2022
DEB	MBPREVI III	ELETROBRAS	406.859,30	brAAA	S&P	15/04/2026	24/06/2022
DEB	MBPREVI III	ELETROBRAS	1.344.199,95	brAAA	S&P	25/04/2026	17/05/2019
DEB	MBPREVI III	VIA VAREJO	117.574,21	brAA	S&P	30/04/2026	10/05/2021
DEB	MBPREVI III	ECORODOVIAS	989.364,69	brAAA	S&P	20/06/2026	22/06/2023
DEB	MBPREVI III	PAGUE MENOS	261.324,72	AA-(bra)	FITCH	15/07/2026	15/07/2022
DEB	MBPREVI III	MRS LOGÍSTA	654.065,84	AAA(bra)	FITCH	15/08/2026	22/09/2021
DEB	MBPREVI III	COGNA EDUCAÇÃO	813.079,78	AA+(bra)	FITCH	20/08/2026	20/08/2021
DEB	MBPREVI III	VAMOS	883.490,74	AA-(bra)	FITCH	20/08/2026	04/10/2021
DEB	MBPREVI III	MOVIDA	884.157,28	AA-(bra)	FITCH	15/09/2026	20/09/2021
DEB	MBPREVI III	COPASA	411.479,88	AAA.br	MOODY'S	15/09/2026	29/09/2021
DEB	MBPREVI III	VIA VAREJO	233.325,57	brAA	S&P	15/09/2026	29/09/2021
DEB	MBPREVI III	MINERVA	212.857,38	brAAA	S&P	15/10/2026	21/10/2021
DEB	MBPREVI III	LIGHT SERVIÇOS ELETRI	537.500,00	brAA+	S&P	15/10/2026	10/11/2021
DEB	MBPREVI III	COPEL GERAÇÃO E TRA	1.039.337,65	AAA(bra)	FITCH	15/10/2026	11/11/2021
DEB	MBPREVI III	LIGHT SERVIÇOS ELETRI	246.000,00	brAA+	S&P	15/10/2026	04/07/2022
DEB	MBPREVI III	ANHANGUERA BANDEI	650.580,32	AAA.br	MOODY'S	04/11/2026	21/02/2022
DEB	MBPREVI III	PAGUE MENOS	190.722,77	A+(bra)	FITCH	05/11/2026	25/02/2022
DEB	MBPREVI III	LOCALIZA	1.332.424,90	--	--	10/11/2026	08/12/2021
DEB	MBPREVI III	COLINAS	995.186,46	brAA+	S&P	15/12/2026	29/06/2022
DEB	MBPREVI III	LOCALIZA	126.182,18	AAA(bra)	FITCH	25/02/2027	11/03/2022
DEB	MBPREVI III	MOVIDA	358.598,51	AAA(bra)	FITCH	05/03/2027	15/03/2024

RATING ATUAL: Junho 2024

FITCH			MOODY'S			S&P		
Data	Rating	Class	Data	Rating	Class	Data	Rating	Class
-	A+(bra)	😊⇌	-	--	-	-	--	-
-	AAA(bra)	😊⇌	-	--	-	-	--	-
-	--	-	-	--	-	-	brAA+	😊⇌
-	AAA(bra)	😊⇌	-	--	-	-	--	-
-	AAA(bra)	😊⇌	-	--	-	-	--	-
-	AAA(bra)	😊⇌	-	--	-	-	--	-
-	--	-	-	--	-	-	brAAA	😊⇌
-	--	-	-	--	-	-	brAAA	😊⇌
-	--	-	-	--	-	-	brAAA	😊⇌
-	--	-	-	--	-	-	INDISP.	😞
-	--	-	-	--	-	-	brAAA	😊⇌
-	AA-(bra)	😊⇌	-	--	-	-	--	-
-	AAA(bra)	😊⇌	-	--	-	-	--	-
-	AA+(bra)	😊⇌	-	--	-	-	--	-
-	AAA(bra)	😊⇌	-	--	-	-	--	-
-	AAA(bra)	😊⇌	-	--	-	-	brAAA	😊⇌
-	--	-	-	AAA.br	😊⇌	-	--	-
-	--	-	-	--	-	-	INDISP.	😞
-	--	-	-	--	-	-	brAAA	😊⇌
-	--	-	-	--	-	-	D	😊⇌
-	AAA(bra)	😊⇌	-	--	-	-	--	-
-	--	-	-	--	-	-	D	😊⇌
-	--	-	-	AAA.br	😊⇌	-	--	-
-	AA-(bra)	😊⇌	-	--	-	-	--	-
-	--	-	-	--	-	-	brAAA	😊⇌
-	--	-	-	--	-	-	brAA+	😊⇌
-	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	MBPREVI III	LOG COMMERCIAL	690.590,33	brAA+	S&P	11/07/2027	11/07/2022
DEB	MBPREVI III	LOG COMMERCIAL	603.869,95	brAA+	S&P	11/07/2027	04/04/2024
DEB	MBPREVI III	CM HOSPITALAR	333.280,49	Aa.br	MOODYS	22/07/2027	25/07/2022
DEB	MBPREVI III	TUPY	260.429,91	brAAA	S&P	06/09/2027	06/09/2022
DEB	MBPREVI III	RUMO MALHA PAULIST	259.215,58	AAA(bra)	FITCH	15/10/2027	22/10/2021
DEB	MBPREVI III	AMERICANAS	976.705,17	AA+(bra)	FITCH	20/10/2027	11/11/2022
DEB	MBPREVI III	CM HOSPITALAR	571.096,32	Aa.br	MOODYS	27/10/2027	08/11/2022
DEB	MBPREVI III	SENDAS DISTRIBUIDOR	4.103,28	AAA(bra)	FITCH	26/11/2027	07/01/2022
DEB	MBPREVI III	SENDAS DISTRIBUIDOR	455.464,38	AAA(bra)	FITCH	26/11/2027	08/07/2022
DEB	MBPREVI III	SENDAS DISTRIBUIDOR	992.994,41	AAA(bra)	FITCH	26/11/2027	24/08/2022
DEB	MBPREVI III	SABESP	1.379.578,36	brAAA	S&P	15/07/2028	16/07/2021
DEB	MBPREVI III	ALGAR	268.869,99	brAAA	S&P	15/07/2028	12/08/2021
DEB	MBPREVI III	ALGAR	508.932,47	brAAA	S&P	15/07/2028	04/04/2024
DEB	MBPREVI III	TIM BRASIL	1.047.946,98	AAA(bra)	FITCH	25/07/2028	11/09/2023
DEB	MBPREVI III	COELBA	1.563.991,86	brAAA	S&P	15/08/2028	05/03/2024
DEB	MBPREVI III	B3	1.278.243,44	AAA(bra)	FITCH	11/10/2028	26/10/2023
DEB	MBPREVI III	CCR	948.506,29	brAAA	S&P	15/01/2029	14/02/2022
DEB	MBPREVI III	ALGAR	674.376,22	brAAA	S&P	15/01/2029	23/09/2022
DEB	MBPREVI III	ALGAR	270.175,96	brAAA	S&P	15/01/2029	16/11/2023
DEB	MBPREVI III	RAIA DROGASIL	354.650,81	AAA(bra)	FITCH	25/01/2029	16/02/2022
DEB	MBPREVI III	LOCALIZA	119.839,09	AAA(bra)	FITCH	25/02/2029	11/03/2022
DEB	MBPREVI III	ALIANÇA ENERGIA	1.757.953,91	AAA(bra)	FITCH	15/03/2029	19/04/2024
DEB	MBPREVI III	ARTERIS	1.331.020,57	brAA+	S&P	12/04/2029	12/04/2024
DEB	MBPREVI III	HYPERA	1.060.453,13	AAA.br	MOODYS	03/05/2029	23/05/2024
DEB	MBPREVI III	HAPVIDA	12.265,96	AAA(bra)	FITCH	10/05/2029	18/05/2022
DEB	MBPREVI III	HAPVIDA	208.521,35	AAA(bra)	FITCH	10/05/2029	02/09/2022
DEB	MBPREVI III	HAPVIDA	753.334,50	AAA(bra)	FITCH	10/05/2029	09/01/2023
DEB	MBPREVI III	COGNA EDUCAÇÃO	439.260,69	AA+(bra)	FITCH	15/05/2029	24/05/2024

RATING ATUAL: Junho 2024

FITCH			MOODY'S			S&P		
Data	Rating	Class	Data	Rating	Class	Data	Rating	Class
-	--	-	-	--	-	-	brAA+	😊⇌
-	--	-	-	--	-	-	brAA+	😊⇌
-	--	-	-	Aa.br	😊⇌	-	--	-
-	--	-	-	--	-	-	brAAA	😊⇌
-	AAA(bra)	😊⇌	-	--	-	-	--	-
-	INDISP.	😞	-	--	-	-	--	-
-	--	-	-	Aa.br	😊⇌	-	--	-
-	AAA(bra)	😊⇌	-	--	-	-	--	-
-	AAA(bra)	😊⇌	-	--	-	-	--	-
-	AAA(bra)	😊⇌	-	--	-	-	--	-
-	--	-	-	--	-	-	brAAA	😊⇌
-	--	-	-	--	-	-	brAA+	😊⇌
-	--	-	-	--	-	-	brAA+	😊⇌
-	AAA(bra)	😊⇌	-	--	-	-	--	-
-	--	-	-	--	-	-	brAAA	😊⇌
-	AAA(bra)	😊⇌	-	--	-	-	--	-
-	--	-	-	--	-	-	brAAA	😊⇌
-	--	-	-	--	-	-	brAA+	😊⇌
-	--	-	-	--	-	-	brAA+	😊⇌
-	AAA(bra)	😊⇌	-	--	-	-	--	-
-	AAA(bra)	😊⇌	-	--	-	-	--	-
-	AAA(bra)	😊⇌	-	--	-	-	--	-
-	--	-	-	--	-	-	brAA+	😊⇌
-	--	-	-	AAA.br	😊⇌	-	--	-
-	AAA(bra)	😊⇌	-	--	-	-	--	-
-	AAA(bra)	😊⇌	-	--	-	-	--	-
-	AAA(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	MBPREVI III	GERDAU	836.242,46	brAAA	S&P	29/05/2029	29/05/2024
DEB	MBPREVI III	NOVA TRANSPORTAD	985.926,61	AAA(bra)	FITCH	13/09/2029	06/10/2022
DEB	MBPREVI III	USIMINAS	1.423.422,70	brAAA	S&P	09/12/2029	12/12/2022
DEB	MBPREVI III	EQUATORIAL MARANH	778.750,71	brAAA	S&P	15/05/2030	24/05/2024
DEB	MBPREVI III	COPASA	615.831,02	AAA.br	MOODYS	15/09/2030	28/09/2023
DEB	MBPREVI III	SABESP	274.800,13	AAA(bra)	FITCH	20/02/2031	05/03/2024
DEB	MBPREVI III	REDE D'OR SÃO LUIZ	1.337.131,05	AAA(bra)	FITCH	25/07/2031	04/08/2023
DEB	MBPREVI III	LIGHT SERVIÇOS ELETRI	150.500,00	brAA+	S&P	30/12/2050	26/04/2022
DEB	MBPREV IV	COPEL GERAÇÃO E TRA	62.612,35	AA(bra)	FITCH	15/07/2024	30/01/2020
DEB	MBPREV IV	LOCALIZA	306.551,04	AAA(bra)	FITCH	10/05/2025	31/10/2023
DEB	MBPREV IV	ELETRORBRAS	639.851,46	brAAA	S&P	25/04/2026	17/05/2019
DEB	MBPREV IV	FERROVIA CENTRO ATL	701.412,07	brAAA	S&P	20/06/2026	30/06/2022
DEB	MBPREV IV	CIA ESTADUAL DISTRIB	82.658,71	brAA+	S&P	15/08/2026	25/08/2021
DEB	MBPREV IV	LOCALIZA	528.904,98	AAA(bra)	FITCH	05/10/2026	19/10/2022
DEB	MBPREV IV	LOCALIZA	236.209,99	AAA(bra)	FITCH	05/10/2026	19/10/2022
DEB	MBPREV IV	MAGAZINE LUIZA	268.042,57	brAAA	S&P	15/10/2026	15/10/2021
DEB	MBPREV IV	DASA	445.080,74	AAA(bra)	FITCH	30/10/2026	19/10/2022
DEB	MBPREV IV	DASA	140.297,19	AAA(bra)	FITCH	30/10/2026	20/10/2022
DEB	MBPREV IV	DASA	296.075,45	AAA(bra)	FITCH	30/10/2026	24/10/2022
DEB	MBPREV IV	ANHANGUERA BANDEI	481.222,90	AAA.br	MOODYS	04/11/2026	09/11/2021
DEB	MBPREV IV	PAULISTA FORÇA E LUZ	281.890,92	AAA(bra)	FITCH	12/12/2026	01/12/2023
DEB	MBPREV IV	REDE D'OR SÃO LUIZ	212.283,09	AAA(bra)	FITCH	20/12/2026	03/09/2021
DEB	MBPREV IV	ALIANÇA ENERGIA	895.519,13	AAA(bra)	FITCH	15/01/2027	01/02/2022
DEB	MBPREV IV	ARTERIS	437.936,49	brAA+	S&P	11/03/2027	24/03/2022
DEB	MBPREV IV	COMPANHIA ESTADUA	1.696.827,95	AAA.br	MOODYS	25/05/2027	08/06/2022
DEB	MBPREV IV	TELEFÔNICA	529.220,93	AAA.br	MOODYS	12/07/2027	14/07/2022
DEB	MBPREV IV	NOVA TRANSPORTAD	773.387,79	AAA(bra)	FITCH	13/09/2027	06/10/2022
DEB	MBPREV IV	IGUATEMI	169.290,96	AAA(bra)	FITCH	28/09/2027	07/12/2023

RATING ATUAL: Junho 2024

FITCH			MOODY'S			S&P		
Data	Rating	Class	Data	Rating	Class	Data	Rating	Class
-	--	-	-	--	-	-	brAAA	😊⇌
-	AAA(bra)	😊⇌	-	--	-	-	--	-
-	--	-	-	--	-	-	brAAA	😊⇌
-	--	-	-	--	-	-	brAAA	😊⇌
-	--	-	-	AAA.br	😊⇌	-	--	-
-	AAA(bra)	😊⇌	-	--	-	-	--	-
-	AAA(bra)	😊⇌	-	--	-	-	--	-
-	--	-	-	--	-	-	D	😞⇌
-	AAA(bra)	😊⇌	-	--	-	-	--	-
-	AAA(bra)	😊⇌	-	--	-	-	--	-
-	--	-	-	--	-	-	brAAA	😊⇌
-	--	-	-	--	-	-	brAAA	😊⇌
-	--	-	-	--	-	-	brAA+	😊⇌
-	AAA(bra)	😊⇌	-	--	-	-	--	-
-	AAA(bra)	😊⇌	-	--	-	-	--	-
-	--	-	-	--	-	-	brAA-	😊⇌
-	AA(bra)	😊⇌	-	--	-	-	--	-
-	AA(bra)	😊⇌	-	--	-	-	--	-
-	AA(bra)	😊⇌	-	--	-	-	--	-
-	--	-	-	AAA.br	😊⇌	-	--	-
-	AAA(bra)	😊⇌	-	--	-	-	--	-
-	AAA(bra)	😊⇌	-	--	-	-	--	-
-	AAA(bra)	😊⇌	-	--	-	-	--	-
-	--	-	-	--	-	-	brAA+	😊⇌
-	--	-	-	AAA.br	😊⇌	-	--	-
-	--	-	-	AAA.br	😊⇌	-	--	-
-	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 IV	AMERICANAS	95.220,00	AA+(bra)	FITCH	20/10/2027	11/11/2022
DEB	MBPREV IV	SENDAS DISTRIBUIDOR	166.182,95	AAA(bra)	FITCH	26/11/2027	17/10/2022
DEB	MBPREV IV	SENDAS DISTRIBUIDOR	166.182,95	AAA(bra)	FITCH	26/11/2027	17/10/2022
DEB	MBPREV IV	SENDAS DISTRIBUIDOR	135.225,23	AAA(bra)	FITCH	20/05/2028	17/10/2022
DEB	MBPREV IV	SENDAS DISTRIBUIDOR	185.805,67	AAA(bra)	FITCH	20/05/2028	19/10/2022
DEB	MBPREV IV	PIRATININGA FORÇA E	1.351.594,34	AAA(bra)	FITCH	05/06/2028	13/03/2024
DEB	MBPREV IV	COPEL DISTRIBUIÇÃO	276.553,67	AAA(bra)	FITCH	15/06/2028	06/12/2023
DEB	MBPREV IV	COPEL DISTRIBUIÇÃO	386.131,55	AAA(bra)	FITCH	15/06/2028	20/12/2023
DEB	MBPREV IV	ELETROBRAS	718.513,30	brAAA	S&P	15/09/2028	22/03/2024
DEB	MBPREV IV	ECORODOVIAS	412.286,73	brAAA	S&P	15/10/2028	09/01/2024
DEB	MBPREV IV	ENGIE	769.994,89	AAA(bra)	FITCH	15/11/2028	07/12/2023
DEB	MBPREV IV	NOVA TRANSPORTAD	715.794,22	AAA(bra)	FITCH	15/02/2029	16/02/2024
DEB	MBPREV IV	CEMIG DISTRIBUIÇÃO	85.117,53	AA+(bra)	FITCH	15/02/2029	15/03/2024
DEB	MBPREV IV	LOCALIZA	487.988,39	AAA.br	MOODYS	27/02/2029	07/03/2024
DEB	MBPREV IV	ELETROBRAS	818.084,90	brAAA	S&P	15/04/2029	19/04/2024
DEB	MBPREV IV	HAPVIDA	319.937,18	AAA(bra)	FITCH	10/05/2029	18/05/2022
DEB	MBPREV IV	FLEURY	174.283,46	AA+.br	MOODYS	17/05/2029	28/05/2024
DEB	MBPREV IV	B3	1.057.316,94	AAA(bra)	FITCH	28/05/2029	28/05/2024
DEB	MBPREV IV	GERDAU	125.083,31	brAAA	S&P	29/05/2029	29/05/2024
DEB	MBPREV IV	REDE D'OR SÃO LUIZ	309.620,31	AAA(bra)	FITCH	20/06/2029	08/12/2023
DEB	MBPREV IV	SANEPAR	243.632,94	AAA.br	MOODYS	15/01/2030	19/01/2024
DEB	MBPREV IV	CELG DISTRIBUIÇÃO	387.259,28	brAAA	S&P	20/03/2030	03/04/2024
DEB	MBPREV IV	COMPASS GÁS E ENERG	87.434,37	AAA(bra)	FITCH	01/11/2030	12/12/2023
DEB	MBPREV IV	COMPASS GÁS E ENERG	262.303,10	AAA(bra)	FITCH	01/11/2030	14/12/2023
DEB	MBPREV IV	COMPASS GÁS E ENERG	81.189,05	AAA(bra)	FITCH	01/11/2030	18/01/2024
DEB	MBPREV IV	ENERGIA ELETRICA PAU	346.760,75	AAA(bra)	FITCH	17/03/2031	28/03/2024
DEB	MBPREV IV	FERROVIA NORTE SUL	312.117,64	AAA(bra)	FITCH	22/03/2031	15/04/2024

RATING ATUAL: Junho 2024

FITCH			MOODY'S			S&P		
Data	Rating	Class	Data	Rating	Class	Data	Rating	Class
-	INDISP.	☹️	-	--	-	-	--	-
-	AAA(bra)	☺️⇌	-	--	-	-	--	-
-	AAA(bra)	☺️⇌	-	--	-	-	--	-
-	AAA(bra)	☺️⇌	-	--	-	-	--	-
-	AAA(bra)	☺️⇌	-	--	-	-	--	-
-	AAA(bra)	☺️⇌	-	--	-	-	--	-
-	AAA(bra)	☺️⇌	-	--	-	-	--	-
-	AAA(bra)	☺️⇌	-	--	-	-	--	-
-	--	-	-	--	-	-	brAAA	☺️⇌
-	--	-	-	--	-	-	brAAA	☺️⇌
-	AAA(bra)	☺️⇌	-	--	-	-	--	-
-	AAA(bra)	☺️⇌	-	--	-	-	--	-
-	AA+(bra)	☺️⇌	-	--	-	-	--	-
-	--	-	-	AAA.br	☺️⇌	-	--	-
-	--	-	-	--	-	-	brAAA	☺️⇌
-	AAA(bra)	☺️⇌	-	--	-	-	--	-
-	--	-	-	AAA.br	☺️⬆️	-	--	-
-	AAA(bra)	☺️⇌	-	--	-	-	--	-
-	--	-	-	--	-	-	brAAA	☺️⇌
-	AAA(bra)	☺️⇌	-	--	-	-	--	-
-	--	-	-	AAA.br	☺️⇌	-	--	-
-	--	-	-	--	-	-	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 SAFRA	887.140,08	AA+.br	MOODYS	07/02/2025	07/02/2022
LF	MBPREV I	BANCO SAFRA	5.527.565,14	AA+.br	MOODYS	07/02/2025	05/10/2022
LF	MBPREV I	BANCO SAFRA	809.979,72	AA+.br	MOODYS	17/03/2025	17/03/2022
LF	MBPREV I	BANCO SAFRA	1.257.331,91	AAA(bra)	FITCH	11/06/2026	10/06/2024
LF	MBPREV I	BANCO BTG PACTUAL	1.153.041,50	AA.br	MOODYS	22/06/2026	20/06/2024
LF	MBPREV I	BANCO VOTORANTIM	1.702.145,87	AA-.br	MOODYS	25/06/2026	25/06/2024
LF	MBPREV I	BANCO CITIBANK	1.704.541,49	AAA(bra)	FITCH	13/07/2026	12/07/2023
LF	MBPREV I	BANCO SAFRA	1.353.354,06	AAA(bra)	FITCH	20/08/2026	20/06/2024
LF	MBPREV II	BANCO SAFRA	2.934.386,43	AA+.br	MOODYS	07/02/2025	07/02/2022
LF	MBPREV II	BANCO SAFRA	2.024.949,31	AA+.br	MOODYS	17/03/2025	17/03/2022
LF	MBPREV II	BANCO SAFRA	2.263.197,45	AAA(bra)	FITCH	11/06/2026	10/06/2024
LF	MBPREV II	BANCO BTG PACTUAL	2.005.289,56	AA.br	MOODYS	22/06/2026	20/06/2024
LF	MBPREV II	BANCO VOTORANTIM	3.053.849,93	AA-.br	MOODYS	25/06/2026	25/06/2024
LF	MBPREV II	BANCO CITIBANK	4.602.262,01	AAA(bra)	FITCH	13/07/2026	12/07/2023
LF	MBPREV II	BANCO SAFRA	2.405.962,77	AAA(bra)	FITCH	20/08/2026	20/06/2024
LF	MBPREVI III	BANCO SAFRA	4.682.089,53	AA+.br	MOODYS	14/04/2025	14/04/2022
LF	MBPREVI III	BANCO ABC	1.201.498,01	AA.br	MOODYS	19/02/2026	19/02/2024
LF	MBPREVI III	BANCO VOTORANTIM	2.078.251,21	AA-.br	MOODYS	04/03/2026	04/03/2024
LF	MBPREVI III	BANCO BTG PACTUAL	2.234.414,03	AA.br	MOODYS	06/03/2026	06/03/2024
LF	MBPREVI III	BANCO BRADESCO	4.037.590,21	AA+.br	MOODYS	17/09/2027	14/02/2024
LF	MBPREV IV	BANCO ITAÚ	135.090,15	AA+.br	MOODYS	02/09/2024	30/09/2022
LF	MBPREV IV	BANCO ITAÚ	125.711,80	AA+.br	MOODYS	02/09/2024	30/09/2022
LF	MBPREV IV	BANCO HSBC	5.231.873,19	brAAA	S&P	04/10/2024	30/09/2022
LF	MBPREV IV	BANCO VOTORANTIM	1.056.716,35	AA-.br	MOODYS	21/10/2024	19/10/2022
LF	MBPREV IV	BANCO VOTORANTIM	991.940,05	AA-.br	MOODYS	25/10/2024	26/10/2022
LF	MBPREV IV	BANCO BTG PACTUAL	453.607,37	AA.br	MOODYS	01/07/2025	30/06/2023
LF	MBPREV IV	BANCO BRADESCO	811.592,16	AA+.br	MOODYS	23/12/2025	06/07/2023

RATING ATUAL: Junho 2024

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

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 IV	BANCO BTG PACTUAL	1.804.205,40	AA.br	MOODY'S	05/01/2026	03/01/2024
LF	MBPREV IV	BANCO CITIBANK	909.088,79	AAA(bra)	FITCH	13/07/2026	12/07/2023
LF	MBPREV IV	BANCO CITIBANK	1.050.878,87	AAA(bra)	FITCH	28/06/2027	26/06/2024
LF	MBPREV IV	BANCO BRADESCO	3.372.861,59	AA+.br	MOODY'S	11/11/2027	11/11/2022
LF	MBPREV IV	BANCO BRADESCO	3.973.829,91	AA+.br	MOODY'S	15/09/2028	15/09/2023

RATING ATUAL: Junho 2024

FITCH			MOODY'S			S&P		
Data	Rating	Class	Data	Rating	Class	Data	Rating	Class
-	AAA(bra)	☺⇌	-	AA.br	☺⇌	-	brAAA	☺⇌
-	AAA(bra)	☺⇌	-	--	-	-	--	-
-	AAA(bra)	☺⇌	-	--	-	-	--	-
-	AAA(bra)	☺⇌	-	AA+.br	☺⇌	-	brAAA	☺⇌
-	AAA(bra)	☺⇌	-	AA+.br	☺⇌	-	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	724.187.274	72,0%	63,8%	55,5%
LTN	20.135.379	2,0%	1,8%	1,5%
NTN-B	260.913.214	26,0%	23,0%	20,0%
NTN-F	0	0,0%	0,0%	0,0%
TOTAL	1.005.235.867	100,0%	88,6%	77,0%

Fontes: Intrag

Risco de crédito

EMISSION	Valor	%CP	%RF	%TOTAL
DEBÊNTURE SIMPLES	61.544.251	47,6%	5,4%	4,7%
LETRA FINANCEIRA	67.836.236	52,4%	6,0%	5,2%
CERTIFICADO DE DEPÓSITO BANCÁRIO	-	0,0%	0,0%	0,0%
LETRAS COMERCIAIS	-	0,0%	0,0%	0,0%
TOTAL	129.380.487	100,0%	11,4%	9,9%

EMISSION	Valor	% NÃO FINANCEIRO	%CP	%RF	%TOTAL
LOCALIZA RENT A CAR SA	3.138.101	5,1%	2,4%	0,3%	0,2%
REDE D OR SAO LUIZ SA	2.780.401	4,5%	2,1%	0,2%	0,2%
TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELETRICA SA	2.653.473	4,3%	2,1%	0,2%	0,2%
NOVA TRANSPORTADORA SUDESTE SA - NTS	2.475.109	4,0%	1,9%	0,2%	0,2%
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	2.335.560	3,8%	1,8%	0,2%	0,2%
SENDAS DISTRIBUIDORA S.A.	2.105.959	3,4%	1,6%	0,2%	0,2%
ARTERIS SA	1.768.957	2,9%	1,4%	0,2%	0,1%
ALGAR TELECOM SA	1.722.355	2,8%	1,3%	0,2%	0,1%
COMPANHIA ESTADUAL DE TRANSMISSAO DE ENERGIA ELETRICA	1.696.828	2,8%	1,3%	0,1%	0,1%
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAO PAULO SABESP	1.654.378	2,7%	1,3%	0,1%	0,1%
OUTROS	39.213.131	63,7%	30,3%	3,5%	3,0%
TOTAL	61.544.251	100,0%	47,6%	5,4%	4,7%

EMISSION	Valor	% FINANCEIRO	%CP	%RF	%TOTAL
BCO SAFRA SA	24.145.956	35,6%	18,7%	2,1%	1,9%
BRADESCO PROPRIOS	12.195.874	18,0%	9,4%	1,1%	0,9%
BANCO VOTORANTIM S.A.	8.882.903	13,1%	6,9%	0,8%	0,7%
BCO CITIBANK SA	8.266.771	12,2%	6,4%	0,7%	0,6%
BANCO BTG PACTUAL S A	7.650.558	11,3%	5,9%	0,7%	0,6%
BANCO HSBC SA	5.231.873	7,7%	4,0%	0,5%	0,4%
BCO ABC BRASIL SA	1.201.498	1,8%	0,9%	0,1%	0,1%
BANCO ITAU S/A	260.802	0,4%	0,2%	0,0%	0,0%
TOTAL	67.836.236	100,0%	52,4%	6,0%	5,2%

Os Maiores Emissores de Renda Variável

EMPRESA	R\$	%RV	%TOTAL
VALE SA	6.360.597	9,7%	0,5%
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	5.214.910	7,9%	0,4%
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	2.888.764	4,4%	0,2%
ITAUSA SA	2.393.186	3,6%	0,2%
BRDESCO PROPRIOS	2.310.369	3,5%	0,2%
SUZANO S.A.	2.073.292	3,2%	0,2%
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBRAS	2.040.653	3,1%	0,2%
BRF SA	1.898.041	2,9%	0,1%
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	1.735.696	2,6%	0,1%
SANTOS BRASIL PARTICIPACOES SA	1.604.959	2,4%	0,1%
OUTROS	37.079.685	56,5%	2,8%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	65.600.152	100,0%	5,0%

Fontes: Intrag

Os Maiores Emissores Instituições Financeiras

EMPRESA	R\$	% Inst. Financ.	%TOTAL
BCO SAFRA SA	24.145.956	31,9%	1,9%
BRDESCO PROPRIOS	14.506.243	19,2%	1,1%
BANCO VOTORANTIM S.A.	8.882.903	11,7%	0,7%
BCO CITIBANK SA	8.266.771	10,9%	0,6%
BANCO BTG PACTUAL S A	8.224.371	10,9%	0,6%
BANCO HSBC SA	5.231.873	6,9%	0,4%
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	2.888.764	3,8%	0,2%
BBSA	1.224.814	1,6%	0,1%
BCO ABC BRASIL SA	1.201.498	1,6%	0,1%
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	886.723	1,2%	0,1%
TOTAL INST. FINANCEIRAS	75.720.719	100,0%	5,8%

Fontes: Intrag

Rentabilidade dos Investimentos

MB Prev / Benchmarks	Retorno dos Investimentos*						
	1º Tri/24	2º Tri/24	1º Sem/24	3º Tri/23	4º Tri/23	2º Sem/23	12 Meses
Perfil Conservador							
MB Prev	2,66%	2,50%	5,22%	3,26%	2,82%	6,17%	11,71%
Benchmark: IMA-S	2,69%	2,56%	5,32%	3,28%	2,82%	6,20%	11,85%
Perfil Moderado							
MB Prev	1,91%	1,13%	3,06%	1,95%	4,10%	6,13%	9,37%
Benchmark MBPREV MOD*	1,97%	1,78%	3,78%	2,34%	4,06%	6,49%	10,52%
Perfil Arrojado							
MB Prev	1,56%	0,97%	2,54%	1,51%	5,15%	6,73%	9,45%
Benchmark MBPREV ARR**	1,72%	1,72%	3,48%	2,00%	5,00%	7,10%	9,45%
Total							
Meta Atuarial***	2,81%	2,31%	5,19%	1,21%	1,76%	2,99%	8,34%

Rentabilidade da Cota Contábil

MB Prev / Benchmarks	Retorno dos Investimentos*						
	1º Tri/24	2º Tri/24	1º Sem/24	3º Tri/23	4º Tri/23	2º Sem/23	12 Meses
Perfil Conservador							
MB Prev	2,67%	2,55%	5,29%	3,26%	2,84%	6,19%	11,81%
Benchmark: IMA-S	2,68%	2,56%	5,31%	3,28%	2,82%	6,18%	11,83%
Perfil Moderado							
MB Prev	1,91%	1,12%	3,05%	1,97%	4,12%	6,17%	9,41%
Benchmark MBPREV MOD*	1,90%	1,58%	3,51%	2,14%	4,12%	6,35%	10,08%
Perfil Arrojado							
MB Prev	1,56%	0,98%	2,55%	3,52%	5,20%	6,80%	9,52%
Benchmark MBPREV ARR**	1,58%	1,13%	2,73%	1,63%	5,16%	6,87%	9,79%
Total							
Meta Atuarial***	2,82%	2,31%	5,19%	1,23%	1,80%	3,06%	8,40%

*BENCH. MBPREV (MOD)

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

**BENCH. MBPREV (ARR)

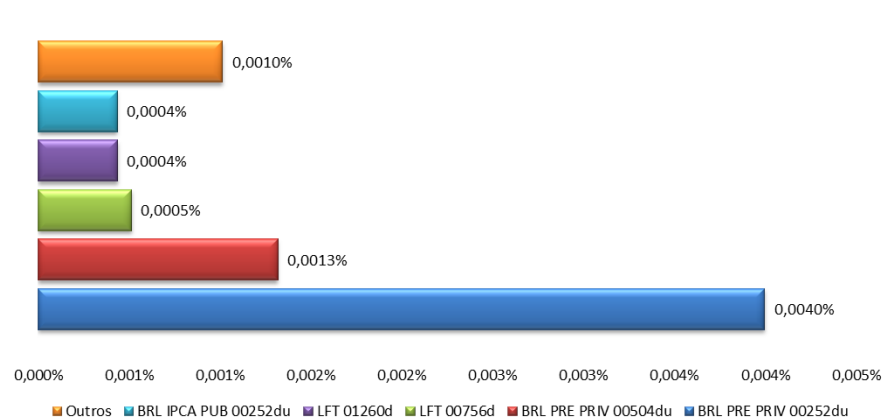
2023: 49% IMA-S + 21% IMA-B 5 + 15% IBX + 10% IHFA + 5% MSCI ACWI

***META ATUARIAL

2023: INPC + 4% a.a.
2024: INPC + 4,95% a.a.

Risco do Mercado – Conservador

Contribution VaR

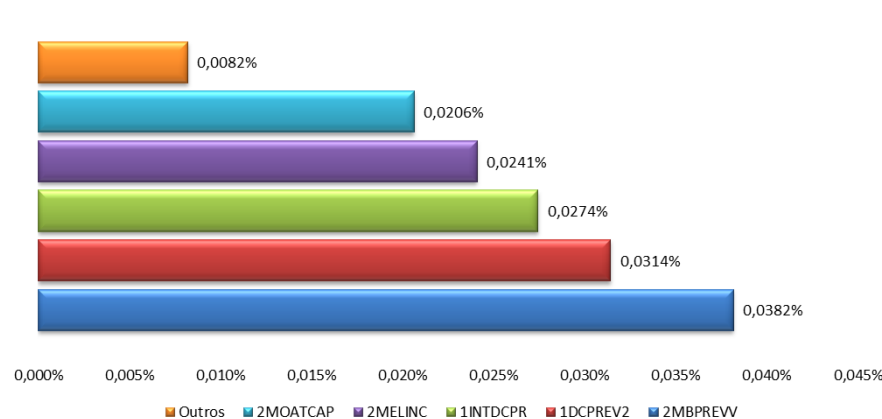


VaR - Instrumentos



Risco do Mercado – Moderado

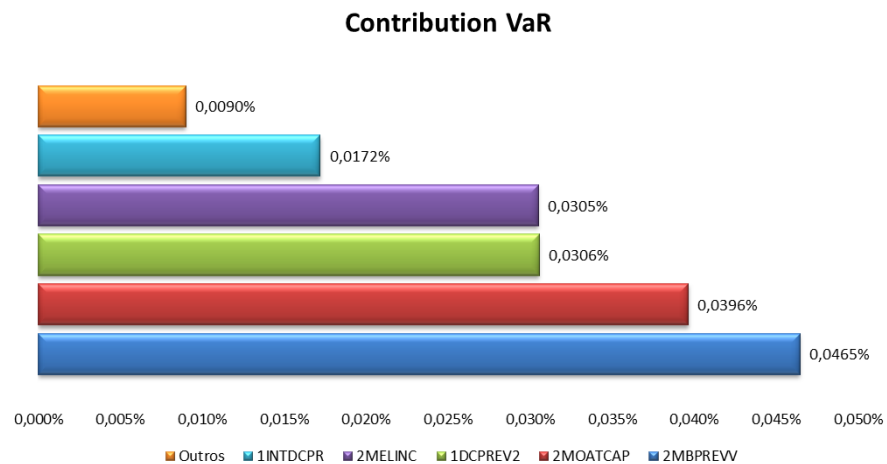
Contribution VaR



VaR - Instrumentos



Risco do Mercado – Arrojado



VaR - Instrumentos



Custo da Administração – Taxa de Gestão e Administração

Mês	MBPrev I (BRAM)	MBPrev II (BRAM)	MBPrev III (WESTERN)	MBPrev IV (SAM)	MBPrev V (BNP)	Intrag	Total
Janeiro	19.163,15	45.099,47	28.855,88	22.519,75	9.295,89	34.931,46	159.865,60
Fevereiro	22.271,27	48.268,70	31.746,84	26.714,01	9.397,64	30.433,14	168.831,60
Março	17.339,67	40.648,23	26.760,77	21.057,08	8.309,13	32.157,45	146.272,33
Abril	19.026,14	44.565,27	29.698,33	23.483,37	9.059,06	35.382,13	161.214,30
Maio	18.524,01	42.176,23	28.223,39	23.089,21	8.100,51	34.066,08	154.179,43
Junho	16.669,90	41.466,67	28.446,04	21.097,76	7.325,56	32.731,77	147.737,70
Total	112.994,14	262.224,57	173.731,25	137.961,18	51.487,79	199.702,03	938.100,96

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	45.208,71	1.036,10	36.088,02	-	-	-	-	242.198,43	1.277.597.851,51	0,23%
Fevereiro	39.790,64	1.167,24	34.738,41	117,60	-	3.385,00	-	248.030,49	1.280.954.365,56	0,23%
Março	39.790,64	1.011,08	34.831,30	5.052,45	23.410,00	-	-	250.367,80	1.289.100.439,17	0,23%
Abril	41.816,75	1.282,32	35.007,89	-	-	3.543,00	-	242.864,26	1.291.605.828,81	0,23%
Mai	45.703,41	1.298,76	31.975,24	144.326,90	-	-	2,48	377.486,22	1.297.883.135,87	0,35%
Junho	42.356,98	1.397,40	32.213,10	189,63	-	3.385,00	398,88	227.678,69	1.301.528.424,95	0,21%
Total do Período	254.667,13	7.192,90	204.853,96	149.686,58	23.410,00	10.313,00	401,36	1.588.625,89	1.301.528.424,95	0,12%
									Custo Anualizado:	0,24%

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

Mês	Taxa de Controladoria	Taxa Cálculo Risco	Extrato CBLC B3	Total
Janeiro	24.999,84	4.097,45	-	29.097,29
Fevereiro	21.911,93	4.097,45	-	26.009,38
Março	23.099,97	4.097,45	-	27.197,42
Abril	25.307,02	4.097,45	-	29.404,47
Maio	24.404,76	4.097,45	-	28.502,21
Junho	23.503,03	4.097,45	-	27.600,48
Total	143.226,55	24.584,70	0,00	167.811,25

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.