

RESUMO DO DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS - 2021

MSD PREV

31-dez-21

Plano MSD PREV
CNPB 1998004783

CARTEIRA PRÓPRIA R\$ 640.109.146,62

Renda Fixa

Títulos Públicos	R\$ 0,00
Títulos Privados	R\$ 0,00
Operações Compromissadas	R\$ 0,00
Debêntures	R\$ 0,00

Renda Variável

Ações	R\$ 0,00
-------	----------

Derivativos

Opções	R\$ 0,00
Termos	R\$ 0,00
Futuros	R\$ 0,00
Swaps	R\$ 0,00

Outros

Empréstimos/Financiamentos	R\$ 0,00
Carteira Imobiliária	R\$ 0,00
Valores a Pagar/Receber	-R\$ 74.352,63
Participações em SPE	R\$ 0,00
Depósitos	R\$ 0,00
Fundos	R\$ 640.183.499,25

FUNDOS EXCLUSIVOS - QUADRO DE OPERAÇÕES
R\$ 234.506.766,05

Nome do Fundos	Tipo	Descrição	Emissor	Quantidade	Financeiro (XML)
GLADIADOR FUNDO DE INVESTI	Caixa	Valor a Receber		48.367,8200	R\$ 48.367,82
GLADIADOR FUNDO DE INVESTI	Caixa	Valor a Pagar		-56.962,1700	-R\$ 56.962,17
GLADIADOR FUNDO DE INVESTI	Caixa	Caixa		2.000,0000	R\$ 2.000,00
GLADIADOR FUNDO DE INVESTI	Fundo	DO DE INVEST	APEX EQUITY HEDGE FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	1.452.468,1241	R\$ 3.748.680,86
GLADIADOR FUNDO DE INVESTI	Fundo	INVESTIMENT	BRACCO FUNDO DE INVESTIMENTOS MULTIMERCADO	2.556.115,6297	R\$ 3.339.235,33
GLADIADOR FUNDO DE INVESTI	Fundo	EM COTAS E	OCCAM INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO II	5.548.659,8702	R\$ 12.304.369,33
GLADIADOR FUNDO DE INVESTI	Fundo	EM COTAS DE	CANVAS VECTOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	6.481.992,0820	R\$ 8.211.051,74
GLADIADOR FUNDO DE INVESTI	Fundo	EM COTAS I	OCCAM EQUITY HEDGE FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	1.307.631,5882	R\$ 4.291.648,78
GLADIADOR FUNDO DE INVESTI	Fundo	DO DE INVE	ITAÚ GLOBAL DINÂMICO PLUS MULTIMERCADO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	527.598,3520	R\$ 7.553.455,19
GLADIADOR FUNDO DE INVESTI	Fundo	EM COTAS DI	CANVAS ENDURO III FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	3.148.913,9545	R\$ 9.482.704,51
GLADIADOR FUNDO DE INVESTI	Fundo	DO DE INVE	VERSA LONG BIASED FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	121.309,1770	R\$ 1.317.521,72
GLADIADOR FUNDO DE INVESTI	Fundo	IMENTO EM C	GUEPARDO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	2.085.658,2747	R\$ 9.511.373,18
GLADIADOR FUNDO DE INVESTI	Fundo	IRTO PRAZO C	ITAÚ CUSTÓDIA RENDA FIXA CURTO PRAZO CAIXA FUNDO DE INVESTIMENTO	5.849,3424	R\$ 144.568,37
GLADIADOR FUNDO DE INVESTI	Fundo	E INVESTIMEN	ITAÚ HEDGE PLUS MULTIMERCADO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	168.193,1032	R\$ 2.282.067,91
GLADIADOR FUNDO DE INVESTI	Fundo	COTAS DE FUJ	KADIMA II FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	807.388,7286	R\$ 3.164.864,44
GLADIADOR FUNDO DE INVESTI	Fundo	A QUOTAS DE	KAPITALO K10 FUNDO DE INVESTIMENTO EM QUOTAS DE FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	1.453.737,2823	R\$ 2.158.438,90
GLADIADOR FUNDO DE INVESTI	Fundo	EM QUOTAS I	KAPITALO KAPPA FIN FUNDO DE INVESTIMENTO EM QUOTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	974.151,2220	R\$ 3.134.746,06
GLADIADOR FUNDO DE INVESTI	Fundo	EM COTAS I	KINEA IPCA ABSOLUTO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	4.327.393,2648	R\$ 6.189.108,08
GLADIADOR FUNDO DE INVESTI	Fundo	IMENTO EM COT	MOAT CAPITAL EQUITY HEDGE FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	3.242.800,6175	R\$ 6.016.840,79
GLADIADOR FUNDO DE INVESTI	Fundo	EM COTAS DE	SPARTA DINÂMICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	1.590.574,7312	R\$ 3.986.148,64
GLADIADOR FUNDO DE INVESTI	Fundo	EM COTAS D	ABSOLUTE VERTEX II FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	11.368.683,5315	R\$ 21.544.530,79
GLADIADOR FUNDO DE INVESTI	Fundo	EM COTAS DE	VINLAND MACRO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	5.313.295,3616	R\$ 6.961.203,29
GLADIADOR FUNDO DE INVESTI	Fundo	EM COTA!	VISTA MULTIESTRATÉGIA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO	602.583,8349	R\$ 3.155.061,43
GLADIADOR FUNDO DE INVESTI	Fundo	NMENT INVE	BB AÇÕES NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR FUNDO DE INVESTIMENTO	2.835.884,0159	R\$ 8.356.381,46
GLADIADOR FUNDO DE INVESTI	Fundo	EM COTAS I	BOGARI VALUE FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	989,9215	R\$ 3.648.250,27
GLADIADOR FUNDO DE INVESTI	Fundo	STIMENTO EM	CONSTELLATION INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	1.938.818,4511	R\$ 4.929.881,27
GLADIADOR FUNDO DE INVESTI	Fundo	ESTIMENTO E	EQUITAS SELECTION INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	1.420.283,4997	R\$ 3.555.040,61
GLADIADOR FUNDO DE INVESTI	Fundo	DO DE INVE	FATOR SINERGIA FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	575,0154	R\$ 993.764,11
GLADIADOR FUNDO DE INVESTI	Fundo	DO DE INVESTI	GTI HAIFA FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	1.954.918,7294	R\$ 4.413.243,32
GLADIADOR FUNDO DE INVESTI	Fundo	DE INVESTIME	INOVE FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	2.305.676,7241	R\$ 3.751.472,41
GLADIADOR FUNDO DE INVESTI	Fundo	EM COTAS	LEBLON AÇÕES II FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	47.431,8599	R\$ 7.640.094,97
GLADIADOR FUNDO DE INVESTI	Fundo	DE INVESTIM	LIS VALUE FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	579.995,5986	R\$ 2.042.381,83
GLADIADOR FUNDO DE INVESTI	Fundo	EM COTAS I	MOAT CAPITAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	2.505.322,5522	R\$ 8.445.416,52
GLADIADOR FUNDO DE INVESTI	Fundo	TO FUNDO DE	CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	2.743.924,4837	R\$ 9.875.504,68
GLADIADOR FUNDO DE INVESTI	Fundo	PB FUNDO DE I	SAFRA CONSUMO AMERICANO REAIS PB FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES BDR NÍVEL I	27.267,1217	R\$ 2.917.975,32
GLADIADOR FUNDO DE INVESTI	Fundo	DO DE INVEST	RUNNER PIPE FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	1.911.903,8672	R\$ 2.286.574,31
GLADIADOR FUNDO DE INVESTI	Fundo	IDO DE INVE	SAFRA CONSUMO AMERICANO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES BDR-NÍVEL I PB	13.090,9609	R\$ 10.231.559,32
GLADIADOR FUNDO DE INVESTI	Fundo	IDOS FUNDO E	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	1.162.688,0626	R\$ 5.142.480,59
GLADIADOR FUNDO DE INVESTI	Fundo	DO DE INVE	VINCI MOSAICO FUNDO DE INVESTIMENTO DE ACOES	1.334.784,1328	R\$ 8.879.674,94
GLADIADOR FUNDO DE INVESTI	Fundo	IXA FUNDO DE	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIM	1.374.866,6852	R\$ 25.906.045,13

FUNDOS EXCLUSIVOS - RESUMO
R\$ 234.506.766,05
Renda Fixa

Títulos Públicos	R\$ 0,00
Títulos Privados	R\$ 0,00
Operações Compromissadas	R\$ 0,00
Debêntures	R\$ 0,00

Renda Variável

Ações	R\$ 0,00
-------	----------

Derivativos

Opções	R\$ 0,00
Termos	R\$ 0,00
Futuros	R\$ 0,00
Swaps	R\$ 0,00

Outros

Empréstimos/Financiamentos	R\$ 0,00
Carteira Imobiliária	R\$ 0,00
Valores a Pagar/Receber	-R\$ 6.594,35
Participações em SPE	R\$ 0,00
Depósitos	R\$ 0,00
Fundos	R\$ 234.513.360,40

FUNDOS DE INVESTIMENTOS (1º NÍVEL) - NÃO EXCLUSIVOS
R\$ 405.676.733,20

Fundos	Quantidade	CNPJ	Financeiro (XML)
107 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	916,3593	23.872.753/0001-92	1.617.019,3300
143 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	619,4263	34.735.229/0001-96	788.989,3700
WESTERN ASSET PREV FIX TARGET RENDA FIXA FI	18.797,0344	07.892.298/0001-30	92.447.592,9800
WESTERN ASSET INFLATION II RENDA FIXA FI	94,7105	05.092.294/0001-42	578.943,5600
137 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	179.416,4826	29.983.496/0001-42	200.277.238,5900
WESTERN ASSET PREV INFLAÇÃO IMPLÍCITA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	14.953.607,7562	09.087.314/0001-48	36.440.953,6700
WESTERN ASSET SOVEREIGN IV SELIC RENDA FIXA REFERENCIADO FUNDO DE INVESTIMENTO	3.771,1255	15.477.891/0001-49	11.794.010,6300
WESTERN ASSET PREV STRUCTURED CREDIT FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CREDITO PRIVADO	625,5892	12.029.811/0001-02	29.003.859,0000
WESTERN ASSET DEBÊNTURES INFRAESTRUTURA FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	6.189,1990	29.983.516/0001-85	6.923.032,1700
WESTERN ASSET PREV CREDIT RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO CRÉDITO PRIVADO	35,4988	09.087.708/0001-04	1.437.970,3300
WESTERN ASSET FUNDO DE INVESTIMENTO AÇÕES BDR NÍVEL I	3.167,1322	19.831.126/0001-36	24.367.123,5700

Observações:

1) Os recursos dos planos administrados pela EFPC são formados pelos ativos disponíveis e de investimentos, deduzidos de suas correspondentes exigibilidades, não computados os valores referentes a dívidas contratadas com os patrocinadores (Resolução CMN 3792/2009, art. 3º):

+ 1.1.0.0.00.00.00 Disponível

+ 1.2.3.0.00.00.00 Investimentos

- 2.1.3.0.00.00.00 Exigível Operacional – Investimentos

- 2.2.3.0.00.00.00 Exigível Contingencial – Investimentos

2) O valor das cotas dos fundos de investimento e dos fundos de investimento em cotas de fundos de investimento usado na consolidação contábil é:

a) O valor informado no arquivo de posição do próprio fundo; ou

b) O valor informado na tela "Cota de Fundos" nos casos de dispensa de envio do arquivo (§ 4º do art. 10º da Instrução PREVIC nº 02, de 18/05/2010).

3) A metodologia de cálculo de conciliação dos ativos é aquela adotada pelo Layout do Arquivo de Posição de Fundos e Carteiras definido pela ANBIMA - Associação Brasileira das Entidades dos Mercados Financeiro e de Capitais.

RESUMO DA POLÍTICA DE INVESTIMENTO 2022

Informações da Entidade

Plano de Benefícios:	1998.0047-83 PLANO DE APOSENTADORIA MSD PREV / PLANO ADMINISTRATIVO PGA	Exercício: 2022
----------------------	---	-----------------

Taxa Mínima Atuarial / Índice de Referência

Indexador por Plano/Segmento - Período de Referência: 01/2022 a 12/2022

	Plano/Segmento	Percentual Indexador	Indexador	Taxa de Juros %aa
-	PLANO	100%	CDI	4,00%
1	RENDA FIXA	100%	CDI	1,50%
2	RENDA VARIÁVEL	100%	IBO	3,00%
3	INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	100%	IHFA	0,75%
4	IMOBILIÁRIO	100%	CDI	1,50%
6	INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	100%	CDI	5,00%

Documentação/Responsáveis

Documentação

Nº da Ata:	null	Data:	
------------	------	-------	--

Alçadas

Período	Nome	Cargo
01/01/2022 a 31/12/2022	Camina Cristina Zanatta	Administrador Responsável pelo Plano de Benefícios (ARPB)
01/01/2022 a 31/12/2022	Fabio Frochtengarten	Administrador Estatutário Tecnicamente Qualificado (AETQ)
01/01/2022 a 31/12/2022	Fabio Frochtengarten	Administrador Responsável pela Gestão de Riscos

Controle de Risco

Risco de Mercado	Risco de Liquidez	Risco de Contraparte
Risco Legal	Risco Operacional	Outros

Realiza o apreçamento de ativos financeiros:	SIM	Dispõe de Manual:	SIM
Possui modelo proprietário de risco:	NÃO	Dispõe de Manual:	NÃO
Realiza Estudos de ALM:			NÃO

Observações

--

Alocação dos Recursos

Período de Referência: 01/2022 a 12/2022			
Segmento	Mínimo %	Máximo %	Alvo %
RENDA FIXA	0%	100%	60%
RENDA VARIÁVEL	0%	36%	15%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	0%	20%	15%
IMOBILIÁRIO	0%	1%	0%
OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES	0%	0%	0%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	0%	10%	10%

A EFPC observa os princípios de responsabilidade socioambiental?	SIM
Utiliza derivativos?	SIM
Avaliação prévia dos riscos envolvidos?	SIM
Existência de sistemas de controles internos?	SIM

Observações

--

Perfis de Investimento

O plano possui Perfis de Investimentos?	NÃO
---	-----

Observações

--

Alocação por Emissor

Emissor	Mínimo%	Máximo%	Não Aplica
TESOURO NACIONAL	0%	100%	
INSTITUIÇÃO FINANCEIRA	0%	20%	
TESOURO ESTADUAL OU MUNICIPAL	0%	100%	
COMPANHIA ABERTA COM REGISTRO NA CVM	0%	20%	
ORGANISMO MULTILATERAL	0%	20%	
COMPANHIA SECURITIZADORA	0%	20%	
PATROCINADOR DO PLANO DE BENEFÍCIO	0%	20%	
FIDC/FICFIDC	0%	20%	
FUNDOS DE ÍNDICE REFERENCIADO EM CESTA DE AÇÕES DE CIA ABERTA	0%	20%	
SOCIEDADE DE PROPÓSITO ESPECÍFICO - SPE	0%	20%	
FI/FICFI CLASSIFICADOS NO SEGMENTO DE INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	0%	20%	

Observações

--

Concentração por Emissor

Emissor	Mínimo%	Máximo%	Não Aplica
% DO CAPITAL TOTAL DE UMA MESMA CIA ABERTA OU DE UMA SPE	0%	25%	
% do Capital Votante de uma mesma Companhia Aberta	0%	25%	
% do PL de uma mesma Instituição Financeira	0%	25%	
% do PL de um FIDC ou FICFIDC	0%	25%	
% do PL de Fundo de Índice de renda fixa ou de ações de Companhia Aberta	0%	25%	
% do PL de um fundo classificado no segmento estruturado	0%	25%	

% do PL de um Fundo Imobiliário (FII) ou FICFII	0%	25%	
% do PL de FI que aplicam em cotas de fundos de índice no exterior, BDRs nível I ou que invistam no	0%	25%	
% do Patrimônio Separado de Certificado de Recebíveis com Regime Fiduciário	0%	25%	
% do PL do emissor de debêntures emitidas por sociedade por ações de capital fechado	0%	15%	
% do PL de fundos constituídos no exterior que são investidos por meio de fundos brasileiros que invistam no mínimo 67% em FIs no exterior	0%	15%	
% de uma mesma série de títulos ou valores mobiliários	0%	25%	
Observações			

Concentração por Investimento			
Emissor	Mínimo%	Máximo%	Não Aplica
% DE UMA SÉRIE DE TÍTULOS OU VALORES MOBILIÁRIOS	0%	25%	
% DE UMA MESMA CLASSE OU SÉRIE DE COTAS DE FIDC	0%	25%	
% DE UM MESMO EMPREENDIMENTO IMOBILIÁRIO			x
Observações			

Rentabilidade(%)				
Plano/Segmento	2018	2019	2020	2021
PLANO	7,69%	10,68%	5,75%	0,94%
RENDA FIXA	8,56%	8,01%	4,66%	0,64%
RENDA VARIÁVEL	0,00%	18,58%	1,34%	-4,79%
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	2,98%	8,36%	2,49%	2,60%
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	4,26%	30,37%	39,19%	18,82%
IMÓVEIS				
OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES				
Observações				