

MULTIBRA INSTITUIDOR_803000_ACRICEL_CONSERVADORA FIX

ABRIL/2021



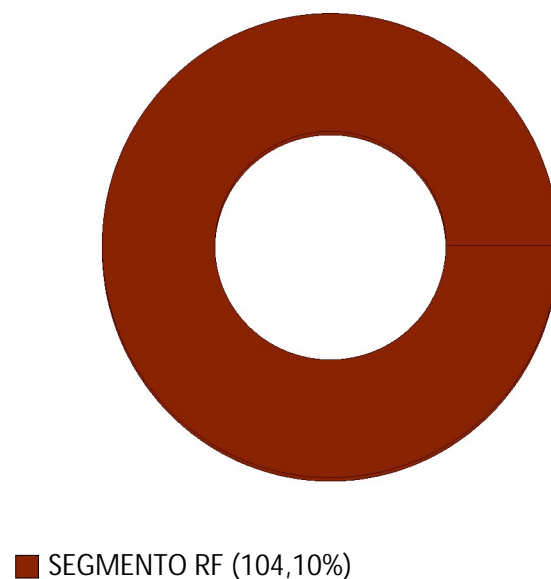
MULTIBRA INSTITUIDOR_803000_ACRICEL_CONSERVADORA FIX

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA

ATIVOS	FINANCEIRO	% PL
SEGMENTO RF	35.399,52	104,13
LTN 03/05/2021<O>	10.144,78	29,84
LF252 BRADESCO 27/03/2023	2.329,58	6,85
LFT 01/03/2022	2.007,81	5,91
LFSN BRADESCO 14/07/2025	1.418,71	4,17
LFT 01/09/2025	1.378,31	4,05
LFT 01/09/2023	1.025,64	3,02
FUT DI1F24	908,35	2,67
LFT 01/09/2021	894,85	2,63
LTN 03/05/2021<O>	822,55	2,42
Outros	14.468,94	42,56
OUTROS VALORES	-12,61	-0,04
01-Tesouraria	0,05	0,00
02-Pagar/receber	-12,66	-0,04
PL LÍQUIDO EM 30/04/2021	33.995,99	

Valores em milhares

POSIÇÃO CONSOLIDADA POR TIPO DE ATIVO*

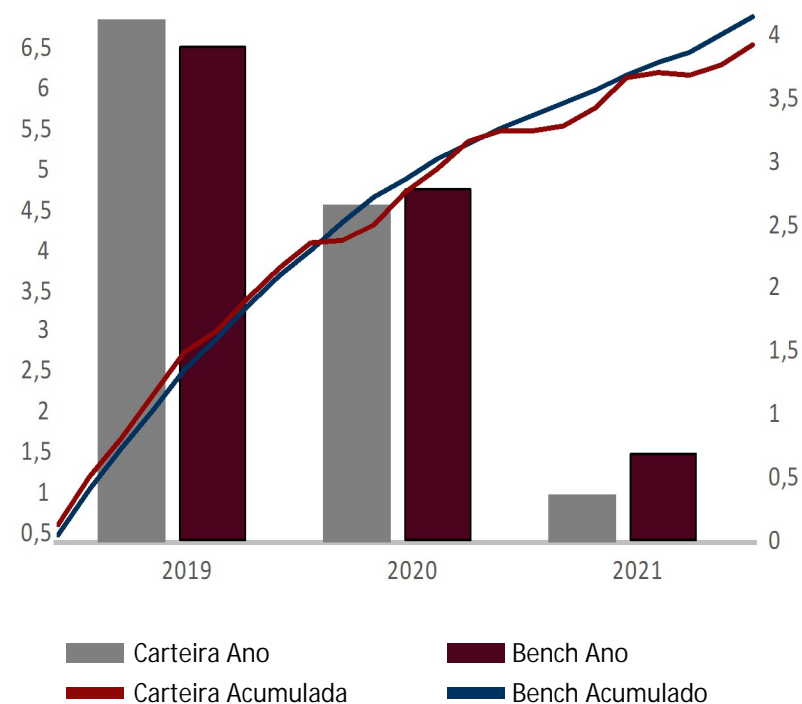


*Posição Consolidada por Tipo de Ativo: O gráfico Posição Consolidada por Tipo de Ativo não leva em consideração valores a liquidar e saldo em tesouraria.

RESULTADO GLOBAL

MÊS	2021		2020	
	RETORNO DO FUNDO (%)	DISTÂNCIA DO BENCHMARK (P.P.)	RETORNO DO FUNDO (%)	DISTÂNCIA DO BENCHMARK (P.P.)
Jan	0,05	-0,099	0,38	-0,001
Fev	-0,02	-0,159	0,29	-0,003
Mar	0,11	-0,088	0,05	-0,291
Abr	0,23	0,023	0,16	-0,124
Mai	-	-	0,41	0,167
Jun	-	-	0,27	0,060
Jul	-	-	0,31	0,118
Ago	-	-	0,13	-0,032
Set	-	-	0,00	-0,161
Out	-	-	0,07	-0,088
Nov	-	-	0,19	0,045
Dez	-	-	0,37	0,206

RENTABILIDADE X BENCH



HISTÓRICO DE RENTABILIDADE	6 M	12 M	24 M	36 M	2021	2020	2019	2018	2017	DESDE INÍCIO
Retorno do fundo (%)	0,93	2,14	-	-	0,37	2,66	4,12	-	-	7,28
Retorno do benchmark (%)	1,01	2,15	-	-	0,69	2,77	3,90	-	-	7,52
Distância do benchmark (p.p.)	-0,07	-0,01	-	-	-0,32	-0,11	0,22	-	-	-0,23

Data de início: 26/04/2019

Benchmark: CDI

MULTIBRA INSTITUIDOR_803000_ACRICEL_CONSERVADORA FIX

INDICADORES FINANCEIROS

ÍNDICES	ABRIL	2021	6 MESES	12 MESES	24 MESES	36 MESES
Retorno do fundo	0,23%	0,37%	0,93%	2,14%	-	-
CDI	0,21%	0,69%	1,01%	2,15%	7,46%	14,28%
IPCA	1,15%	3,69%	5,62%	7,50%	10,03%	15,65%
IGP-M	1,51%	9,89%	14,58%	32,02%	40,84%	53,01%
PTAXV	-5,16%	3,98%	-6,38%	-0,43%	36,96%	55,23%
IBOVESPA	1,94%	-0,10%	26,55%	47,68%	23,39%	38,06%
IBX50	2,90%	2,08%	29,80%	53,43%	25,21%	38,51%
IBXM BRASIL	2,84%	2,09%	28,66%	51,24%	28,38%	44,99%
IMA-B	0,65%	-2,17%	4,63%	9,66%	19,46%	38,08%
IMAB5	0,87%	0,72%	3,92%	8,92%	18,36%	30,12%
IMAB5+	0,45%	-4,67%	5,14%	10,30%	19,64%	43,74%
MSCI World Index	0,55%	13,95%	20,36%	42,98%	85,32%	119,31%
INDICE DE FUND. IMOB	0,51%	-0,31%	3,41%	9,89%	14,06%	22,42%
INPC	0,78%	3,28%	5,30%	7,55%	10,49%	16,27%
IHFA	1,55%	1,65%	7,52%	12,30%	16,04%	21,60%

MULTIBRA INSTITUIDOR_803000_ACRICEL_CONSERVADORA FIX

CONTRIBUIÇÃO DE CADA CLASSE DE ATIVO NO RESULTADO GLOBAL

■ ANO ■ MÊS

0

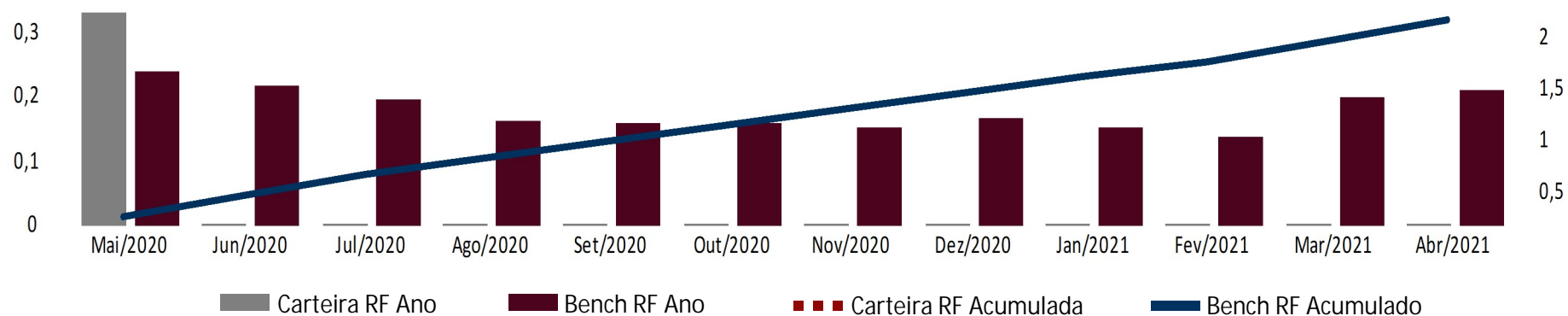
MULTIBRA INSTITUIDOR_803000_ACRICEL_CONSERVADORA FIX

RESULTADO DO SEGMENTO DE RENDA FIXA*

COMPOSIÇÃO EM RENDA FIXA	FINANCEIRO	%	2021		2020		
			MÊS	RETORNO DO FUNDO (%)	DISTÂNCIA DO BENCHMARK (P.P.)	RETORNO DO FUNDO (%)	DISTÂNCIA DO BENCHMARK (P.P.)
SEGMENTO RF	35.399,52	100,00	Jan	-	-	0,04	-0,34
LTN 03/05/2021<O>	10.144,78	28,66	Fev	-	-	2,09	1,79
LF252 BRADESCO 27/03/2023	2.329,58	6,58	Mar	-	-	0,53	0,19
LFT 01/03/2022	2.007,81	5,67	Abr	-	-	-0,12	-0,41
LFSN BRADESCO 14/07/2025	1.418,71	4,01	Mai	-	-	0,33	0,09
LFT 01/09/2025	1.378,31	3,89	Jun	-	-	0,00	-0,22
LFT 01/09/2023	1.025,64	2,90	Jul	-	-	-	-
FUT DI1F24	908,35	2,57	Ago	-	-	-	-
LFT 01/09/2021	894,85	2,53	Set	-	-	-	-
LTN 03/05/2021<O>	822,55	2,32	Out	-	-	-	-
Outros	14.468,94	40,87	Nov	-	-	-	-
			Dez	-	-	-	-
			ANO	-	-	-	-

Valores em milhares

RENTABILIDADE X BENCH



Benchmark de Renda Fixa: CDI

*As rentabilidades do segmento de RF são calculadas através da metodologia de TIR – Taxa Interna de Retorno.

MULTIBRA INSTITUIDOR_803000_ACRICEL_CONSERVADORA FIX

RISCO E RETORNO DA CARTEIRA

	VALOR BRUTO 30/04/2021	% DA CARTEIRA	RENTABILIDADE ^(a)				VOLAT. (% a.a.) 12m ^(c)	LIQUIDEZ	ESTRATÉGIA
			ABRIL 2021	6 MESES	12 MESES	24 MESES			
SEGMENTO RF									
LTN 30/04/2021<O>	0,00	-					-		RENDA FIXA
LTN 30/04/2021<O>	0,00	-					-		RENDA FIXA
LTN 03/05/2021<O>	10.144.778,12	29,84					-		RENDA FIXA
LTN 03/05/2021<O>	822.553,56	2,42					-		RENDA FIXA
LFT 01/09/2021	894.846,88	2,63					-		RENDA FIXA
LFT 01/03/2022	26.604,07	0,08					-		RENDA FIXA
LFT 01/03/2022	66.510,18	0,20					-		RENDA FIXA
LFT 01/03/2022	874.475,83	2,57					-		RENDA FIXA
LFT 01/03/2022	31.924,89	0,09					-		RENDA FIXA
LFT 01/03/2022	742.253,59	2,18					-		RENDA FIXA
LFT 01/03/2022	266.040,71	0,78					-		RENDA FIXA
LFT 01/09/2022	142.202,88	0,42					-		RENDA FIXA
LFT 01/09/2022	265.799,78	0,78					-		RENDA FIXA
LFT 01/03/2023	51.786,72	0,15					-		RENDA FIXA
LFT 01/03/2023	310.985,92	0,91					-		RENDA FIXA
LFT 01/09/2023	1.007.873,15	2,96					-		RENDA FIXA

(a): Rentabilidade bruta não descontada a taxa de administração e performance.

(b): % sobre o Benchmark de cada estratégia

(c): Volatilidade calculada pelo desvio-padrão dos retornos da cota (real ou teórica) dos últimos 12 meses (252 dia úteis), ou desde o início da carteira.

MULTIBRA INSTITUIDOR_803000_ACRICEL_CONSERVADORA FIX

RISCO E RETORNO DA CARTEIRA

	VALOR BRUTO 30/04/2021	% DA CARTEIRA	RENTABILIDADE ^(a)				VOLAT. (% a.a.) 12m ^(c)	LIQUIDEZ	ESTRATÉGIA
			ABRIL 2021	6 MESES BENCHMARK ^(b)	12 MESES	24 MESES			
SEGMENTO RF									
LFT 01/09/2023	17.770,40	0,05					-		RENDA FIXA
LFT 01/03/2024	115.524,97	0,34					-		RENDA FIXA
LFT 01/03/2024	94.111,88	0,28					-		RENDA FIXA
LFT 01/09/2024	104.528,31	0,31					-		RENDA FIXA
LFT 01/09/2024	81.299,80	0,24					-		RENDA FIXA
LFT 01/09/2024	50.152,47	0,15					-		RENDA FIXA
LFT 01/09/2024	133.036,04	0,39					-		RENDA FIXA
LFT 01/03/2025	594.296,59	1,75					-		RENDA FIXA
LFT 01/09/2025	65.633,88	0,19					-		RENDA FIXA
LFT 01/09/2025	1.312.677,63	3,86					-		RENDA FIXA
LFT 01/09/2026	784.779,21	2,31					-		RENDA FIXA
LTN 01/01/2024	288.351,95	0,85					-		RENDA FIXA
LTN 01/01/2024	217.883,91	0,64					-		RENDA FIXA
NTN-B 15/08/2024	76.996,35	0,23					-		RENDA FIXA
NTN-B 15/08/2050	29.877,39	0,09					-		RENDA FIXA
NTN-B 15/08/2050	29.877,39	0,09					-		RENDA FIXA

(a): Rentabilidade bruta não descontada a taxa de administração e performance.

(b): % sobre o Benchmark de cada estratégia

(c): Volatilidade calculada pelo desvio-padrão dos retornos da cota (real ou teórica) dos últimos 12 meses (252 dia úteis), ou desde o início da carteira.

MULTIBRA INSTITUIDOR_803000_ACRICEL_CONSERVADORA FIX

RISCO E RETORNO DA CARTEIRA

	VALOR BRUTO 30/04/2021	% DA CARTEIRA	RENTABILIDADE ^(a)				VOLAT. (% a.a.) 12m ^(c)	LIQUIDEZ	ESTRATÉGIA
			ABRIL 2021	6 MESES BENCHMARK ^(b)	12 MESES	24 MESES			
SEGMENTO RF									
NTN-B 15/08/2022	157.295,36	0,46					-		RENDA FIXA
NTN-B 15/08/2022	185.053,36	0,54					-		RENDA FIXA
NTN-B 15/05/2023	37.044,00	0,11					-		RENDA FIXA
NTN-B 15/05/2023	78.203,99	0,23					-		RENDA FIXA
NTN-B 15/05/2023	156.312,26	0,46					-		RENDA FIXA
DE252 ECPT 15/01/2023	4.567,96	0,01					-		RENDA FIXA
DE252 ECPT 15/01/2023	21.761,25	0,06					-		RENDA FIXA
DE252 ECPT 15/04/2022	1.518,82	-					-		RENDA FIXA
DE252 ECPT 15/04/2022	7.235,49	0,02					-		RENDA FIXA
DE252 ECPT 15/07/2022	4.629,21	0,01					-		RENDA FIXA
DE252 ECPT 15/07/2022	22.053,06	0,06					-		RENDA FIXA
DE252 ECPT 15/10/2022	4.597,93	0,01					-		RENDA FIXA
DE252 ECPT 15/10/2022	21.904,02	0,06					-		RENDA FIXA
DE252 ENERGISA 15/10/2022	12.236,19	0,04					-		RENDA FIXA
DE252 ENERGISA 15/10/2022	42.482,22	0,12					-		RENDA FIXA
DE252 ENERGISA 15/10/2022	32.411,15	0,10					-		RENDA FIXA

(a): Rentabilidade bruta não descontada a taxa de administração e performance.

(b): % sobre o Benchmark de cada estratégia

(c): Volatilidade calculada pelo desvio-padrão dos retornos da cota (real ou teórica) dos últimos 12 meses (252 dia úteis), ou desde o início da carteira.

MULTIBRA INSTITUIDOR_803000_ACRICEL_CONSERVADORA FIX

RISCO E RETORNO DA CARTEIRA

	VALOR BRUTO 30/04/2021	% DA CARTEIRA	RENTABILIDADE ^(a)				VOLAT. (% a.a.) 12m ^(c)	LIQUIDEZ	ESTRATÉGIA
			ABRIL 2021	6 MESES BENCHMARK ^(b)	12 MESES	24 MESES			
SEGMENTO RF									
DE252 ULTRAPAR 05/03/2023	149.768,55	0,44					-		RENDA FIXA
DE252 CELEO 15/11/2023	77.724,37	0,23					-		RENDA FIXA
DE252 B3SA 14/08/2024	374.101,01	1,10					-		RENDA FIXA
DE252 BCBF 04/11/2025	137.916,99	0,41					-		RENDA FIXA
DPGE PARANA B 27/10/2022	50.021,75	0,15					-		RENDA FIXA
LFS ITAU 29/08/2022	357.272,04	1,05					-		RENDA FIXA
LFSN BRADESCO 14/07/2025	1.418.707,82	4,17					-		RENDA FIXA
LFSN BRADESCO 14/04/2025	29.654,25	0,09					-		RENDA FIXA
LFSN BRADESCO 14/04/2025	29.654,25	0,09					-		RENDA FIXA
LF252 BRADESCO 11/06/2021	16.881,03	0,05					-		RENDA FIXA
LF252 BRADESCO 11/06/2021	50.643,09	0,15					-		RENDA FIXA
LF252 GMACBM 17/05/2021	59.172,50	0,17					-		RENDA FIXA
LF252 GMACBM 04/06/2021	63.211,77	0,19					-		RENDA FIXA
LF252 SAFRA 21/01/2022	386.905,91	1,14					-		RENDA FIXA
LF252 PORTOSE 31/07/2021	24.991,13	0,07					-		RENDA FIXA
LFSN BRADESCO 03/08/2026	345.025,41	1,01					-		RENDA FIXA

(a): Rentabilidade bruta não descontada a taxa de administração e performance.

(b): % sobre o Benchmark de cada estratégia

(c): Volatilidade calculada pelo desvio-padrão dos retornos da cota (real ou teórica) dos últimos 12 meses (252 dia úteis), ou desde o início da carteira.

MULTIBRA INSTITUIDOR_803000_ACRICEL_CONSERVADORA FIX

RISCO E RETORNO DA CARTEIRA

	VALOR BRUTO 30/04/2021	% DA CARTEIRA	RENTABILIDADE (a)				VOLAT. (% a.a.) 12m (c)	LIQUIDEZ	ESTRATÉGIA
			ABRIL 2021	6 MESES	12 MESES	24 MESES			
			BENCHMARK (b)						
SEGMENTO RF									
LF252 BC RCI 20/09/2021	74.079,59	0,22					-	RENDA FIXA	
LF252 SAFRA 11/07/2022	246.132,14	0,72					-	RENDA FIXA	
LF252 SAFRA 22/08/2022	302.207,48	0,89					-	RENDA FIXA	
LF252 SAFRA 21/10/2022	301.621,17	0,89					-	RENDA FIXA	
LF252 PORTOSE 01/03/2022	47.780,76	0,14					-	RENDA FIXA	
LF252 B.ALFA 27/05/2022	394.720,47	1,16					-	RENDA FIXA	
LF252 BRADESCO 04/11/2021	20.544,78	0,06					-	RENDA FIXA	
LFSC BRADESCO 15/03/2050	6.904,71	0,02					-	RENDA FIXA	
LF252 SAFRA 19/09/2022	162.434,37	0,48					-	RENDA FIXA	
LF252 BC RCI 16/11/2022	180.202,16	0,53					-	RENDA FIXA	
LF252 BBM 19/10/2022	101.695,61	0,30					-	RENDA FIXA	
LF252 DAYCOVAL 28/10/2022	403.895,74	1,19					-	RENDA FIXA	
LFSN ITAUUBB 13/11/2030	303.143,52	0,89					-	RENDA FIXA	
LF252 B.MERCEDES 02/12/2022	136.833,47	0,40					-	RENDA FIXA	
LF252 B VOTORA 05/12/2022	403.704,07	1,19					-	RENDA FIXA	
LF252 DAYCOVAL 07/12/2023	162.585,89	0,48					-	RENDA FIXA	

(a): Rentabilidade bruta não descontada a taxa de administração e performance.

(b): % sobre o Benchmark de cada estratégia

(c): Volatilidade calculada pelo desvio-padrão dos retornos da cota (real ou teórica) dos últimos 12 meses (252 dia úteis), ou desde o início da carteira.

MULTIBRA INSTITUIDOR_803000_ACRICEL_CONSERVADORA FIX

RISCO E RETORNO DA CARTEIRA

	VALOR BRUTO 30/04/2021	% DA CARTEIRA	RENTABILIDADE ^(a)				VOLAT. (% a.a.) 12m ^(c)	LIQUIDEZ	ESTRATÉGIA
			ABRIL 2021	6 MESES BENCHMARK ^(b)	12 MESES	24 MESES			
SEGMENTO RF									
LF252 DAYCOVAL 07/12/2022	162.374,04	0,48					-	RENDA FIXA	
LF252 SAFRA 30/01/2023	492.702,76	1,45					-	RENDA FIXA	
LF252 B VOTORA 10/02/2023	378.693,85	1,11					-	RENDA FIXA	
LF252 B.ALFA 09/03/2023	89.178,75	0,26					-	RENDA FIXA	
LF252 ABC 22/03/2023	227.045,00	0,67					-	RENDA FIXA	
LF252 SAFRA 22/09/2023	166.623,16	0,49					-	RENDA FIXA	
LF252 SAFRA 22/03/2024	166.667,82	0,49					-	RENDA FIXA	
LF252 VOLKSWAG 27/03/2023	104.871,64	0,31					-	RENDA FIXA	
LF252 BRADESCO 27/03/2023	2.329.583,36	6,85					-	RENDA FIXA	
LF252 CNH 08/04/2023	103.583,42	0,30					-	RENDA FIXA	
LF252 BTG PACT 17/04/2023	312.269,89	0,92					-	RENDA FIXA	
LF252 ABC 17/04/2023	132.854,75	0,39					-	RENDA FIXA	
LF252 BRADESCO 31/05/2022	58.754,50	0,17					-	RENDA FIXA	
DE252 PETR 15/08/2022	205.407,74	0,60					-	RENDA FIXA	
DE252 CEMAR 15/09/2022	46.379,26	0,14					-	RENDA FIXA	
DE252 CPFG 18/05/2021	306.446,51	0,90					-	RENDA FIXA	

(a): Rentabilidade bruta não descontada a taxa de administração e performance.

(b): % sobre o Benchmark de cada estratégia

(c): Volatilidade calculada pelo desvio-padrão dos retornos da cota (real ou teórica) dos últimos 12 meses (252 dia úteis), ou desde o início da carteira.

MULTIBRA INSTITUIDOR_803000_ACRICEL_CONSERVADORA FIX

RISCO E RETORNO DA CARTEIRA

	VALOR BRUTO 30/04/2021	% DA CARTEIRA	RENTABILIDADE (a)				VOLAT. (% a.a.) 12m (c)	LIQUIDEZ	ESTRATÉGIA
			ABRIL	2021	6 MESES	12 MESES			
			BENCHMARK (b)						
SEGMENTO RF									
DE252 ELEKTRO 15/05/2023	127.636,92	0,38						-	RENDA FIXA
DE252 CBD 10/09/2021	206.367,20	0,61						-	RENDA FIXA
DE252 PETR 15/01/2026	99.650,26	0,29						-	RENDA FIXA
DE252 LAME 02/06/2023	150.617,76	0,44						-	RENDA FIXA
DE252 IRB 15/10/2023	178.177,25	0,52						-	RENDA FIXA
DE252 NCF PART 23/12/2023	799.417,41	2,35						-	RENDA FIXA
DPGE SOFISA 01/09/2022	50.164,52	0,15						-	RENDA FIXA
CHEMICAL X FIDC - INDUSTRIA PETROQUIMICA	103.524,34	0,30	0,28 0,07	0,97 0,27	-0,02 -1,02	-0,69 -2,84	-5,02 -	2,65	RF - CREDITO PRIVADO
CHEMICAL XI FIDC SÊN	104.601,27	0,31	- -	- -	- -	- -	- -	-	RF - CREDITO PRIVADO
BRAM FI CP	321,68	-	0,20 -	0,67 -0,02	0,98 -0,03	2,09 -0,06	7,35 -	0,03	RENDA FIXA
27511	11.660,06	0,03						-	RF-OUTROS
27544	-148.346,80	-0,44						-	RF-OUTROS
27570	43.988,52	0,13						-	RF-OUTROS
27582	-99.990,83	-0,29						-	RF-OUTROS
27935	-69.437,59	-0,20						-	RF-OUTROS
27940	-132.053,39	-0,39						-	RF-OUTROS

(a): Rentabilidade bruta não descontada a taxa de administração e performance.

(b): % sobre o Benchmark de cada estratégia

(c): Volatilidade calculada pelo desvio-padrão dos retornos da cota (real ou teórica) dos últimos 12 meses (252 dia úteis), ou desde o início da carteira.

MULTIBRA INSTITUIDOR_803000_ACRICEL_CONSERVADORA FIX

RISCO E RETORNO DA CARTEIRA

	VALOR BRUTO 30/04/2021	% DA CARTEIRA	RENTABILIDADE ^(a)				VOLAT. (% a.a.) 12m ^(c)	LIQUIDEZ	ESTRATÉGIA
			ABRIL 2021	6 MESES BENCHMARK ^(b)	12 MESES	24 MESES			
SEGMENTO RF									
27953	82.938,25	0,24					-		RF-OUTROS
27957	-38.948,85	-0,11					-		RF-OUTROS
FUT DI1F22	4.765,16	-					-		RF-OUTROS
FUT DI1F23	13.315,14	-					-		RF-OUTROS
FUT DI1F24	908.353,13	-					-		RF-OUTROS
FUT DI1F25	261.483,43	-					-		RF-OUTROS
FUT DAPQ22	-103.084,26	-					-		RF-OUTROS
FUT DAPQ24	306.087,18	-					-		RF-OUTROS
CAIXA E PAGAR/RECEBER									
01-Tesouraria	49,15	-							
02-Pagar/receber	-12.663,92	-0,04							
CARTEIRA CONSOLIDADA	33.995.988,14	100,00	0,23	0,37	0,93	2,14	-		

(a): Rentabilidade bruta não descontada a taxa de administração e performance.

(b): % sobre o Benchmark de cada estratégia

(c): Volatilidade calculada pelo desvio-padrão dos retornos da cota (real ou teórica) dos últimos 12 meses (252 dia úteis), ou desde o início da carteira.

MULTIBRA INSTITUIDOR_803000_ACRICEL_CONSERVADORA FIX

RESUMO DA CARTEIRA

COMPORTAMENTO DE RETORNO MENSAIS NOS ÚLTIMOS 24 MESES

	QUANTIDADE	PERCENTUAL
MESES ACIMA DO BENCHMARK	11	47,83%
MESES ABAIXO DO BENCHMARK	10	43,48%
MESES NEGATIVOS	2	8,70%

MAIOR E MENOR DESEMPENHO NOS ÚLTIMOS 24 MESES

	RENTABILIDADE	MÊS
MAIOR RENTABILIDADE DA CARTEIRA	0,60%	Jul/2019
MENOR RENTABILIDADE DA CARTEIRA	-0,02%	Fev/2021

ANEXOS

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE CRÉDITO PRIVADO

CARACTERÍSTICAS	ORIGEM	EMIÇÃO	VENCIMENTO	% PL	RATING	AGÊNCIA
Debênture				8,90		
DE252 B3SA 14/08/2024	-	19/08/20	14/08/24	1,10	Aaa	Moody's
DE252 BCBF 04/11/2025	-	24/11/20	04/11/25	0,41	AA+	Fitch
DE252 CBD 10/09/2021	-	11/09/18	10/09/21	0,61	br AAA	Standard & Poor's
DE252 CELEO 15/11/2023	-	21/12/18	15/11/23	0,23	br AAA	Standard & Poor's
DE252 CEMAR 15/09/2022	-	13/10/17	15/09/22	0,14	AA-	Fitch
DE252 CPFG 18/05/2021	-	19/06/18	18/05/21	0,90	Aaa	Moody's
DE252 ECPT 15/01/2023	-	15/01/11	15/01/23	0,07	Aa2	Moody's
DE252 ECPT 15/04/2022	-	15/01/11	15/04/22	0,02	Aa2	Moody's
DE252 ECPT 15/07/2022	-	15/01/11	15/07/22	0,07	Aa2	Moody's
DE252 ECPT 15/10/2022	-	15/01/11	15/10/22	0,07	Aa2	Moody's
DE252 ELEKTRO 15/05/2023	-	28/06/18	15/05/23	0,38	AA-	Fitch
DE252 ENERGISA 15/10/2022	-	31/10/17	15/10/22	0,26	AAA	Fitch
DE252 IRB 15/10/2023	-	28/10/20	15/10/23	0,52	br AAA	Standard & Poor's
DE252 LAME 02/06/2023	-	03/06/20	02/06/23	0,44	AAA	Fitch
DE252 NCF PART 23/12/2023	-	23/12/20	23/12/23	2,35	AA+	Fitch
DE252 PETR 15/01/2026	-	12/02/19	15/01/26	0,29	br AAA	Standard & Poor's
DE252 PETR 15/08/2022	-	25/08/17	15/08/22	0,60	br AAA	Standard & Poor's
DE252 ULTRAPAR 05/03/2023	-	08/03/18	05/03/23	0,44	Aaa	Moody's
DPGE				0,30		
DPGE PARANA B 27/10/2022	-	27/10/20	27/10/22	0,15	brAA+	Standard & Poor's
DPGE SOFISA 01/09/2022	-	09/09/20	01/09/22	0,15	brAA	Standard & Poor's
LF				31,63		
LF252 ABC 17/04/2023	-	16/04/21	17/04/23	0,39	br AAA	Standard & Poor's
LF252 ABC 22/03/2023	-	22/03/21	22/03/23	0,67	br AAA	Standard & Poor's
LF252 B VOTORA 05/12/2022	-	03/12/20	05/12/22	1,19	br AAA	Standard & Poor's
LF252 B VOTORA 10/02/2023	-	10/02/21	10/02/23	1,11	br AAA	Standard & Poor's
LF252 B.ALFA 09/03/2023	-	09/03/21	09/03/23	0,26	Aa1	Moody's
LF252 B.ALFA 27/05/2022	-	27/05/19	27/05/22	1,16	Aa1	Moody's
LF252 B.MERCEDES 02/12/2022	-	27/11/20	02/12/22	0,40	AAA	Fitch
LF252 BBM 19/10/2022	-	16/10/20	19/10/22	0,30	Aaa	Moody's
LF252 BC RCI 16/11/2022	-	16/10/20	16/11/22	0,53	Aaa	Moody's
LF252 BC RCI 20/09/2021	-	20/09/18	20/09/21	0,22	Aaa	Moody's
LF252 BRADESCO 04/11/2021	-	04/10/18	04/11/21	0,06	br AAA	Standard & Poor's
LF252 BRADESCO 11/06/2021	-	11/05/18	11/06/21	0,20	br AAA	Standard & Poor's
LF252 BRADESCO 27/03/2023	-	26/03/21	27/03/23	6,85	br AAA	Standard & Poor's
LF252 BRADESCO 31/05/2022	-	31/05/19	31/05/22	0,17	br AAA	Standard & Poor's

ANEXOS

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE CRÉDITO PRIVADO

CARACTERÍSTICAS	ORIGEM	EMIÇÃO	VENCIMENTO	% PL	RATING	AGÊNCIA
LF				31,63		
LF252 BTG PACT 17/04/2023	-	16/04/21	17/04/23	0,92	brAA+	Standard & Poor's
LF252 CNH 08/04/2023	-	29/03/21	10/04/23	0,30	AAA	Fitch
LF252 DAYCOVAL 07/12/2022	-	07/12/20	07/12/22	0,48	brAA+	Standard & Poor's
LF252 DAYCOVAL 07/12/2023	-	07/12/20	07/12/23	0,48	brAA+	Standard & Poor's
LF252 DAYCOVAL 28/10/2022	-	27/10/20	28/10/22	1,19	brAA+	Standard & Poor's
LF252 GMACBM 04/06/2021	-	30/05/18	04/06/21	0,19	Aaa	Moody's
LF252 GMACBM 17/05/2021	-	16/05/18	17/05/21	0,17	AAA	Fitch
LF252 PORTOSE 01/03/2022	-	01/03/19	01/03/22	0,14	AA	Fitch
LF252 PORTOSE 31/07/2021	-	31/07/18	31/07/21	0,07	AA	Fitch
LF252 SAFRA 11/07/2022	-	11/01/19	11/07/22	0,72	br AAA	Standard & Poor's
LF252 SAFRA 19/09/2022	-	18/09/19	19/09/22	0,48	br AAA	Standard & Poor's
LF252 SAFRA 21/01/2022	-	23/07/18	21/01/22	1,14	br AAA	Standard & Poor's
LF252 SAFRA 21/10/2022	-	21/02/19	21/10/22	0,89	br AAA	Standard & Poor's
LF252 SAFRA 22/03/2024	-	22/03/21	22/03/24	0,49	br AAA	Standard & Poor's
LF252 SAFRA 22/08/2022	-	21/02/19	22/08/22	0,89	br AAA	Standard & Poor's
LF252 SAFRA 22/09/2023	-	22/03/21	22/09/23	0,49	br AAA	Standard & Poor's
LF252 SAFRA 30/01/2023	-	29/01/21	30/01/23	1,45	br AAA	Standard & Poor's
LF252 VOLKSWAG 27/03/2023	-	26/03/21	27/03/23	0,31	br AAA	Standard & Poor's
LFS ITAU 29/08/2022	-	27/08/12	29/08/22	1,05	br AAA	Standard & Poor's
LFSC BRADESCO 15/03/2050	-	14/11/18	15/03/24	0,02	br AAA	Standard & Poor's
LFSN BRADESCO 03/08/2026	-	03/08/18	03/08/26	1,01	br AAA	Standard & Poor's
LFSN BRADESCO 14/04/2025	-	13/04/17	14/04/25	0,18	br AAA	Standard & Poor's
LFSN BRADESCO 14/07/2025	-	13/04/17	14/07/25	4,17	br AAA	Standard & Poor's
LFSN ITAUUBB 13/11/2030	-	13/11/20	13/11/30	0,89	br AAA	Standard & Poor's

ANEXOS

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS

CARACTERÍSTICAS	ORIGEM	EMIÇÃO	VENCIMENTO	% PL
Compromissadas				32,26
LTN 03/05/2021<O>	-	30/04/21	03/05/21	32,26
LTN 03/05/2021<O>	BRAM FI CP	30/04/21	03/05/21	0,00
LTN 30/04/2021<O>	-	29/04/21	30/04/21	0,00
LTN 30/04/2021<O>	BRAM FI CP	29/04/21	30/04/21	0,00
LFT				23,62
LFT 01/03/2022	-	08/01/16	01/03/22	5,90
LFT 01/03/2023	-	13/01/17	01/03/23	1,06
LFT 01/03/2024	-	05/01/18	01/03/24	0,62
LFT 01/03/2025	-	26/10/18	01/03/25	1,75
LFT 01/09/2021	-	08/05/15	01/09/21	2,63
LFT 01/09/2022	-	08/07/16	01/09/22	1,20
LFT 01/09/2023	-	14/07/17	01/09/23	3,01
LFT 01/09/2024	-	06/07/18	01/09/24	1,09
LFT 01/09/2025	-	08/03/19	01/09/25	4,05
LFT 01/09/2026	-	13/03/20	01/09/26	2,31
LTN				1,49
LTN 01/01/2024	-	03/01/20	01/01/24	1,49
NTNB				2,21
NTN-B 15/05/2023	-	15/01/14	15/05/23	0,80
NTN-B 15/08/2022	-	13/10/11	15/08/22	1,00
NTN-B 15/08/2024	-	15/10/03	15/08/24	0,23
NTN-B 15/08/2050	-	10/02/10	15/08/50	0,18

Início	Benchmark
01/01/2019	CDI
01/01/2020	CDI
04/01/2021	CDI
