

MULTIBRA INSTITUIDOR\_803000\_ACRICEL\_CONSERVADORA FIX

SETEMBRO/2021



# MULTIBRA INSTITUIDOR\_803000\_ACRICEL\_CONSERVADORA FIX

## COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA

ATIVOS	FINANCEIRO	% PL
SEGMENTO RF	33.238,59	100,23
LFT 01/10/2021<O>	9.624,52	29,02
LF252 BRADESCO 27/03/2023	2.352,99	7,10
LFT 01/03/2022	2.020,13	6,09
LFSN BRADESCO 14/07/2025	1.407,96	4,25
LFT 01/09/2025	1.151,57	3,47
LFT 01/09/2023	1.032,27	3,11
DE252 NCF PART 23/12/2023	899,74	2,71
LFT 01/09/2026	793,95	2,39
LFT 01/03/2025	601,24	1,81
Outros	13.354,22	40,27
OUTROS VALORES	-13,15	-0,04
01-Tesouraria	0,24	0,00
02-Pagar/receber	-13,38	-0,04
<b>PL LÍQUIDO EM 30/09/2021</b>	<b>33.161,91</b>	

Valores em milhares

POSIÇÃO CONSOLIDADA POR TIPO DE ATIVO\*

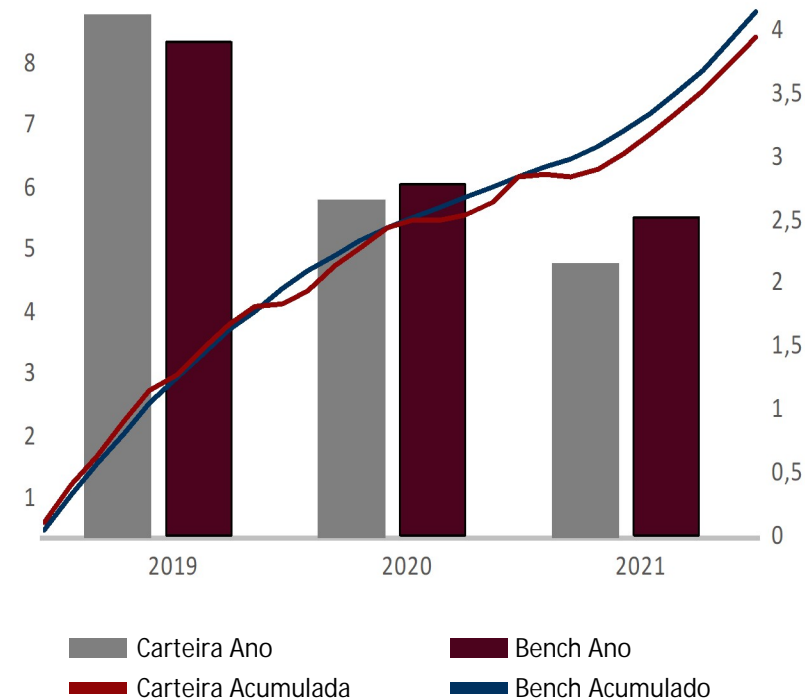


\*Posição Consolidada por Tipo de Ativo: O gráfico Posição Consolidada por Tipo de Ativo não leva em consideração valores a liquidar e saldo em tesouraria.

## 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	0,32	0,051	0,41	0,167
Jun	0,29	-0,011	0,27	0,060
Jul	0,33	-0,023	0,31	0,118
Ago	0,40	-0,023	0,13	-0,032
Set	0,42	-0,021	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 (%)	2,01	2,80	6,07	-	2,15	2,66	4,12	-	-	9,18
Retorno do benchmark (%)	2,01	2,99	6,65	-	2,51	2,77	3,90	-	-	9,45
Distância do benchmark (p.p.)	-0,01	-0,19	-0,58	-	-0,36	-0,11	0,22	-	-	-0,27

Data de início: 26/04/2019

Benchmark: CDI

# MULTIBRA INSTITUIDOR\_803000\_ACRICEL\_CONSERVADORA FIX

## INDICADORES FINANCEIROS

ÍNDICES	SETEMBRO	2021	6 MESES	12 MESES	24 MESES	36 MESES
Retorno do fundo	0,42%	2,15%	2,01%	2,80%	6,07%	-
CDI	0,44%	2,51%	2,01%	2,99%	6,65%	13,35%
IPCA	1,16%	6,90%	4,75%	10,25%	13,70%	16,99%
IGP-M	-0,64%	16,00%	7,15%	24,86%	47,25%	52,21%
PTAXV	5,76%	4,67%	-4,53%	-3,57%	30,62%	35,85%
IBOVESPA	-6,57%	-6,75%	-4,85%	17,31%	5,95%	39,87%
IBX50	-7,47%	-6,33%	-5,58%	18,46%	6,59%	37,53%
IBXM BRASIL	-6,99%	-5,99%	-5,31%	17,82%	7,71%	45,23%
IMA-B	-0,13%	-2,30%	0,52%	4,71%	6,92%	40,46%
IMAB5	1,00%	2,48%	2,64%	5,95%	13,62%	31,12%
IMAB5+	-1,26%	-6,63%	-1,61%	3,20%	1,48%	46,98%
MSCI World Index	0,76%	17,06%	3,30%	22,55%	80,26%	87,14%
INDICE DE FUND. IMOB	-1,24%	-5,38%	-4,61%	-2,83%	1,17%	27,21%
INPC	1,20%	7,21%	5,14%	10,78%	15,09%	18,45%
IHFA	0,15%	2,02%	1,92%	7,61%	11,61%	22,17%

# MULTIBRA INSTITUIDOR\_803000\_ACRICEL\_CONSERVADORA FIX

## CONTRIBUIÇÃO DE CADA CLASSE DE ATIVO NO RESULTADO GLOBAL

■ ANO ■ MÊS

0

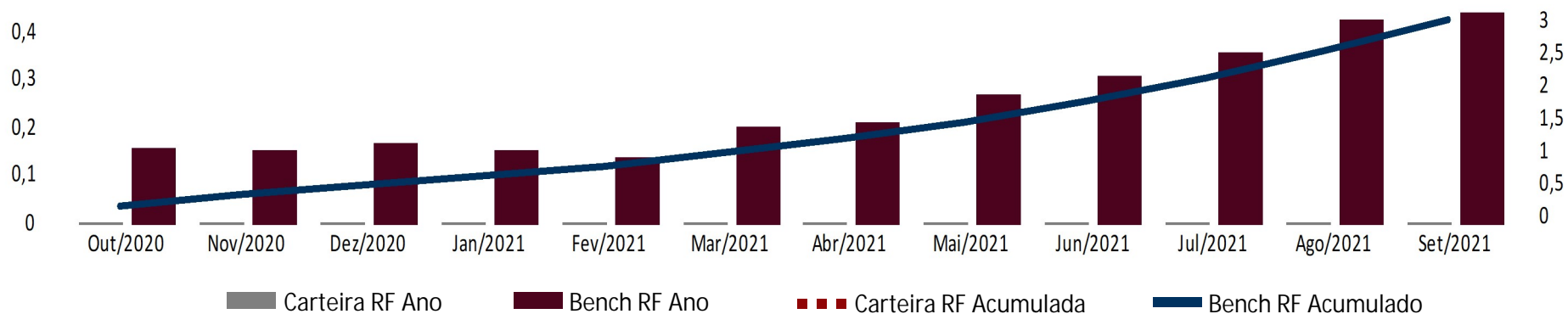
# MULTIBRA INSTITUIDOR\_803000\_ACRICEL\_CONSERVADORA FIX

## 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	33.238,59	100,00	Jan	-	-	0,04	-0,34
LFT 01/10/2021<O>	9.624,52	28,96	Fev	-	-	2,09	1,79
LF252 BRADESCO 27/03/2023	2.352,99	7,08	Mar	-	-	0,53	0,19
LFT 01/03/2022	2.020,13	6,08	Abr	-	-	-0,12	-0,41
LFSN BRADESCO 14/07/2025	1.407,96	4,24	Mai	-	-	0,33	0,09
LFT 01/09/2025	1.151,57	3,46	Jun	-	-	0,00	-0,22
LFT 01/09/2023	1.032,27	3,11	Jul	-	-	-	-
DE252 NCF PART 23/12/2023	899,74	2,71	Ago	-	-	-	-
LFT 01/09/2026	793,95	2,39	Set	-	-	-	-
LFT 01/03/2025	601,24	1,81	Out	-	-	-	-
Outros	13.354,22	40,18	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 30/09/2021	% DA CARTEIRA	RENTABILIDADE (a)				VOLAT. (% a.a.) 12m (c)	LIQUIDEZ	ESTRATÉGIA
			SETEMBRO 2021	6 MESES	12 MESES	24 MESES			
			BENCHMARK (b)						
SEGMENTO RF									
NTN 30/09/2021<O>	0,00	-					-		RENDA FIXA
LFT 01/10/2021<O>	9.624.519,74	29,02					-		RENDA FIXA
LFT 01/03/2022	26.767,36	0,08					-		RENDA FIXA
LFT 01/03/2022	66.918,39	0,20					-		RENDA FIXA
LFT 01/03/2022	879.842,99	2,65					-		RENDA FIXA
LFT 01/03/2022	32.120,83	0,10					-		RENDA FIXA
LFT 01/03/2022	746.809,23	2,25					-		RENDA FIXA
LFT 01/03/2022	267.673,56	0,81					-		RENDA FIXA
LFT 01/09/2022	143.195,33	0,43					-		RENDA FIXA
LFT 01/09/2022	267.654,82	0,81					-		RENDA FIXA
LFT 01/03/2023	52.168,00	0,16					-		RENDA FIXA
LFT 01/03/2023	313.275,51	0,94					-		RENDA FIXA
LFT 01/09/2023	1.014.381,22	3,06					-		RENDA FIXA
LFT 01/09/2023	17.885,14	0,05					-		RENDA FIXA
LFT 01/03/2024	116.557,91	0,35					-		RENDA FIXA
LFT 01/03/2024	94.953,35	0,29					-		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 30/09/2021	% DA CARTEIRA	RENTABILIDADE <sup>(a)</sup>				VOLAT. (% a.a.) 12m <sup>(c)</sup>	LIQUIDEZ	ESTRATÉGIA
			SETEMBRO 2021	6 MESES	12 MESES	24 MESES			
BENCHMARK <sup>(b)</sup>									
SEGMENTO RF									
LFT 01/09/2024	105.534,59	0,32					-		RENDA FIXA
LFT 01/09/2024	82.082,46	0,25					-		RENDA FIXA
LFT 01/09/2024	50.635,28	0,15					-		RENDA FIXA
LFT 01/09/2024	134.316,75	0,41					-		RENDA FIXA
LFT 01/03/2025	601.235,17	1,81					-		RENDA FIXA
LFT 01/09/2025	53.116,86	0,16					-		RENDA FIXA
LFT 01/09/2025	1.098.456,66	3,31					-		RENDA FIXA
LFT 01/09/2026	793.949,10	2,39					-		RENDA FIXA
LTN 01/01/2024	278.902,46	0,84					-		RENDA FIXA
LTN 01/01/2024	210.743,72	0,64					-		RENDA FIXA
NTN-B 15/08/2024	74.754,40	0,23					-		RENDA FIXA
NTN-B 15/08/2050	28.154,62	0,08					-		RENDA FIXA
NTN-B 15/08/2050	28.154,62	0,08					-		RENDA FIXA
NTN-B 15/08/2050	59.380,66	0,18					-		RENDA FIXA
NTN-B 15/08/2022	156.597,14	0,47					-		RENDA FIXA
NTN-B 15/08/2022	184.231,93	0,56					-		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 30/09/2021	% DA CARTEIRA	RENTABILIDADE <sup>(a)</sup>				VOLAT. (% a.a.) 12m <sup>(c)</sup>	LIQUIDEZ	ESTRATÉGIA
			SETEMBRO 2021	6 MESES BENCHMARK <sup>(b)</sup>	12 MESES	24 MESES			
SEGMENTO RF									
NTN-B 15/05/2023	36.382,36	0,11					-		RENDA FIXA
NTN-B 15/05/2025	266.761,77	0,80					-		RENDA FIXA
CDB B.MERCED 01/09/2023	47.985,97	0,14					-		RENDA FIXA
DE252 ECPT 15/01/2023	4.732,65	0,01					-		RENDA FIXA
DE252 ECPT 15/01/2023	22.545,82	0,07					-		RENDA FIXA
DE252 ECPT 15/04/2022	1.574,35	-					-		RENDA FIXA
DE252 ECPT 15/04/2022	7.500,04	0,02					-		RENDA FIXA
DE252 ECPT 15/07/2022	1.561,29	-					-		RENDA FIXA
DE252 ECPT 15/07/2022	7.437,82	0,02					-		RENDA FIXA
DE252 ECPT 15/10/2022	4.770,53	0,01					-		RENDA FIXA
DE252 ECPT 15/10/2022	22.726,29	0,07					-		RENDA FIXA
DE252 ENERGISA 15/10/2022	12.429,24	0,04					-		RENDA FIXA
DE252 ENERGISA 15/10/2022	43.152,46	0,13					-		RENDA FIXA
DE252 ENERGISA 15/10/2022	32.922,49	0,10					-		RENDA FIXA
DE252 ULTRAPAR 05/03/2023	149.682,54	0,45					-		RENDA FIXA
DE252 CELEO 15/11/2023	73.443,74	0,22					-		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 30/09/2021	% DA CARTEIRA	RENTABILIDADE <sup>(a)</sup>				VOLAT. (% a.a.) 12m <sup>(c)</sup>	LIQUIDEZ	ESTRATÉGIA
			SETEMBRO 2021	6 MESES BENCHMARK <sup>(b)</sup>	12 MESES	24 MESES			
SEGMENTO RF									
DE252 B3SA 14/08/2024	370.511,55	1,12					-		RENDA FIXA
DE252 BCBF 04/11/2025	137.102,15	0,41					-		RENDA FIXA
DE252 ELEKTRO 10/05/2026	77.233,80	0,23					-		RENDA FIXA
DE252 MRS 15/08/2026	75.858,13	0,23					-		RENDA FIXA
DPGE PARANA B 27/10/2022	50.600,36	0,15					-		RENDA FIXA
LFS ITAU 29/08/2022	365.592,50	1,10					-		RENDA FIXA
LFSN BRADESCO 14/07/2025	1.407.961,05	4,25					-		RENDA FIXA
LFSN BRADESCO 14/04/2025	29.997,81	0,09					-		RENDA FIXA
LFSN BRADESCO 14/04/2025	29.997,81	0,09					-		RENDA FIXA
LFSN BRADESCO 14/04/2025	202.485,20	0,61					-		RENDA FIXA
LF252 SAFRA 21/01/2022	390.310,81	1,18					-		RENDA FIXA
LFSN BRADESCO 03/08/2026	362.078,57	1,09					-		RENDA FIXA
LF252 SAFRA 11/07/2022	247.892,75	0,75					-		RENDA FIXA
LF252 SAFRA 22/08/2022	304.268,15	0,92					-		RENDA FIXA
LF252 SAFRA 21/10/2022	303.588,87	0,92					-		RENDA FIXA
LF252 PORTOSE 01/03/2022	48.192,61	0,15					-		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 30/09/2021	% DA CARTEIRA	RENTABILIDADE <sup>(a)</sup>				VOLAT. (% a.a.) 12m <sup>(c)</sup>	LIQUIDEZ	ESTRATÉGIA
			SETEMBRO 2021	6 MESES BENCHMARK <sup>(b)</sup>	12 MESES	24 MESES			
SEGMENTO RF									
LF252 B.ALFA 27/05/2022	400.557,58	1,21					-	RENDA FIXA	
LF252 BRADESCO 04/11/2021	20.707,79	0,06					-	RENDA FIXA	
LFSC BRADESCO 15/03/2050	7.132,18	0,02					-	RENDA FIXA	
LF252 SAFRA 19/09/2022	164.371,58	0,50					-	RENDA FIXA	
LF252 BRADESCO 18/10/2022	39.656,16	0,12					-	RENDA FIXA	
LF252 BC RCI 16/11/2022	183.191,28	0,55					-	RENDA FIXA	
LF252 BBM 19/10/2022	103.011,15	0,31					-	RENDA FIXA	
LF252 DAYCOVAL 28/10/2022	409.722,14	1,24					-	RENDA FIXA	
LFSN ITAUUBB 13/11/2030	304.424,87	0,92					-	RENDA FIXA	
LF252 B.MERCEDES 02/12/2022	138.822,65	0,42					-	RENDA FIXA	
LF252 B VOTORA 30/11/2022	20.265,40	0,06					-	RENDA FIXA	
LF252 B VOTORA 05/12/2022	408.934,47	1,23					-	RENDA FIXA	
LF252 DAYCOVAL 07/12/2023	165.671,56	0,50					-	RENDA FIXA	
LF252 DAYCOVAL 07/12/2022	164.780,69	0,50					-	RENDA FIXA	
LF252 SAFRA 30/01/2023	499.585,08	1,51					-	RENDA FIXA	
LF252 B VOTORA 10/02/2023	20.118,55	0,06					-	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 30/09/2021	% DA CARTEIRA	RENTABILIDADE (a)				VOLAT. (% a.a.) 12m (c)	LIQUIDEZ	ESTRATÉGIA
			SETEMBRO 2021	6 MESES BENCHMARK (b)	12 MESES	24 MESES			
SEGMENTO RF									
LF252 B VOTORA 10/02/2023	383.509,87	1,16					-	RENDA FIXA	
LF252 B.ALFA 09/03/2023	90.300,53	0,27					-	RENDA FIXA	
LF252 ABC 22/03/2023	229.867,51	0,69					-	RENDA FIXA	
LF252 SAFRA 22/09/2023	169.386,97	0,51					-	RENDA FIXA	
LF252 SAFRA 22/03/2024	169.589,97	0,51					-	RENDA FIXA	
LF252 VOLKSWAG 27/03/2023	106.456,10	0,32					-	RENDA FIXA	
LF252 BRADESCO 27/03/2023	2.352.989,13	7,10					-	RENDA FIXA	
LF252 CNH 08/04/2023	104.956,82	0,32					-	RENDA FIXA	
LF252 BTG PACT 17/04/2023	316.159,90	0,95					-	RENDA FIXA	
LF252 ABC 17/04/2023	134.500,68	0,41					-	RENDA FIXA	
LF252 BRADESCO 31/05/2022	59.276,41	0,18					-	RENDA FIXA	
LF252 B VOTORA 28/04/2023	31.172,72	0,09					-	RENDA FIXA	
LF252 SAFRA 06/05/2024	51.248,89	0,15					-	RENDA FIXA	
LF252 PARANA B 08/05/2023	77.439,66	0,23					-	RENDA FIXA	
LF252 GMACBM 16/05/2024	34.852,19	0,11					-	RENDA FIXA	
LF252 BNP 30/05/2023	156.201,72	0,47					-	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 30/09/2021	% DA CARTEIRA	RENTABILIDADE (a)				VOLAT. (% a.a.) 12m (c)	LIQUIDEZ	ESTRATÉGIA
			SETEMBRO 2021	6 MESES BENCHMARK (b)	12 MESES	24 MESES			
SEGMENTO RF									
LF252 SOFISA 12/06/2023	72.081,82	0,22					-	RENDA FIXA	
LF252 BANCO XP 21/12/2023	30.923,49	0,09					-	RENDA FIXA	
LF252 BANCO XP 28/06/2024	30.936,88	0,09					-	RENDA FIXA	
LF252 BANCO XP 28/06/2023	30.943,97	0,09					-	RENDA FIXA	
LF252 ABC 25/06/2024	140.121,56	0,42					-	RENDA FIXA	
LF252 BTG PACT 26/06/2023	235.506,36	0,71					-	RENDA FIXA	
LF252 SOFISA 04/08/2023	38.090,26	0,11					-	RENDA FIXA	
LF252 DAYCOVAL 13/08/2026	77.184,02	0,23					-	RENDA FIXA	
LF252 ABC 13/08/2024	141.975,45	0,43					-	RENDA FIXA	
LF252 ABC 04/10/2021	20.816,16	0,06					-	RENDA FIXA	
LF252 B VOTORA 04/03/2024	109.866,83	0,33					-	RENDA FIXA	
LF252 VOLKSWAG 29/08/2025	75.739,36	0,23					-	RENDA FIXA	
LF252 FIDIS 27/09/2024	71.666,26	0,22					-	RENDA FIXA	
LF252 CNH 28/09/2024	51.985,63	0,16					-	RENDA FIXA	
LF252 GMACBM 28/09/2023	35.216,22	0,11					-	RENDA FIXA	
DE252 PETR 15/08/2022	205.410,34	0,62					-	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 30/09/2021	% DA CARTEIRA	RENTABILIDADE (a)				VOLAT. (% a.a.) 12m (c)	LIQUIDEZ	ESTRATÉGIA
			SETEMBRO 2021	6 MESES	12 MESES	24 MESES			
			BENCHMARK (b)						
SEGMENTO RF									
DE252 CEMAR 15/09/2022	46.028,30	0,14						-	RENDA FIXA
DE252 PETR 15/01/2026	100.553,99	0,30						-	RENDA FIXA
DE252 LAME 02/06/2023	148.736,55	0,45						-	RENDA FIXA
DE252 IRB 15/10/2023	181.004,01	0,55						-	RENDA FIXA
DE252 IRB 15/10/2023	17.856,21	0,05						-	RENDA FIXA
DE252 NCF PART 23/12/2023	810.020,81	2,44						-	RENDA FIXA
DE252 NCF PART 23/12/2023	89.720,07	0,27						-	RENDA FIXA
NC ENERGISA 23/07/2024	245.857,18	0,74						-	RENDA FIXA
DPGE SOFISA 01/09/2022	50.701,06	0,15						-	RENDA FIXA
CHEMICAL X FIDC - INDUSTRIA PETROQUIMICA	102.834,82	0,31	0,51 0,07	1,54 -0,97	0,84 -1,17	0,78 -2,21	-0,34 -	2,14	RF - CREDITO PRIVADO
CHEMICAL XI FIDC SÊN	102.973,72	0,31	- -	- -	- -	- -	- -	-	RF - CREDITO PRIVADO
BRAM FI CP	323,00	-	0,40 -0,03	2,34 -0,17	1,86 -0,16	2,81 -0,18	6,41 -	0,07	RENDA FIXA
27511	13.030,81	0,04						-	RF-OUTROS
27544	-155.176,24	-0,47						-	RF-OUTROS
27570	46.537,74	0,14						-	RF-OUTROS
27582	-94.487,10	-0,28						-	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 30/09/2021	% DA CARTEIRA	RENTABILIDADE <sup>(a)</sup>				VOLAT. (% a.a.) 12m <sup>(c)</sup>	LIQUIDEZ	ESTRATÉGIA
			SETEMBRO 2021	6 MESES	12 MESES	24 MESES			
BENCHMARK <sup>(b)</sup>									
SEGMENTO RF									
27935	-65.969,36	-0,20					-		RF-OUTROS
27940	-138.267,21	-0,42					-		RF-OUTROS
27953	77.957,41	0,24					-		RF-OUTROS
27957	-36.759,59	-0,11					-		RF-OUTROS
FUT DI1F22	4.769,52	-					-		RF-OUTROS
FUT DI1F23	2.174,38	-					-		RF-OUTROS
FUT DI1F24	-490.943,11	-					-		RF-OUTROS
FUT DI1F27	349.188,77	-					-		RF-OUTROS
FUT DAPQ22	-105.380,03	-					-		RF-OUTROS
FUT DAPQ24	303.721,98	-					-		RF-OUTROS
CAIXA E PAGAR/RECEBER									
01-Tesouraria	239,55	-							
02-Pagar/receber	-13.384,81	-0,04							
<b>CARTEIRA CONSOLIDADA</b>	<b>33.161.909,08</b>	<b>100,00</b>	<b>0,42</b>	<b>2,15</b>	<b>2,01</b>	<b>2,80</b>	<b>6,07</b>		

(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	9	37,50%
MESES ABAIXO DO BENCHMARK	13	54,17%
MESES NEGATIVOS	2	8,33%

### MAIOR E MENOR DESEMPENHO NOS ÚLTIMOS 24 MESES

	RENTABILIDADE	MÊS
MAIOR RENTABILIDADE DA CARTEIRA	0,52%	Out/2019
MENOR RENTABILIDADE DA CARTEIRA	-0,02%	Fev/2021



## ANEXOS

### COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE CRÉDITO PRIVADO

CARACTERÍSTICAS	INDEXADOR	%	TAXA EMISSÃO	TAXA AQUISIÇÃO	ORIGEM	EMISSÃO	VENCIMENTO	% PL	RATING	AGÊNCIA
<b>CDB</b>								<b>0,14</b>		
CDB B.MERCED 01/09/2023	S-CDI	100,00	1,15	1,17	-	01/09/21	01/09/23	0,14	AAA	Fitch
<b>Debênture</b>								<b>7,95</b>		
DE252 B3SA 14/08/2024	S-CDI	100,00	1,75	1,75	-	19/08/20	14/08/24	1,12	Aaa	Moody's
DE252 BCBF 04/11/2025	S-CDI	100,00	2,65	2,65	-	24/11/20	04/11/25	0,41	AA+	Fitch
DE252 CELEO 15/11/2023	S-CDI	100,00	0,75	0,75	-	21/12/18	15/11/23	0,22	br AAA	Standard & Poor's
DE252 CEMAR 15/09/2022	S-CDI	107,00	-	-	-	13/10/17	15/09/22	0,14	AA-	Fitch
DE252 ECPT 15/01/2023	S-IPCA	100,00	8,25	5,68	-	15/01/11	15/01/23	0,07	Aa2	Moody's
DE252 ECPT 15/01/2023	S-IPCA	100,00	8,25	8,60	-	15/01/11	15/01/23	0,01	Aa2	Moody's
DE252 ECPT 15/04/2022	S-IPCA	100,00	8,25	5,68	-	15/01/11	15/04/22	0,02	Aa2	Moody's
DE252 ECPT 15/04/2022	S-IPCA	100,00	8,25	8,60	-	15/01/11	15/04/22	0,00	Aa2	Moody's
DE252 ECPT 15/07/2022	S-IPCA	100,00	8,25	5,68	-	15/01/11	15/07/22	0,02	Aa2	Moody's
DE252 ECPT 15/07/2022	S-IPCA	100,00	8,25	8,62	-	15/01/11	15/07/22	0,00	Aa2	Moody's
DE252 ECPT 15/10/2022	S-IPCA	100,00	8,25	5,68	-	15/01/11	15/10/22	0,07	Aa2	Moody's
DE252 ECPT 15/10/2022	S-IPCA	100,00	8,25	8,61	-	15/01/11	15/10/22	0,01	Aa2	Moody's
DE252 ELEKTRO 10/05/2026	S-CDI	100,00	1,60	1,60	-	13/05/21	10/05/26	0,23	br AAA	Standard & Poor's
DE252 ENERGISA 15/10/2022	S-CDI	107,75	-	-	-	31/10/17	15/10/22	0,04	AAA	Fitch
DE252 ENERGISA 15/10/2022	S-CDI	107,75	-	0,10	-	31/10/17	15/10/22	0,13	AAA	Fitch
DE252 ENERGISA 15/10/2022	S-CDI	107,75	-	0,18	-	31/10/17	15/10/22	0,10	AAA	Fitch
DE252 IRB 15/10/2023	S-CDI	100,00	3,35	2,62	-	28/10/20	15/10/23	0,05	br AAA	Standard & Poor's
DE252 IRB 15/10/2023	S-CDI	100,00	3,35	3,35	-	28/10/20	15/10/23	0,55	br AAA	Standard & Poor's
DE252 LAME 02/06/2023	S-CDI	100,00	3,00	3,00	-	03/06/20	02/06/23	0,45	AAA	Fitch
DE252 MRS 15/08/2026	S-CDI	100,00	1,30	1,30	-	22/09/21	15/08/26	0,23	AAA	Fitch
DE252 NCF PART 23/12/2023	S-CDI	100,00	1,50	1,10	-	23/12/20	23/12/23	0,27	AA+	Fitch
DE252 NCF PART 23/12/2023	S-CDI	100,00	1,50	1,50	-	23/12/20	23/12/23	2,44	AA+	Fitch
DE252 PETR 15/01/2026	S-CDI	106,25	-	-	-	12/02/19	15/01/26	0,30	br AAA	Standard & Poor's
DE252 PETR 15/08/2022	S-CDI	106,75	-	0,13	-	25/08/17	15/08/22	0,62	br AAA	Standard & Poor's
DE252 ULTRAPAR 05/03/2023	S-CDI	105,25	-	-	-	08/03/18	05/03/23	0,45	Aaa	Moody's
<b>DPGE</b>								<b>0,30</b>		
DPGE PARANA B 27/10/2022	S-CDI	100,00	1,35	1,35	-	27/10/20	27/10/22	0,15	brAA+	Standard & Poor's
DPGE SOFISA 01/09/2022	S-CDI	100,00	1,20	1,20	-	09/09/20	01/09/22	0,15	brAA	Standard & Poor's
<b>LF</b>								<b>37,33</b>		
LF252 ABC 04/10/2021	S-CDI	100,00	0,28	0,24	-	02/10/19	04/10/21	0,06	br AAA	Standard & Poor's
LF252 ABC 13/08/2024	S-CDI	100,00	1,30	1,30	-	13/08/21	13/08/24	0,43	br AAA	Standard & Poor's
LF252 ABC 17/04/2023	S-CDI	100,00	1,23	1,23	-	16/04/21	17/04/23	0,41	br AAA	Standard & Poor's
LF252 ABC 22/03/2023	S-CDI	100,00	1,23	1,23	-	22/03/21	22/03/23	0,69	br AAA	Standard & Poor's
LF252 ABC 25/06/2024	S-CDI	100,00	1,33	1,33	-	25/06/21	25/06/24	0,42	br AAA	Standard & Poor's

ANEXOS

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE CRÉDITO PRIVADO

CARACTERÍSTICAS	INDEXADOR	%	TAXA EMISSÃO	TAXA AQUISIÇÃO	ORIGEM	EMISSÃO	VENCIMENTO	% PL	RATING	AGÊNCIA
LF								37,33		
LF252 B VOTORA 04/03/2024	S-CDI	100,00	1,40	1,40	-	30/08/21	04/03/24	0,33	br AAA	Standard & Poor's
LF252 B VOTORA 05/12/2022	S-CDI	100,00	1,35	1,35	-	03/12/20	05/12/22	1,23	br AAA	Standard & Poor's
LF252 B VOTORA 10/02/2023	S-CDI	100,00	1,35	1,10	-	10/02/21	10/02/23	0,06	br AAA	Standard & Poor's
LF252 B VOTORA 10/02/2023	S-CDI	100,00	1,35	1,35	-	10/02/21	10/02/23	1,16	br AAA	Standard & Poor's
LF252 B VOTORA 28/04/2023	S-CDI	100,00	1,35	1,18	-	28/04/21	28/04/23	0,09	br AAA	Standard & Poor's
LF252 B VOTORA 30/11/2022	S-CDI	100,00	1,35	0,97	-	30/11/20	30/11/22	0,06	br AAA	Standard & Poor's
LF252 B.ALFA 09/03/2023	S-CDI	100,00	1,35	1,35	-	09/03/21	09/03/23	0,27	Aa1	Moody's
LF252 B.ALFA 27/05/2022	S-CDI	105,25	-	-	-	27/05/19	27/05/22	1,21	Aa1	Moody's
LF252 B.MERCEDES 02/12/2022	S-CDI	100,00	1,25	1,25	-	27/11/20	02/12/22	0,42	AAA	Fitch
LF252 BANCO XP 21/12/2023	S-CDI	100,00	1,60	1,60	-	22/06/21	21/12/23	0,09	AA	Fitch
LF252 BANCO XP 28/06/2023	S-CDI	100,00	1,50	1,50	-	22/06/21	28/06/23	0,09	AA	Fitch
LF252 BANCO XP 28/06/2024	S-CDI	100,00	1,70	1,70	-	22/06/21	28/06/24	0,09	AA	Fitch
LF252 BBM 19/10/2022	S-CDI	100,00	1,35	1,35	-	16/10/20	19/10/22	0,31	Aaa	Moody's
LF252 BC RCI 16/11/2022	S-CDI	100,00	1,35	1,35	-	16/10/20	16/11/22	0,55	Aaa	Moody's
LF252 BNP 30/05/2023	S-CDI	100,00	1,00	1,00	-	28/05/21	30/05/23	0,47	br AAA	Standard & Poor's
LF252 BRADESCO 04/11/2021	S-CDI	103,70	-	0,19	-	04/10/18	04/11/21	0,06	br AAA	Standard & Poor's
LF252 BRADESCO 18/10/2022	S-CDI	104,50	-	1,10	-	18/10/19	18/10/22	0,12	Aaa	Moody's
LF252 BRADESCO 27/03/2023	S-CDI	100,00	0,70	0,70	-	26/03/21	27/03/23	7,10	br AAA	Standard & Poor's
LF252 BRADESCO 31/05/2022	S-CDI	103,50	-	0,31	-	31/05/19	31/05/22	0,18	br AAA	Standard & Poor's
LF252 BTG PACT 17/04/2023	S-CDI	100,00	1,20	1,20	-	16/04/21	17/04/23	0,95	brAA+	Standard & Poor's
LF252 BTG PACT 26/06/2023	S-CDI	100,00	1,20	1,20	-	25/06/21	26/06/23	0,71	brAA+	Standard & Poor's
LF252 CNH 08/04/2023	S-CDI	100,00	1,35	1,35	-	29/03/21	10/04/23	0,32	AAA	Fitch
LF252 CNH 28/09/2024	S-CDI	100,00	1,25	1,25	-	28/09/21	28/09/24	0,16	AAA	Fitch
LF252 DAYCOVAL 07/12/2022	S-CDI	100,00	1,50	1,50	-	07/12/20	07/12/22	0,50	brAA+	Standard & Poor's
LF252 DAYCOVAL 07/12/2023	S-CDI	100,00	1,80	1,80	-	07/12/20	07/12/23	0,50	brAA+	Standard & Poor's
LF252 DAYCOVAL 13/08/2026	S-CDI	100,00	1,80	1,80	-	13/08/21	13/08/26	0,23	brAA+	Standard & Poor's
LF252 DAYCOVAL 28/10/2022	S-CDI	100,00	1,50	1,50	-	27/10/20	28/10/22	1,24	brAA+	Standard & Poor's
LF252 FIDIS 27/09/2024	S-CDI	100,00	1,30	1,30	-	27/09/21	27/09/24	0,22	AAA	Fitch
LF252 GMACBM 16/05/2024	S-CDI	100,00	1,45	1,45	-	17/05/21	16/05/24	0,11	AAA	Fitch
LF252 GMACBM 28/09/2023	S-CDI	100,00	1,10	1,10	-	28/09/21	28/09/23	0,11	AAA	Fitch
LF252 PARANA B 08/05/2023	S-CDI	100,00	1,60	1,60	-	06/05/21	08/05/23	0,23	brAA+	Standard & Poor's
LF252 PORTOSE 01/03/2022	S-CDI	104,40	-	-	-	01/03/19	01/03/22	0,15	AA	Fitch
LF252 SAFRA 06/05/2024	S-CDI	100,00	1,35	1,35	-	04/05/21	06/05/24	0,15	br AAA	Standard & Poor's
LF252 SAFRA 11/07/2022	S-CDI	106,00	-	-	-	11/01/19	11/07/22	0,75	br AAA	Standard & Poor's
LF252 SAFRA 19/09/2022	S-CDI	100,00	0,40	0,40	-	18/09/19	19/09/22	0,50	br AAA	Standard & Poor's
LF252 SAFRA 21/01/2022	S-CDI	106,00	-	-	-	23/07/18	21/01/22	1,18	br AAA	Standard & Poor's
LF252 SAFRA 21/10/2022	S-CDI	106,25	-	-	-	21/02/19	21/10/22	0,92	br AAA	Standard & Poor's

ANEXOS

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE CRÉDITO PRIVADO											
CARACTERÍSTICAS	INDEXADOR	%	TAXA EMISSÃO	TAXA AQUISIÇÃO	ORIGEM	EMISSÃO	VENCIMENTO	% PL	RATING	AGÊNCIA	
<b>LF</b>											<b>37,33</b>
LF252 SAFRA 22/03/2024	S-CDI	100,00	1,35	1,35	-	22/03/21	22/03/24	0,51	br AAA	Standard & Poor's	
LF252 SAFRA 22/08/2022	S-CDI	106,00	-	-	-	21/02/19	22/08/22	0,92	br AAA	Standard & Poor's	
LF252 SAFRA 22/09/2023	S-CDI	100,00	1,25	1,25	-	22/03/21	22/09/23	0,51	br AAA	Standard & Poor's	
LF252 SAFRA 30/01/2023	S-CDI	100,00	1,15	1,15	-	29/01/21	30/01/23	1,51	br AAA	Standard & Poor's	
LF252 SOFISA 04/08/2023	S-CDI	100,00	1,75	1,75	-	04/08/21	04/08/23	0,11	brAA	Standard & Poor's	
LF252 SOFISA 12/06/2023	S-CDI	100,00	1,85	1,85	-	09/06/21	12/06/23	0,22	brAA	Standard & Poor's	
LF252 VOLKSWAG 27/03/2023	S-CDI	100,00	1,15	1,15	-	26/03/21	27/03/23	0,32	br AAA	Standard & Poor's	
LF252 VOLKSWAG 29/08/2025	S-CDI	100,00	1,40	1,40	-	30/08/21	29/08/25	0,23	br AAA	Standard & Poor's	
LFS ITAU 29/08/2022	S-IPCA	100,00	5,55	7,73	-	27/08/12	29/08/22	1,10	br AAA	Standard & Poor's	
LFSC BRADESCO 15/03/2050	S-SELIC	120,00	-	2,77	-	14/11/18	15/03/24	0,02	br AAA	Standard & Poor's	
LFSN BRADESCO 03/08/2026	S-CDI	109,10	-	-	-	03/08/18	03/08/26	1,09	br AAA	Standard & Poor's	
LFSN BRADESCO 14/04/2025	S-CDI	100,00	1,17	1,04	-	13/04/17	14/04/25	0,61	br AAA	Standard & Poor's	
LFSN BRADESCO 14/04/2025	S-CDI	100,00	1,17	1,08	-	13/04/17	14/04/25	0,09	br AAA	Standard & Poor's	
LFSN BRADESCO 14/04/2025	S-CDI	100,00	1,17	1,09	-	13/04/17	14/04/25	0,09	br AAA	Standard & Poor's	
LFSN BRADESCO 14/07/2025	S-CDI	100,00	1,17	1,17	-	13/04/17	14/07/25	4,25	br AAA	Standard & Poor's	
LFSN ITAUUBB 13/11/2030	S-CDI	100,00	2,00	2,00	-	13/11/20	13/11/30	0,92	br AAA	Standard & Poor's	
<b>NP</b>											<b>0,74</b>
NC ENERGISA 23/07/2024	S-CDI	100,00	1,80	1,80	-	23/07/21	23/07/24	0,74	AAA	Fitch	

ANEXOS

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS

CARACTERÍSTICAS	INDEXADOR	%	TAXA EMISSÃO	TAXA AQUISIÇÃO	ORIGEM	EMIÇÃO	VENCIMENTO	% PL
<b>Compromissadas</b>								<b>29,02</b>
LFT 01/10/2021<O>	S-PRE	100,00	6,14	6,14	-	30/09/21	01/10/21	29,02
LFT 01/10/2021<O>	S-PRE	100,00	6,14	6,14	BRAM FI CP	30/09/21	01/10/21	0,00
LTN 01/10/2021<O>	S-PRE	100,00	6,14	6,14	BRAM FI CP	30/09/21	01/10/21	0,00
LTN 30/09/2021<O>	S-PRE	100,00	6,14	6,14	BRAM FI CP	29/09/21	30/09/21	0,00
NTN 01/10/2021<O>	S-PRE	100,00	6,14	6,14	BRAM FI CP	30/09/21	01/10/21	0,00
NTN 30/09/2021<O>	S-PRE	100,00	6,14	6,14	-	29/09/21	30/09/21	0,00
<b>LFT</b>								<b>20,98</b>
LFT 01/03/2022	S-SELIC	100,00	-	-	-	08/01/16	01/03/22	2,65
LFT 01/03/2022	S-SELIC	100,00	-	0,01	-	08/01/16	01/03/22	2,35
LFT 01/03/2022	S-SELIC	100,00	-	0,03	-	08/01/16	01/03/22	0,28
LFT 01/03/2022	S-SELIC	100,00	-	0,12	-	08/01/16	01/03/22	0,81
LFT 01/03/2023	S-SELIC	100,00	-	0,01	-	13/01/17	01/03/23	0,16
LFT 01/03/2023	S-SELIC	100,00	-	0,14	-	13/01/17	01/03/23	0,94
LFT 01/03/2024	S-SELIC	100,00	-	0,01	-	05/01/18	01/03/24	0,64
LFT 01/03/2025	S-SELIC	100,00	-	0,02	-	26/10/18	01/03/25	1,81
LFT 01/09/2022	S-SELIC	100,00	-	0,11	-	08/07/16	01/09/22	0,43
LFT 01/09/2022	S-SELIC	100,00	-	0,13	-	08/07/16	01/09/22	0,81
LFT 01/09/2023	S-SELIC	100,00	-	0,01	-	14/07/17	01/09/23	3,11
LFT 01/09/2024	S-SELIC	100,00	-	0,02	-	06/07/18	01/09/24	1,13
LFT 01/09/2025	S-SELIC	100,00	-	0,02	-	08/03/19	01/09/25	0,16
LFT 01/09/2025	S-SELIC	100,00	-	0,04	-	08/03/19	01/09/25	3,31
LFT 01/09/2026	S-SELIC	100,00	-	0,04	-	13/03/20	01/09/26	2,39
<b>LTN</b>								<b>1,48</b>
LTN 01/01/2024	S-PRE	100,00	-	5,47	-	03/01/20	01/01/24	0,84
LTN 01/01/2024	S-PRE	100,00	-	5,53	-	03/01/20	01/01/24	0,64
<b>NTNB</b>								<b>2,51</b>
NTN-B 15/05/2023	S-IPCA	100,00	6,00	1,90	-	15/01/14	15/05/23	0,11
NTN-B 15/05/2025	S-IPCA	100,00	6,00	3,12	-	08/01/20	15/05/25	0,80
NTN-B 15/08/2022	S-IPCA	100,00	6,00	1,34	-	13/10/11	15/08/22	0,56
NTN-B 15/08/2022	S-IPCA	100,00	6,00	3,60	-	13/10/11	15/08/22	0,47
NTN-B 15/08/2024	S-IPCA	100,00	6,00	1,99	-	15/10/03	15/08/24	0,23
NTN-B 15/08/2050	S-IPCA	100,00	6,00	4,29	-	10/02/10	15/08/50	0,18
NTN-B 15/08/2050	S-IPCA	100,00	6,00	4,49	-	10/02/10	15/08/50	0,08
NTN-B 15/08/2050	S-IPCA	100,00	6,00	4,50	-	10/02/10	15/08/50	0,08

ANEXOS

FUNDOS DE INVESTIMENTO	Nº DE COTAS ANTERIOR	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÃO		RESGATE		IRRF +IOF	Nº DE COTAS ATUAL	VALOR ATUAL DA COTA	SALDO BRUTO ATUAL
			Nº DE COTAS	VALOR	Nº DE COTAS	VALOR				
BRAM FIM CREDITO PRIVADO MU	33.117,47	33.258.813,81	2,45	2.465,95	235,39	237.369,89	0,00	32.884,53	1.008,721694	33.171.338,50
TOTAL		33.258.813,81								33.171.338,50

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

---