



Abril/2023





1. INTRODUÇÃO

Este relatório tem como objetivo apresentar os controles realizados pela EMBRAER PREV, com base nas informações disponibilizadas pelo administrador, referentes aos riscos de mercado, de crédito, operacionais, de liquidez e legal, bem como do desempenho dos investimentos da Entidade em relação aos seus índices de referência.

Os limites e critérios definidos para o controle e monitoramento dos riscos informados seguem as definições estabelecidas na Política de Investimento dos Planos administrados pela EMBRAER PREV, bem como na Resolução CMN Nº 4.994/2022.

2. RISCO DE MERCADO

Para o acompanhamento do risco de mercado da carteira de investimentos da EMBRAER PREV, a Entidade adotará a metodologia de avaliação de risco conhecida como o Valor em Risco (*VaR*), que indica a probabilidade de perda de uma carteira de investimentos para um determinado intervalo de confiança e prazo. O intervalo de confiança e prazos a serem utilizados serão definidos em Política de Investimento. Quando não houver essa definição, a Entidade deverá usar um intervalo de confiança de 95% e prazo de 21 dias úteis (um mês). O *VaR* poderá ser calculado de forma absoluta ou relativa. Para as carteiras de renda variável o *tracking error (TE)* pode ser empregado como uma alternativa ao *VaR*. Os seguintes relatórios elaborados pelo administrador são utilizados pela EMBRAER PREV para o controle de risco de mercado:

2.1 Relatório Detalhado de Risco



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO
E CONTROLE DE RISCO - ABRIL DE 2023



Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS
CNPJ: 10679245000140

Data: 28/04/2023

Dados Gerais		Limites Fundo:		ENQUADRAMENTO		0,00% Duração DC:		1,767 03	
PL:	2,0950%	Status:							
VAR:	2,5143%	Benchmark:							
ETL:	0,0225%								

Cenários de STRESS										
Cenário Alta - 09999 (+):	1.838.346.792.730.510.000,00	Cenário Baixa - 10000 (-):	2.086.877.189.706.860.000,00	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	3.952.556.044.343.010.000,00	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	489.135.085.232.481.000,00			
Cenário Alta - 09999 (+):	206.877.196.360	Cenário Baixa - 10000 (-):	(209.793.101,41)	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	(177.644.875,77)	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(422.307.869,77)			
Cenário Alta - 09999 (+):	1.838.346.792.523.830.000,00	Cenário Baixa - 10000 (-):	2.086.877.189.497.060.000,00	CENÁRIO BRADESCO 1:	3.952.556.044.165.360.000,00	CENÁRIO BRADESCO 2:	489.135.084.810.094.000,00			

Parâmetros do Cálculo									
Modelo:	Var Paramétrico	Modelo Volatilidade:	EWMA						
Int. Confiança:	21	Lambda:	0,94						
Horizonte:	21								

Produto	MIM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
ITH16854	8.298.210,09	24.897,52	-6.644,85	-0,31%	-231.990,40	127.029,42	145.816,95	-132.896,21
AEP23	14.873.314,48	67.190,79	-35.391,78	-0,44%	1.337.061,40	-2.865.199,02	1.400.094,29	-1.411.554,82
CCRDD1	6.250.572,27	27.786,85	-17.768,83	-0,28%	0,00	0,00	0,00	0,00
CMPT33	1.341.183,76	5.714,35	-3.444,92	-0,00%	-434.858,76	131.940,63	190.340,23	-254.072,79
CSMGG3	13.254.872,52	54.299,57	-35.580,47	-0,44%	-8.195,16	6.826,65	11.340,47	-16.309,49
ELE24	13.916.769,89	97.752,30	-34.499,00	-0,04%	1.091.035,85	-1.091.035,85	319.891,71	-322.510,20
ENJG21	1.903.790,08	7.946,06	-2.384,66	-0,00%	113.641,61	-113.641,61	66.639,44	-67.842,92
ENM21	1.186.299,46	5.039,95	-1.309,97	-0,00%	3.484.298,78	-2.488.784,84	1.459.423,43	-1.471.369,60
ENTV2	38.531.023,73	244.300,61	-163.358,35	-0,14%	-5.216,46	4.280,61	1.422.307.869,77	-10.482,76
ERDV17_VENCIMENTO	13.052.544,50	59.168,72	-33.278,68	-0,44%	-972.846,39	568.585,48	674.318,61	-531.329,56
ERDV36	4.166.377,66	18.908,52	-11.981,37	-0,01%	-83.577,81	47.997,40	52.712,94	-69.066,08
GASP17	63.194.157,56	393.576,06	-66.974,27	-0,08%	-253,70	206,02	372,99	-534,28
GEPA2	7.750.535,91	35.392,09	-25.272,50	-0,33%	-437,31	521,16	521,16	-1.290,27
GRRB24_VENCIMENTO	15.445.186,32	111.293,44	-39.967,79	-0,05%	388.342,91	-388.342,91	189.770,24	-191.323,61
IGSN15	2.578.516,03	18.083,45	-27.222,10	-0,00%	323.876,63	-291.924,60	166.528,82	-167.891,95
LFSN16000GM	13.882.106,22	66.975,08	-26.539,43	-0,23%	2.036.334,05	-2.525.054,22	1.194.106,28	-1.203.880,69
LFSN16000CS	4.518.067,41	22.025,78	-18.067,41	-0,00%	73.977,92	-79.379,54	25.890,90	-25.891,77
NEOE16	7.069.334,12	51.713,55	-19.372,60	-0,00%	3.043.086,76	-3.043.086,76	1.784.465,08	-1.799.072,89
NTNB20230515 - 760199_VENCIMENTO	44.682.588,75	39.477,57	-31.109,40	-0,24%	3.183.576,51	-3.183.576,51	1.866.849,27	-1.882.130,43
NTNB20240815 - 760199_VENCIMENTO	121.206.085,83	867.058,02	-676.887,83	-0,79%	230.984,06	-230.984,06	135.449,05	-136.657,77
NTNB20260815 - 760199_VENCIMENTO	41.951.117,59	292.140,60	-129.302,94	-0,15%	2.898.856,84	-2.898.856,84	1.699.393,51	-1.713.504,22
NTNB20300815 - 760199_VENCIMENTO	25.905.098,19	285.888,18	-206.343,28	-0,24%	811.074,68	-811.074,68	594.517,74	-599.384,19
NTNB20350815 - 760199_VENCIMENTO	233.569.064,18	5.085.288,39	-4.572.662,35	-0,24%	0,00	0,00	0,00	-21,24
NTNB20400815 - 760199_VENCIMENTO	28.557.430,33	930.085,24	-875.125,60	-1,02%	-109,90	89,26	172,78	-172,78
NTNB20450815 - 760199_VENCIMENTO	221.409.962,87	8.451.004,71	-7.997.104,98	-0,35%	-1.449,47	1.171,83	1.221,35	-3.231,30
NTNB20500815 - 760199_VENCIMENTO	691.876.205,30	29.374.336,66	-27.789.997,86	-0,34%	433.711,58	-433.711,58	254.329,47	-256.410,28
NTNB20550815 - 760199_VENCIMENTO	221.058.398,78	9.712.883,63	-9.110.582,63	-10,85%	-161,48	132,65	282,63	-417,08
OMGCE31	12.878.652,82	62.406,16	-4.279,87	-0,01%	2.994.889,44	-2.994.889,44	439.050,79	-442.644,66
PETRE8	16.411.626,53	91.789,02	-60.194,19	-0,07%	-2.846.812,10	-3.436.780,78	1.439.520,18	-1.451.305,43
SBSPC2	16.468.205,61	70.200,54	-42.344,55	-0,05%	0,00	0,00	0,00	0,00
TAE33	8.239.378,49	38.125,94	-24.870,21	-0,43%	913.750,60	-913.750,60	133.855,84	-135.052,34
ABEV3	9.550.438,56	876.386,36	-404.581,55	-0,07%	93.011,43	-62.152,79	43.232,21	-43.586,09
AEOP3	667.708,63	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
AEOP1	1.910.321,34	1.860,02	1.096,83	0,00%	84.585,11	-84.585,11	49.690,71	-50.006,72
AIEC11	2.182.071,70	74.965,61	-47.785,32	-0,06%	143.098,52	-138.426,26	38.142,26	-38.454,48
ALPA4	454.566,45	50.690,30	-16.796,45	-0,02%	-449.864,13	287.324,90	332.704,26	-402.707,97
ALSD3	9.955.139,36	87.792,13	-631.074,63	-0,74%	-8.163,50	6.702,98	11.374,78	-15.990,07
AMB13	2.650.859,59	276,90	-276,90	-0,00%	-293.033,69	139.454,52	127.404,52	-127.738,94
ANEM11	12.428.269,59	180.622,36	-133.609,00	-0,16%	47.620,35	-47.620,35	11.862,29	-14.676,58
ANET11	2.325.755,38	10.564,46	-169,94	-0,00%	-538.849,65	417.443,89	403.227,17	-511.842,12
ANH810	632.617,08	42,76	-3,85	-0,00%	-462.871,82	270.589,31	278.335,88	-362.234,62
APR28	1.163.180,80	20,95	-20,95	-0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ARZ2	1.294.476,38	212.540,51	-91.620,83	-0,11%	-463.344,96	296.228,82	322.656,96	-405.676,43
ASA3	1.135.940,12	184.749,99	-116.728,66	-0,14%	0,00	0,00	0,00	0,00
AURE3	8.145.336,18	556.450,08	-399.007,47	-0,47%	11.793,35	-11.793,35	3.322,26	-4.357,64
AZUL4	1.761.398,98	77.898,31	-18.631,63	-0,02%	-85.373,45	78.909,34	102.300,01	-118.728,94
B3SA3	12.172.347,04	1.632.816,36	-1.334.450,45	-1,56%	-698.603,00	462.015,91	493.013,26	-622.113,02
BBA3	12.734.306,04	1.900.564,33	1.271.989,30	1,49%	-176.770,87	116.839,15	125.501,60	-115.019,41
BBD03	933.926,32	96.926,20	90.634,94	0,11%	-1,89	1,56	4,08	-6,11
BBD04	11.595.427,45	1.127.425,29	942.306,44	1,10%	-120.322,20	44.510,22	510,22	-14.852,52
BBS5	4.055.373,38	396.306,14	221.849,39	0,26%	464.423,07	-464.423,07	272.337,69	-274.566,92
BBTOPIND	249.135.563,16	3.174.908,95	2.745.434,03	3,21%	-551,70	449,44	906,35	-1.326,17
BCBF14	262.395,87	18,76	-7,08	-0,00%	-1.147,26	945,26	1.616,61	-2.249,16
BCE15	3.205.751,92	247,53	-85,76	-0,03%	-2.427,45	1.982,51	1.982,51	-5.133,07
BEEF3	1.734.846,30	430.607,11	-293.330,03	-0,34%	381.294,40	-381.294,40	111.795,52	-112.710,63
BKBR18	1.039.468,11	26,84	-16,97	-0,00%	-5.461,60	4.573,36	7.655,74	-10.402,04
BMLC11	2.994.889,44	106.155,99	61.245,67	0,07%	662.903,51	-552.419,80	323.938,85	-326.890,47
BPA11	9.915.374,66	2.335.714.334,53	2.163.944,53	0,00%	-1.026.903,74	203.374,08	203.374,08	-2.404.452,49
BPAN4	0,00	0,00	-33.660,69	-0,00%	-33.660,69	9.439,73	14.927,88	-14.927,88
BPM11	913.750,60	60.662,31	0,00%	0,07%	230.821,91	-259.215,59	129.433,36	-130.482,94
BRAP4	294.899,10	18.702,74	2.510,73	0,00%	89.407,70	-89.407,70	37.449,05	-37.755,59
BRELETRO	3.252.873,33	40.049,03	-1.951,11	-0,00%	-1.951,11	206.910,99	206.910,99	-2.404.452,49
BRF53	338.340,44	41.209,27	9.965,76	0,01%	-791.150,22	490.796,38	552.820,25	-690.869,20
BRKMS	260.179,13	38.846,58	44.167,75	0,05%	45.901,02	-64.261,43	26.916,36	-27.136,68
BRKP28	5.126.809,21	88.447,90	66.437,45	0,08%	-28.775,29	29.342,92	134.506,63	-204.410,78
BRKPA0	3.297.844,71	1.553,71	-87,72	-0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
BRST11	6.575.088,80	34.314,84	1.816,98	0,00%	-508.392,58	306.423,45	315.360,69	-489.683,18
BTG11	95.240,70	3.441,76	0,00%	0,07%	574.694,00	-574.694,00	421.250,70	-424.688,86
BTOW15	8.086.347,16	95.103,51	63.769,96	0,07%	94,45	-95,50	-293,73	446,15
CAE21	6.825.242,17	55.749,17	16.140,21	0,00%	322,89	-250,42	792,54	-792,54
CAD4	57.059,54	0,00	0,00	0,00%	467.391,32	-467.391,32	311.452,58	-314.091,99
CART13	6.469.102,46	78.178,83	-53.992,07	-0,06%	-0,31	1,42	1,42	-2,16
CASH1	127,60	1.309,66	518,08	0,00%	0,07	-0,07	-0,26	0,39
CASH3	29.493,38	6.166,63	-782,35	-0,00%	0,10	-0,10	-0,38	0,53
CBAN22	7.028.475,12	51.850,44	44.888,35	0,05%	-29,27	29,70	111,28	-168,37
CBAN32	9.539.940,71	119.704,50	82.568,40	0,10%	0,00	0,00	0,00	0,00
CBAN72	2.323.704,49	31.214,18	21.983,23	0,03%	70.444,75	-70.444,75	41.398,80	-41.646,94
CCPA3	41.211,91	0,22	-0,16	-0,00%	-412.344,70	263.905,19	263.905,19	-346.577,84
CCRO3	1.857.892,29	184.184,18	143.412,76	0,17%	6.444,90	5.444,96	9.177,00	-11.891,73
CEAB11	1.776.866,92	94,09	-45,17	-0,00%	217.412,23	-217.412,23	127.490,53	-128.534,11
CEBE22	570.591,54	217,62	75,83	0,00%	467.837,76	-574.179,84	311.758,39	-314.310,30
CEL012	3.302.295,74	423,12	-58,99	-0,00%	-4.209,95	3.524,62	6.895,56	-3.805,29
CEO11	762.588,80	27.718,55	-17.854,02	-0,01%	-295.298,26	85.665,18	128.007,35	-171.209,94
CGP13	2.138.176,66	1.185,75	647,50	0,00%	166.157,45	-124.623,20	60.897,78	-61.396,26
CIEL3	2.209.678,38	186.883,15	42.135,55	0,05%	18.821,04	-18.821,04	5.563,50	-5.563,50
CJEN13	4.595.963,19	54.397,37	37.567,35	0,04%	30.213,08	-17.899,36	16.730,79	-16.867,74
CMH4	1.992.991,50	154.540,61	144.614,66	0,17%	67.168,86	-69.900,0		



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO
E CONTROLE DE RISCO - ABRIL DE 2023



Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS
CNPJ: 10679245000140

Data: 28/04/2023

		Dados Gerais				Limite Fundo:		ENQUADRADO		0,00% Duração DC:		1,767.03	
PL:	4.267.195.191,23	VAR / PL:	2,9050%	Dados Gerais	501.145,65	Status:	1.761,46	ENQUADRADO	0,00%	Duração DC:	1,767.03	1,767.03	
VAR:	85.555.468,26	ETL / PL:	2,5143%	Limite Fundo:	4.584.450,21	Benchmark:	-4.372.097,17	ENQUADRADO	0,00%	Duração DC:	1,767.03	1,767.03	
ETL:	107.290.008,81	VAR / CDI:	0,0225%	Benchmark:	176.809,39	ENQUADRADO	40.225,51	ENQUADRADO	0,00%	Duração DC:	1,767.03	1,767.03	

Cenários de STRESS											
Cenário Alta - 09999 (+):	1.838.346.792.730.510.000,00	Cenário Baixa - 10000 (-):	2.086.877.189.706.860.000,00	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	3.952.556.044.343.010.000,00	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	489.135.085.232.481.000,00	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	2.086.877.189.497.060.000,00	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	489.135.085.232.481.000,00
Cenário Alta - 09999 (+):	1.838.346.792.523.830.000,00	Cenário Baixa - 10000 (-):	2.086.877.189.497.060.000,00	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	3.952.556.044.165.360.000,00	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	489.135.085.232.481.000,00	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	2.086.877.189.497.060.000,00	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	489.135.085.232.481.000,00

Parâmetros do Cálculo			
Modelo:	Var paramétrico	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	21	Lambda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
CIYR3	209.965,50	30.578,20	3.304,35	0,01%	501.145,65	21,16	82.706,56	-0,04
DAPK23	314,20	64.893,67	-54.173,97	-0,06%	-726,88	0,00	-31.418,46	0,24
DAPK25	-63.655,95	387.348,29	-292.216,62	-0,34%	-533.056,24	847.463,97	-1.086.279,58	1.091.211,38
DAPK27	-12.673,11	31.506,40	-6.554,98	-0,01%	20.064,29	-24.078,51	11.765,70	-11.862,01
DAPK35	1.717,27	16.125,68	-14.253,32	-0,02%	560.009,76	-550.246,42	329.429,84	-325.264,00
DAPQ24	-106.135,28	648.591,49	-505.294,91	-0,59%	477.581,93	-477.581,93	388.963,95	-392.147,83
DAPQ26	-114.396,28	297.213,41	-134.678,99	-0,16%	19,81	-20,10	-90,09	137,14
DAPQ28	13.813,37	116.994,62	-49.906,53	-0,06%	-2.176,34	1.761,46	3.128,13	-4.468,52
DAPQ38	9.852,23	68.400,36	-53.810,32	-0,06%	4.584.450,21	-4.372.097,17	2.169.396,93	-2.169.396,93
DASAA2	2.757.340,72	37,06	-21,91	0,00%	-762.163,91	482.181,06	487.195,90	-631.756,53
DHF24	746,02	3.742,74	2.662,93	0,00%	1.478.372,74	-1.135.794,92	613.617,34	-618.640,13
DHF25	-7.824,84	22.137,36	-3.947,63	0,00%	176.809,39	-176.809,39	103.681,03	-104.529,71
DHF26	25.514,46	87.907,76	40.017,97	0,05%	52.137,92	-41.161,50	40.225,51	-40.557,80
DHF27	-263.423,78	1.218.593,38	818.012,65	0,96%	2.915.641,46	-4.018.857,15	1.155.224,43	-1.164.680,55
DHF29	-615,87	4.458,88	3.621,98	0,00%	512.470,00	-663.197,13	441.930,45	-445.547,89
DHF31	-15.387,48	115.234,66	90.392,19	0,12%	-63.467,05	26.722,00	31.896,20	-42.200,86
DHF33	5.342,96	5.342,96	4.712,12	0,01%	163.855,50	-62.136,19	52.337,06	-34.913,24
DHJ24	-359,27	1.418,18	-860,05	0,00%	-80.842,49	17.372,89	20.628,98	-27.287,81
DHJ25	-228,05	661,41	-12,10	0,00%	-1.761.588,13	1.198.338,08	1.189.999,35	-1.531.437,69
DHJ26	9,69	105,76	77,48	0,00%	-198,76	164,10	355,80	-525,65
DHJ28	1.147,29	534,13	534,13	0,00%	5.797.578,23	-5.797.578,23	4.249.624,84	-4.249.624,84
DHJ29	44.623,69	126.446,55	-21.130,44	-0,02%	-105.916,58	30.667,07	45.947,31	-61.367,45
DHJ29	22.799,51	94.319,26	-55.524,85	-0,06%	-366.071,12	105.992,18	188.804,07	-212.099,49
DHJ29	-1.694,90	9.880,76	-7.472,30	-0,01%	-55,55	49,07	119,41	-178,34
DHJ29	-565,03	1.506,55	-525,98	0,00%	-468,99	30.767,13	38.105,70	-61.084,71
DOLK23	-3.405,18	0,00	0,00	0,00%	-216.430,69	72.259,24	100.547,92	-133.439,85
DOLK23C005400	0,25	4,09	-2,67	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DOLK23C005600	-0,25	2,92	1,91	0,00%	-48,60	45,71	122,69	-184,04
DOLK23	-14.465,67	416.344,10	341.392,54	0,40%	47.748,00	-47.748,00	8.749,82	-8.749,82
DXC03	80.257,14	10.217,05	4.153,69	0,02%	1.358,46	-20.382,68	9.960,24	-10.941,87
ECOR3	2.200.839,00	543.016,87	443.639,09	0,52%	57.969,65	-57.969,65	42.491,75	-42.839,57
EGE03	2.655.232,96	122.149,79	-18.054,22	-0,02%	521.482,50	-521.482,50	152.898,67	-154.150,23
ELEH27	2.876.323,91	0,36	0,16	0,00%	877.665,64	-877.665,64	257.331,66	-259.437,66
ELET13	2.034.562,41	391,95	-19,16	0,00%	-2.048.195,90	2.488.333,81	1.879.985,20	-2.461.642,46
ELET13	14.798.069,10	2.732.717,83	2.516.147,40	2,94%	-1.127.895,74	689.985,88	824.238,17	-885.370,53
ELET6	4.185.657,19	838.738,36	766.296,40	0,90%	-38.851,97	11.409,19	16.205,34	-21.937,13
EMBR3	707.237,56	118.898,21	-78.796,46	-0,09%	1.500.910,56	-1.500.934,40	880.133,95	-887.338,32
ENBR3	274.410,00	18.630,91	-6.601,56	-0,01%	2.558.296,35	-2.558.341,51	833.450,81	-840.273,06
ENEV3	7.880.112,05	814.908,99	444.334,01	0,52%	-1.881,69	1.523,78	2.838,96	-4.099,68
ENGI11	3.014.532,40	456.347,89	425.723,38	0,50%	1.574.935,63	-1.400.083,95	1.282.826,92	-1.293.327,55
ENJ13	230.130,00	54.122,69	30.160,83	0,04%	116.896,35	-96.413,63	96.536,95	-96.999,74
EQL13	1.433.729,94	33,01	-21,21	0,00%	43.098,91	-43.141,03	-10,16	-10,16
EQL13	28.987.891,16	3.282.901,43	2.760.736,83	3,23%	-438,67	356,01	644,12	-922,29
ERDV17	3.776.536,21	17.119,48	-9.628,69	-0,01%	-464.853,10	288.372,64	292.160,60	-378.615,06
ERDV18	1.340.746,57	1.773,73	-5,86	0,00%	-863.208,96	847.228,00	584.918,10	-718.807,88
ERDV28	5.539.924,78	26.933,83	-4.859,14	0,00%	1.424.115,00	-1.424.115,00	20.775,24	-210.464,20
ERDV40	2.108.526,12	0,00	0,00	0,00%	-1.162,88	3.394,98	5.934,57	-3.392,62
ETEN13	1.310.079,43	5,84	-4,39	0,00%	1.487.463,47	-1.487.463,47	641.359,25	-646.609,12
EUC4	59.685,00	15.034,54	-8.110,62	-0,01%	-803.880,22	480.344,54	556.444,97	-691.538,87
EZT3	67.942,10	9.139,00	8.828,36	0,01%	2.683.950,93	-2.683.950,93	639.624,54	-639.624,54
FLRY3	289.848,24	13.722,09	8.099,73	0,01%	-304.530,99	228.488,99	228.488,92	-285.141,75
FVPG11	1.042.965,00	133.332,42	70.202,89	0,08%	0,00	0,00	0,00	0,00
GALG11	1.756.331,27	79.175,53	62.163,69	0,07%	1.870.838,15	-1.870.838,15	548.829,16	-553.019,17
GSPM11	10.340.233,91	249.652,72	196.656,61	0,23%	-856.375,13	856.375,13	62.154,13	-62.154,13
GGBR4	6.003.642,22	170.490,29	317.450,52	0,37%	170.244,79	-155.440,90	108.512,55	-109.400,78
GGPS3	5.685.203,35	304.841,48	47.112,80	0,06%	-168.151,22	105.461,92	115.783,07	-145.784,08
GGSH12	2.386.764,65	316,94	-80,88	0,00%	-16.602.435,81	899.343,42	599.346,75	-52.716.939,06
GMA13	8.750.524,67	1.077.783,57	239.301,65	0,03%	19.564.211,89	-643.195,23	61.821,20	63.185.417,30
GOU4	385.654,50	38.737,86	21.763,70	0,00%	-3.220.891,21	59.146,50	19.145,50	-10.591.008,99
GOLL4	71.831,52	15.583,75	2.902,63	0,00%	-5.211.460,68	167.356,48	-16.297.972,16	167.357,04
GRRB14	1.089.228,63	75,31	-4,84	0,00%	-195.106,37	5.421.510,81	16.521.666,51	-16.521.666,51
CRIB24	8.137.851,10	58.537,50	21.067,85	0,00%	-1.981.871,79	-1.981.871,79	56.924,54	-56.924,54
GTG11	1.424.115,00	59.630,02	36.924,81	0,04%	-177.721,21	2.047.358,19	5.133.122,07	-177.721,21
GUAR15	2.797.660,86	732,33	99,51	0,00%	-798.174,96	6.005.346,34	14.192.913,93	-798.174,96
HAPV3	4.374.892,56	2.350.678,05	1.692.542,94	1,98%	898.284,22	-6.099.036,11	-14.288.778,10	898.288,70
HAG11	9.851.335,85	146.191,70	107.156,67	0,01%	107.156,67	-6.440.762,12	-14.841.259,69	1.453.677,94
HBRH11	2.683.950,93	96.938,50	-53.079,48	-0,06%	-1.595.440,26	6.480.792,97	14.683.435,50	-1.595.476,30
HBSA21	4.421.499,83	52.853,17	35.347,80	0,04%	-293.249,46	8.093,52	1.906.049,02	-1.906.049,02
HSLG11	2.321.006,51	0,00	0,00	0,00%	230.776,11	-7.918,46	-7.918,56	1.843.463,54
HSM11	3.741.375,15	259.984,83	197.621,46	0,23%	-290.728,55	13.255.678,44	56.924,54	-472.684,09
HVRD15	10.117.638,88	157.087,89	113.592,06	0,13%	489.759,99	-16.809.345,24	-62.590.750,70	489.759,99
HYPE3	740.194,75	66.244,54	-36.775,89	-0,04%	2.743.988,31	-15.140.750,26	-55.312.287,09	2.743.992,16
HZTF14	2.400.811,43	27.971,84	19.278,36	0,02%	-5.703.188,93	15.958.311,32	58.277.695,87	-5.731.145,85
IDIF24C382500	-590.346,75	800.623,91	-580.836,39	-0,67%	1.935.856,17	272.197,96	984.301,32	-146.475,84
IDIF24C382600	643.203,20	873.007,06	621.136,32	0,73%	342.335,73	545.103,94	1.991.132,73	3.907.577,30
IDIF24C382700	-99.146,58	133.847,54	-95.231,26	-0,11%	-192.805,29	272.251,52	994.701,05	-243.838,14
IDIF24P380000	-167.357,04	212.352,10	161.886,52	0,18%	-171.545,05	107.840,44	117.162,17	-148.209,78
IDIF24P380300	195.247,15	241.358,76	-171.724,49	-0,20%	-4.924,13	-3.871,67	-1.030,29	10.363,35
IDIF24P381200	-159.882,65	167.810,23	119.395,40	0,14%	1.143.425,74	-1.143.425,74	838.131,07	-844.991,63
IDIF24P381300	177.722,11	183.356,21	-130.456,22	-0,15%	1.302.956,82	-1.300.429,61	1.021.102,80	-1.021.102,80
IDIF24P381600	798.178,70	371.875,40	-520.722,47	-0,61%	0,00	0,00	0,00	0,00
IDIF24P381700	-895.288,70	796.731,30	569.151,92	-0,41%	-1.537.553,43	341.664,62	373.335,10	-472.684,09
IDIF24P382400	-1.453.677,94	1.043.721,24	746.155,30	0,87%	-473.114,13	2.00.898,34	244.723,81	-323.048,47
IDIF24P382500	1.595.476,30	1.090.197,95	-775.665,59	-0,91%	8			



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO
E CONTROLE DE RISCO - ABRIL DE 2023



Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS
CNPJ: 10679245000140

Data: 28/04/2023

Dados Gerais		Limite Fundo:		ENQUADRADO		0,00% Duração DC:		1,767.03	
PL:	4.267.195.191,23	VAR / PL:	2,9050%	Status:					
VAR:	85.555.465,26	ETL / PL:	2,5143%	Benchmark:					
ETL:	107.290.008,81	VAR / CDI:	0,0225%						

Cenários de STRESS										
Cenário Alta - 09999 (+):	1.838.346.792.730.510.000,00	Cenário Baixa - 10000 (-):	2.086.877.189.706.860.000,00	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	3.952.556.044.343.010.000,00	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	489.135.085.232.481.000,00			
Cenário Alta - 09999 (+):	206.877.196.360.000,00	Cenário Baixa - 10000 (-):	2.086.877.189.497.060.000,00	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	(177.644.875,77)	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(422.307.869,77)			
Cenário Alta - 09999 (+):	1.838.346.792.523.830.000,00	Cenário Baixa - 10000 (-):	2.086.877.189.497.060.000,00	CENÁRIO BRADESCO 1:	3.952.556.044.165.360.000,00	CENÁRIO BRADESCO 2:	489.135.084.810.094.000,00			

Parâmetros do Cálculo			
Modelo:	VaR paramétrico	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95	Lambda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	Mili	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
LF00210050	1.198.770,63	0,00	0,00	0,00%	-302.815,69	512.355,19	123,43	-191,23
LF002100E1F	1.231.626,73	0,00	0,00	0,00%	-38.274,67	127.269,43	1.636,40	-2.491,15
LF002100HDP	1.425.278,73	0,00	0,00	0,00%	-55.654,40	96.882,58	2.374,47	-3.613,89
LF002100HQD	2.596.486,32	0,00	0,00	0,00%	-10.256,21	30.627,96	1.802,91	-2.741,29
LF002100S1J	2.061.922,59	0,00	0,00	0,00%	-125,13	111,42	271,14	-404,97
LF00220018H	1.203.004,91	0,00	0,00	0,00%	-2.495,18	2.482,40	3.464,05	-4.727,41
LF002200N09	2.270.252,18	0,00	0,00	0,00%	-244.137,11	103.285,35	123.501,85	-163.501,69
LFSFC1900089	3.399.398,41	0,00	0,00	0,00%	-406.818,31	315.201,63	303.972,41	-386.265,70
LFSFC190054S	830.060,00	0,00	0,00	0,00%	1.187.206,21	-1.197.206,21	877.552,41	-684.735,29
LFSFC190059S	1.257.278,64	0,00	0,00	0,00%	-233,85	193,50	407,88	-599,69
LFSFC190051S	831.754,84	0,00	0,00	0,00%	-3.038,38	3.276,10	11.453,63	-17.309,54
LFSFC220020X	4.991.054,10	2.642,24	975,76	0,00%	-28.840,66	22.435,10	48.788,19	-73.770,63
LF02N21002N	4.041.359,23	70,04	0,00	0,00%	-717.815,77	623.841,96	999.207,47	-1.405.291,31
LFT20200901 - 210100	84.366.909,03	3.858,95	-2.867,67	0,00%	536.143,68	-372.311,63	359.143,68	-727.516,59
LFT20240301 - 210100	18.403.814,03	1.396,64	-950,86	0,00%	148.731,00	-148.745,14	54.512,50	-54.512,50
LFT20200901 - 210100	23.603.696,54	6.295,96	-6.734,59	-0,01%	1.321.326,40	-1.221.326,40	358.092,90	-361.024,08
LFT20250901 - 210100	9.298.031,51	6.226,75	-5.601,47	-0,01%	385.883,48	-385.883,48	188.470,55	-190.013,29
LFT20200901 - 210100	1.741.352,96	1.412,33	-1.250,16	0,00%	618.077,42	-619.079,30	181.514,05	-182.999,84
LIGHB4	2.198.975,33	17,56	-13,30	0,00%	953.766,12	-825.422,05	268.904,16	-271.105,29
LIGHD3	687.782,98	542,82	286,87	0,00%	-5.907,21	4.968,23	8.247,43	-11.124,95
LIGHD7	5.841.558,48	29.715,04	-90,79	0,00%	-543.355,28	403.533,26	395.627,30	-504.406,61
LORTA7	5.978.362,04	71.336,72	47.624,50	0,06%	37.769,57	-28.323,72	13.843,08	-13.856,39
LREN3	5.986.031,04	710.170,74	-371.507,91	-0,43%	748.517,76	-748.517,76	365.775,68	-368.769,75
LRENB1	1.389.883,55	39,22	-20,85	0,00%	-324.813,84	209.696,07	214.425,68	-275.688,25
LTN0220701 - 100000	1.994.858,16	305,20	-234,77	0,00%	1.929.733,89	-1.606.111,58	942.896,63	-930.715,86
LTN022040101 - 100000	2.290.190,69	4.432,24	-3.016,87	0,00%	386.745,88	-254.076,79	282.878,93	-331.394,12
LTN0220701 - 100000	15.513.375,14	146.661,04	22.893,07	0,03%	468.250,00	-468.250,00	137.290,90	-137.290,90
LTN02260701 - 100000	5.594.275,14	94.620,93	54.820,93	0,06%	855.364,32	-855.364,32	125.396,41	-126.422,85
LWSA3	371.845,18	74.552,74	28.353,70	0,03%	178.348,00	-178.846,00	43.693,53	-43.693,53
MALL11	2.442.652,89	136.740,13	94.822,04	0,00%	-206.841,63	226.549,42	941.828,44	-940.236,36
MATD3	1.285.611,60	227.523,52	-53.304,03	-0,06%	-512.438,24	303.358,72	316.408,85	-410.527,27
MAXR11	1.238.158,60	126.535,91	52.842,02	0,06%	-10.693,67	11.129,22	6.356,60	-6.356,60
MGLJ3	1.534.271,22	456.295,64	-120.709,07	-0,14%	35.698,14	-26.732,33	15.269,51	-15.269,51
MOV027	1.177.241,90	1.357,50	804,65	0,00%	-206.841,63	226.549,42	941.828,44	-940.236,36
MOV137	8.201.294,77	91.214,44	59.510,75	0,07%	-1.990.091,65	2.170.083,40	1.483.283,85	-1.983.610,91
MRFQ3	94.427,55	-184,85	0,00	0,00%	-222.676,76	211.833,48	166.456,41	-221.360,59
MIRV6	2.495.059,20	452.199,25	58.750,63	0,07%	-389.435,64	423.263,90	310.734,69	-408.904,87
MTR119	6.106.942,93	42.837,51	20.725,18	0,02%	-1.321.913,23	1.436.741,00	1.054.768,11	-1.368.006,23
MULT3	6.432.446,30	359.784,64	-20.050,60	-0,02%	-211.328,16	232.833,45	173.401,18	-226.704,09
NEWL11	936.500,00	23.917,24	-12.744,43	-0,01%	-319.748,36	399.198,39	298.891,42	-385.811,99
NEWU11	558.364,32	202.058,08	-168.528,95	-0,20%	1.377.765,25	-1.723.184,21	1.336.513,29	-1.696.491,04
NNK13	986.030,00	53.696,71	25.900,81	0,00%	-16.927,09	23.135.374,63	18.761.951,02	-22.063.921,04
NTCO3	6.422.431,40	2.135.640,39	-1.540.291,54	-1,80%	-2.517.908,28	3.601.838,63	2.891.427,29	-3.383.206,59
NTEN11	10.345.307,78	62.621,62	20.519,57	0,02%	-18.754.885,82	36.010.928,73	25.555.710,05	-28.973.759,94
NTNB2020815 - 760199 - NEGOCIACAO	18.602.289,07	16.435,33	-12.951,49	-0,02%	-41.257,02	80.012,23	56.970,18	-62.716,70
NTNB20240815 - 760199 - NEGOCIACAO	12.907.651,24	90.199,39	-70.352,90	-0,06%	-55.466.634,69	126.963.491,01	90.400.378,72	-99.816.866,16
NTNB20250515 - 760199 - NEGOCIACAO	10.068.811,26	84.217,51	-62.036,70	-0,07%	-22.949.551,06	40.861.969,58	30.020.951,87	-32.854.618,68
NTNB20260815 - 760199 - NEGOCIACAO	12.358.799,24	83.121,10	-38.063,16	-0,04%	-11.700,50	10.149,94	16.829,76	-21.448,34
NTNB20270515 - 760199 - NEGOCIACAO	5.841.246,23	39.929,57	-10.341,67	-0,01%	-12.777,95	10.696,37	17.855,94	-24.328,30
NTNB20280515 - 760199 - NEGOCIACAO	7.826.527,84	54.745,25	16.863,69	0,02%	-408.009,11	176.006,19	226.915,21	-312.790,20
NTNB20280515 - 760199 - NEGOCIACAO	436.019,79	18.511,68	17.513,23	0,02%	0,00	0,00	0,00	0,00
NTSD35	1.878.209,20	3.295,23	0,00	0,00%	-1.708,73	1.383,33	2.513,61	-3.603,47
OMGE13	4.623.820,12	2.796,10	1.530,63	0,00%	-463.050,44	281.538,29	297.617,43	-386.899,54
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-2.626.405,85	2.482.400,00	644.905,53	-650.155,54
OVS410	1.572.681,34	293,16	-27,05	0,00%	21.132,90	-18.784,80	17.211,57	-17.352,46
PASN12	11.383.909,61	56.630,93	10.835,54	0,01%	-735.060,96	502.427,10	511.082,08	-651.810,84
PATC11	5.252.811,30	476.466,39	262.924,95	0,33%	3.023.110,66	-1.770.801,38	1.154.054,34	-1.163.500,90
PCAR3	11.417.405,00	27.924,16	-22.544,38	-0,02%	9.117.012,13	-4.902.616,41	3.345.455,63	-3.820.820,97
PEA111	11.445.823,32	61.574,64	69.357,54	0,08%	-280.237,95	109.648,57	127.588,74	-171.633,76
PETR3	7.872.130,56	1.350.849,22	925.372,06	1,08%	476.427,35	-486.458,23	279.377,00	-281.663,85
PETR4	22.745.743,20	3.958.643,50	2.770.927,48	3,24%	7.553.183,55	-7.553.183,55	1.845.494,51	-1.860.600,88
PETZ2	1.908.349,38	24.728,90	-13.070,37	-0,02%	-38,93	0,00	0,00	0,00
PRIO3	12.588.639,25	2.841.812,62	2.078.243,06	2,43%	2.367.033,16	-2.367.040,08	694.017,32	-699.698,23
PRLG14	2.329.895,55	6,03	-4,34	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
QAGR11	4.734.088,16	224.608,98	159.005,39	0,19%	-153.632,93	52.750,77	72.105,64	-95.713,42
QUAL3	0,00	0,00	0,00	0,00%	1.276.690,19	-1.276.690,19	937.279,91	-934.852,05
QUAT12	6.051.620,79	19.184,07	-1.963,58	0,00%	-1.323.214,43	776.909,58	921.932,67	-1.132.707,51
RADL3	6.393.450,96	552.276,23	475.449,08	0,26%	5.605.463,61	-4.110.736,55	1.826.135,48	-1.841.083,38
RAHD11	15.134.710,29	251.010,73	189.067,26	0,52%	66.445,15	-66.445,15	27.831,03	-28.058,84
RAL3	12.451.963,69	602.556,48	602.556,48	0,07%	0,00	0,00	0,00	0,00
RAI24	189.843,26	66.130,47	58.313,80	0,07%	2.692.733,92	-2.692.733,92	394.754,79	-397.986,07
RBCAPM2	672.520,54	8.891,28	1.641,08	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
RBR111	2.692.733,92	256.700,15	160.839,01	0,19%	-2.690,22	2.188,08	3.923,69	-5.592,36
RCRB11	4.625.913,93	454.553,51	230.387,12	0,27%	1.319.727,07	-1.318.727,07	644.905,53	-650.155,54
RDCD10	2.269.581,44	12,45	12,45	0,00%	-6.121,37	6.267,19	8.717,20	-11.293,00
RDR3	4.399.090,24	956.597,85	639.306,89	0,75%	-303.218,89	180.316,21	206.541,11	-257.754,72
RDRB9	1.122.596,98	1.646,67	1.191,05	0,00%	-2.917.285,41	-2.712.105,49	672.684,23	-678.190,52
RDFE13	3.092.346,98	52.111,25	37.512,27	0,04%	0,00	0,00	0,00	0,00
RECV3	4.588.569,12	1.100.309,10	246.774,20	0,29%	6.858.575,24	-5.403.869,34	3.046.950,94	-3.071.891,88
RENT1	17.160,00	6.690,83	-3.806,52	0,00%	-577,76	471,42	927,02	-1.350,45
RENT3	20.784.112,85	2.402.561,59	1.729.851,69	2,02%	-910.453,01	542.923,52	660.807,39	-795.227,81
RLOD11	1.530.804,00	38,10	-38,10	0,00%	20.441,70	-20.441,70	5.953,51	-5.953,51
RMSA12	7.602.637,32	204.102,81	161.696,25	0,19%	0,00	0,00	0,00	0,00
RNGO11	40.883,40	1.788,33	959,80	0,00%				



Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS									
CNPJ: 10679245000140									
Dados Gerais									
PL:	4.267.195.191,23	VAR / PL:	2,9050%	Limite Fundo:	0,00%	Dutação DC:	1,767,03		
VAR:	85.555.468,26	ETL / PL:	2,5143%	Status:	ENQUADRADO	Dutação DU:	1,214,47		
ETL:	107.290.008,81	VAR / CDI:	0,0225%	Benchmark:					
Cenários de STRESS									
Cenário Alta - 09999 (+):	1.838.346.792.730.510.000,00	Cenário Baixa - 10000 (+):	2.086.877.189.706.860.000,00	CENARIO BRADESCO 1 (+):	3.952.556.044.343.010.000,00	CENARIO BRADESCO 2 (+):	489.135.085.232.481.000,00		
Cenário Alta - 09999 (-):	(206.877.198,36)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(208.793.101,41)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(177.644.875,77)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(422.387.869,77)		
Cenário Alta - 09999:	1.838.346.792.523.830.000,00	Cenário Baixa - 10000:	2.086.877.189.497.060.000,00	CENARIO BRADESCO 1:	3.952.556.044.165.360.000,00	CENARIO BRADESCO 2:	489.135.084.810.094.000,00		
Parâmetros do Cálculo									
Modelo:	VaR paramétrico	Modelo Volatilidade:	EWMA						
Int. Confiança:	95	Lambda:	0,94						
Horizonte:	21								
Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2	
UTPS21	6.195.373,55	103.790,53	77.592,49	0,09%	-537.559,52	340.303,07	343.858,49	-476.325,31	
UTPS22	2.656.867,60	47.273,20	35.648,23	0,04%	-239.200,25	151.728,47	171.813,99	-212.962,51	
VALE3	43.507.114,80	3.826.546,96	-2.057.791,69	-2,41%	10.876.778,70	-10.876.778,70	6.378.143,03	-6.430.351,57	
VAMO22	1.089.009,54	140,93	-10,28	0,00%	-837,85	683,14	1.249,10	-1.790,65	
VAMO3	1.046.476,00	147.273,58	-13.110,98	-0,04%	368.965,60	-419.399,40	153.706,58	-154.964,75	
VAMO33	9.686.407,27	104.688,90	66.755,10	0,08%	-630.411,07	470.501,95	459.786,51	-585.672,50	
VAMO34	6.760.431,15	76.809,94	50.527,83	0,08%	-463.664,57	336.298,30	331.410,15	-421.296,31	
VBR3	7.017.793,20	583.175,35	-471,17	0,00%	1.754.448,30	-1.754.448,30	1.028.908,48	-1.037.229,84	
VECS11	1.297.346,65	1.402,20	911,77	0,00%	-6.694,90	4.827,39	7.970,53	-10.814,65	
VECS11	1.744.079,64	128,17	-45,71	0,00%	-735,60	595,42	1.144,09	-1.661,76	
VERDECS2	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
VERO12	3.236.876,56	23.027,58	9.394,56	0,01%	-177.154,26	115.224,47	115.417,75	-149.278,53	
VIB4	143.943,94	16.635,37	5.844,53	0,01%	64.729,73	-54.729,73	21.087,91	-21.850,12	
VIMT13	7.009.207,22	97.227,85	70.393,01	0,08%	-540.486,43	334.360,00	377.654,44	-471.243,36	
VIVT3	862.450,88	42.738,83	25.534,83	0,03%	129.365,54	-129.367,63	126.435,30	-127.404,24	
VIXL14	2.061.238,58	235,66	-50,23	0,00%	-1.400,13	1.138,67	2.135,98	-3.083,22	
VRDW2	4.904.816,03	56.760,25	38.769,68	0,05%	-341.987,20	216.658,43	236.076,99	-297.725,29	
VVED15	1.764.971,98	489,40	139,97	0,00%	-2.618,60	2.148,81	3.854,46	-5.155,20	
VVED16	1.053.016,33	354,19	121,90	0,00%	-1.839,70	1.513,70	2.560,91	-3.567,56	
WDOK23	3.405,18	0,00	0,00	0,00%	89.099,93	-89.308,66	110.112,17	-110.977,30	
WDOM23	2.414,23	68.399,83	56.889,16	0,07%	-138.842,71	141.244,00	-151.046,50	161.858,55	
WEGE3	8.581.538,40	423.038,42	-217.521,75	-2,25%	2.145.384,60	-2.145.405,47	1.258.053,53	-1.258.351,38	
WINM23	5.157,60	32.831,05	26.567,71	0,03%	80.476,75	-80.320,65	63.068,11	-63.320,51	
XPNM11	3.130.459,00	165.922,41	106.189,09	0,12%	1.565.229,50	-1.565.229,50	458.925,29	-462.881,84	
XPPR11	2.096.562,16	396.475,48	287.456,95	0,34%	1.048.291,08	-1.048.291,08	307.358,95	-308.674,84	
YDU3	720.582,56	187.373,58	171.792,71	0,20%	281.015,59	-180.193,14	105.633,01	-106.487,87	
Total Var:	4.434.707.933,42	139.888.808,46	85.555.468,26	100,03%	-14.271.844,67	110.915.187,41	307.560.859,85	-343.756.282,52	



Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: EMBRAERPREV RENDA FIXA									
CNPJ: 10679245000140									
Dados Gerais									
PL:	3.154.166.994,51	VAR / PL:	1,8401%	Limite Fundo:	0,00%	Dutação DC:	2.330,00		
VAR:	58.039.527,37	ETL / PL:	2,3075%	Status:	ENQUADRADO	Dutação DU:	1.601,84		
ETL:	72.763.906,84	VAR / CDI:	0,0207%	Benchmark:					
Cenários de STRESS									
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (+):	47.074.189.281.762.700,00	CENARIO BRADESCO 1 (+):	64.012.791.593.610.800,00	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-		
Cenário Alta - 09999 (-):	(167.166.801,40)	Cenário Baixa - 10000 (-):	-	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(255.047.658,75)		
Cenário Alta - 09999:	(167.166.801,40)	Cenário Baixa - 10000:	47.074.189.281.762.700,00	CENARIO BRADESCO 1:	64.012.791.593.610.800,00	CENARIO BRADESCO 2:	(255.047.658,75)		
Parâmetros do Cálculo									
Modelo:	VaR paramétrico	Modelo Volatilidade:	EWMA						
Int. Confiança:	95	Lambda:	0,94						
Horizonte:	21								
Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2	
CADXA	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
FIA RVA EMB II	2.584.152.212,39	55.948.197,13	55.824.745,65	96,18%	-135.993.246,10	239.630.873,24	174.192.636,17	-196.281.021,44	
FIA RF EMB V CREDITO PRIVADO	150.819.468,76	564.783,52	-39.670,58	-0,07%	-4.880.555,72	2.544.535,57	2.770.642,79	-3.631.661,54	
FIM EMB VI A CRED PRIV	248.035.867,58	1.314.527,87	-621.508,89	-1,07%	-4.831.643,71	5.188.924,29	34.990.819,39	-35.866.214,14	
FIM EMB VII A CRED PRIV	330.018.050,68	3.615.856,71	2.875.961,20	4,96%	-22.361.355,87	14.043.600,53	15.331.999,11	-19.268.761,64	
Total Var:	3.313.025.599,40	61.440.325,23	58.039.527,37	100,00%	-167.166.801,40	261.407.933,62	227.846.287,46	-255.047.658,75	



Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL									
CNPJ: 10679245000140									
Dados Gerais									
PL:	507.371.585,55	VAR / PL:	7,1860%	Limite Fundo:	0,00%	Dutação DC:	4,16		
VAR:	36.459.903,39	ETL / PL:	9,0116%	Status:	ENQUADRADO	Dutação DU:	1,11		
ETL:	45.722.189,78	VAR / CDI:	0,0808%	Benchmark:					
Cenários de STRESS									
Cenário Alta - 09999 (+):	57.644.817.546.566.300,00	Cenário Baixa - 10000 (+):	-	CENARIO BRADESCO 1 (+):	43.712.131.422.635.900,00	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-		
Cenário Alta - 09999 (-):	-	Cenário Baixa - 10000 (-):	(120.990.847,62)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(66.675.413,37)		
Cenário Alta - 09999:	57.644.817.546.566.300,00	Cenário Baixa - 10000:	(120.990.847,62)	CENARIO BRADESCO 1:	43.712.131.422.635.900,00	CENARIO BRADESCO 2:	(66.675.413,37)		
Parâmetros do Cálculo									
Modelo:	VaR paramétrico	Modelo Volatilidade:	EWMA						
Int. Confiança:	95	Lambda:	0,94						
Horizonte:	21								
Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2	
FIA RVA EMB III	7.000.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
FIA RVA EMB II	211.771.811,85	14.988.325,65	14.941.487,01	40,98%	56.963.668,81	-52.767.435,12	30.225.983,68	-30.272.037,90	
FIA RVA EMB III	87.503.203,32	7.236.936,75	7.166.368,36	96,18%	23.593.947,68	-23.006.456,51	11.195.137,21	-11.290.968,55	
FIA RVA EMB IV	82.133.389,25	5.885.430,83	5.705.145,85	15,65%	23.293.600,11	-21.173.233,35	11.015.659,16	-11.106.219,59	
FIC FIA EMB VIII ETF	23.454.447,95	1.727.734,90	1.729.111,35	4,72%	0,00	0,00	0,00	0,00	
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	95.504.263,50	6.956.796,39	6.927.789,82	19,00%	25.968.136,98	-24.043.722,64	13.894.516,21	-14.006.187,23	
Total Var:	507.367.115,88	36.795.224,53	36.459.903,39	100,01%	129.876.413,87	-120.990.847,63	66.131.226,25	-66.675.413,37	



Relatório de Risco de Mercado

Data: 28/04/2023

FUNDO:		FI RF EMB II				Limite Fundo:		0,00% Dutation DC:		2.607,66
CNPJ:		11005764000196				Status:		ENQUADRADO		1.792,78
Dados Gerais										
PL:	2.495.896.227,56	VAR / PL:	2,2415%	ETL / PL:	2,8109%	Limite Fundo:		0,00% Dutation DC:		2.607,66
VAR:	55.945.219,69	ETL / PL:	0,0252%	VAR / CDI:	0,0252%	Status:	ENQUADRADO	Dutation DU:		1.792,78
ETL:	70.157.562,52					Benchmark:				
Cenários de STRESS										
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (+):	279.573.768.640.956.000,00	CENARIO BRADESCO 1 (+):	254.869.740.607.196.000,00	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-			
Cenário Alta - 09999 (-):	(135.093.324,72)	Cenário Baixa - 10000 (-):	-	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(196.281.135,67)			
Cenário Alta - 09999:	(135.093.324,72)	Cenário Baixa - 10000:	279.573.768.640.956.000,00	CENARIO BRADESCO 1:	254.869.740.607.196.000,00	CENARIO BRADESCO 2:	(196.281.135,67)			
Parâmetros do Cálculo										
Modelo:	VaR paramétrico	Modelo Volatilidade:	Lambda:	EWMA	0,94					
Int. Confiança:	95									
Horizonte:	21									
Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2		
CSMG3	13.224.872,12	54.297,57	-37.863,10	-0,07%	0,00	0,00	0,00	0,00		
ELET42	13.915.769,39	97.752,30	42.747,91	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00		
ENTV12	13.190.728,23	105.548,50	62.679,26	0,11%	-15.999,36	16.315,58	74.678,69	-113.658,80		
GASP17	52.360.873,40	326.105,88	74.542,45	0,13%	0,00	0,00	0,00	0,00		
IGSN15	2.578.516,03	27.222,10	20.318,68	0,04%	-295.298,26	85.665,18	128.007,35	-171.209,94		
NEOE16	7.069.334,12	51.713,55	23.883,99	0,04%	0,00	0,00	0,00	0,00		
NTNB20230515 - 760199_VENCIMENTO	44.892.589,75	39.477,57	-35.575,90	-0,08%	-762.163,91	482.181,06	487.195,80	-631.756,53		
NTNB20240815 - 760199_VENCIMENTO	121.205.085,83	867.058,02	-707.624,64	-1,28%	-761.082,18	516.869,74	514.131,13	-661.647,25		
NTNB20260815 - 760199_VENCIMENTO	41.951.117,59	282.149,03	-120.871,91	-0,22%	-1.697.072,46	2.062.890,87	1.556.939,74	-2.031.360,90		
NTNB20300815 - 760199_VENCIMENTO	25.905.098,19	285.888,18	242.580,37	0,43%	-171.545,05	107.840,44	117.182,17	-148.209,78		
NTNB20350515 - 760199_VENCIMENTO	233.589.064,18	5.085.288,39	5.017.630,61	8,97%	-395.745,88	254.076,79	265.878,95	-331.394,12		
NTNB20400815 - 760199_VENCIMENTO	28.557.430,33	930.085,24	929.513,75	1,86%	-25.686,14	26.732,33	15.269,51	-20.711,64		
NTNB20450515 - 760199_VENCIMENTO	221.409.952,67	8.451.004,71	8.433.623,02	15,07%	-1.990.091,65	2.170.083,40	1.482.283,85	-1.953.510,91		
NTNB20500815 - 760199_VENCIMENTO	691.876.205,30	29.374.335,66	29.318.285,86	52,41%	-1.321.913,23	1.436.741,00	1.054.768,11	-1.388.000,23		
NTNB20550515 - 760199_VENCIMENTO	221.055.398,78	9.712.883,85	9.701.983,25	17,34%	-1.377.765,25	1.723.184,21	1.336.513,29	-1.696.491,04		
PETR45	18.411.626,13	81.789,02	-65.478,57	-0,12%	-16.076.277,09	23.135.374,03	18.131.751,52	-22.065.757,04		
SBSPC2	9.322.108,81	39.743,04	-25.139,66	-0,04%	-2.517.905,28	3.691.838,63	2.891.487,29	-3.383.206,59		
SBTOPND	249.135.563,16	3.174.908,95	3.069.904,35	6,49%	-18.754.658,82	36.010.928,73	25.558.710,05	-28.973.769,94		
CAIXA	5.000,00	0,00	0,00	0,00%	-65.466.634,58	126.963.401,01	90.400.278,72	-89.518.866,16		
COMPROMISSADA_PRE	574.816.318,00	0,00	0,00	0,00%	-22.949.551,06	40.861.969,58	30.520.951,87	-32.854.618,68		
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-89.945,26	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00		
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-280.237,95	109.648,57	127.858,74	-171.633,76		
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-233.685,95	65.571,35	101.042,10	-135.242,29		
Total Var:	2.584.153.716,26	58.997.251,57	55.945.219,69	100,00%	-135.093.324,72	239.631.012,69	174.752.927,88	-196.281.135,67		

Relatório de Risco de Mercado

Data: 28/04/2023

FUNDO:		FI RF EMB V CREDITO PRIVADO				Limite Fundo:		0,00% Dutation DC:		829,16
CNPJ:		20726178000121				Status:		ENQUADRADO		569,87
Dados Gerais										
PL:	155.593.238,37	VAR / PL:	0,3630%	ETL / PL:	0,4552%	Limite Fundo:		0,00% Dutation DC:		829,16
VAR:	564.753,52	ETL / PL:	0,0041%	VAR / CDI:	0,0041%	Status:	ENQUADRADO	Dutation DU:		569,87
ETL:	708.223,70					Benchmark:				
Cenários de STRESS										
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (+):	175.758.896.778.929.000,00	CENARIO BRADESCO 1 (+):	172.426.070.641.517.000,00	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-			
Cenário Alta - 09999 (-):	(4.880.555,72)	Cenário Baixa - 10000 (-):	-	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(3.631.661,53)			
Cenário Alta - 09999:	(4.880.555,72)	Cenário Baixa - 10000:	175.758.896.778.929.000,00	CENARIO BRADESCO 1:	172.426.070.641.517.000,00	CENARIO BRADESCO 2:	(3.631.661,53)			
Parâmetros do Cálculo										
Modelo:	VaR paramétrico	Modelo Volatilidade:	Lambda:	EWMA	0,94					
Int. Confiança:	95									
Horizonte:	21									
Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2		
TFHP164854	8.396.210,09	34.897,52	34.033,32	6,03%	-261.060,40	127.639,42	145.816,05	-192.695,21		
AEQP23	14.873.314,48	67.190,79	56.154,65	9,94%	-434.956,76	131.940,63	190.340,23	-254.072,79		
CCRDD1	6.250.572,27	27.786,85	16.522,42	2,93%	0,00	0,00	0,00	0,00		
CMDT33	1.341.183,76	5.714,35	3.838,12	0,68%	-120.322,20	44.610,22	55.844,20	-74.862,52		
ENJG21	1.903.790,08	7.946,06	7.674,22	1,36%	-33.660,69	9.439,73	14.552,47	-19.477,88		
ENM21	1.186.299,46	5.039,95	4.897,78	0,87%	-252,99	257,98	1.180,80	-1.797,15		
ENTV12	17.340.311,49	138.732,30	92.832,42	15,44%	0,00	0,00	0,00	0,00		
ERDV17_VENCIMENTO	13.052.544,50	59.168,72	49.250,30	8,54%	0,00	0,00	0,00	0,00		
ERDV36	4.166.377,66	18.908,52	11.051,92	1,96%	-63.467,05	26.722,00	31.886,20	-42.200,86		
GASP17	10.833.284,15	67.470,18	44.118,20	7,81%	-40.842,49	17.372,89	20.628,98	-27.287,81		
GEP424	7.750.585,81	35.392,69	13.788,90	2,44%	-1.000.505,95	679.468,34	675.868,22	-869.790,44		
GRRB24_VENCIMENTO	15.445.186,32	111.293,44	86.554,60	15,33%	-366.071,12	105.992,18	158.804,07	-212.099,49		
LFSN1600DM	8.022.496,12	38.705,00	32.734,25	5,89%	-81.489,96	30.767,13	38.105,70	-51.084,71		
LFSN1600DCS	2.940.210,49	14.331,75	12.829,51	2,27%	-351.118,44	428.742,94	322.125,46	-420.281,57		
OMGE31	12.878.652,82	62.406,16	57.499,05	10,18%	-36.851,97	11.409,19	16.205,34	-21.937,13		
SBSPC2	7.144.096,80	30.457,50	20.414,27	3,61%	-863.306,96	547.328,60	554.518,10	-718.607,88		
TAE33	8.239.378,49	38.125,94	21.559,58	3,82%	-270.035,25	66.594,95	110.914,45	-148.100,87		
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	-113.868,82	31.944,48	50.514,72	-67.189,06		
COMPROMISSADA_PRE	9.688.857,57	0,00	0,00	0,00%	-488.009,11	178.009,19	236.015,21	-312.750,20		
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-34.877,60	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00		
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-179.072,37	50.251,45	77.434,69	-103.644,44		
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-145.761,31	60.644,26	69.887,90	-93.741,55		
Total Var:	150.819.468,76	763.587,72	564.753,52	100,01%	-4.880.555,72	2.544.535,57	2.770.642,79	-3.631.661,53		



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO
E CONTROLE DE RISCO - ABRIL DE 2023



Data: 28/04/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO CNPJ: 4183766000109

Dados Gerais		Limite Fundo:		ENQUADRADO		0,00% Duração DC:		711,85	
PL:	235.908.790,66	VAR / PL:	0,5572%	Status:	ENQUADRADO	Duração DC:	0,00	711,85	488,58
VAR:	1.314.527,87	ETL / PL:	0,6888%	Benchmark:		Duração DU:	0,00		
ETL:	1.648.470,98	VAR / CDI:	0,0063%						

Cenários de STRESS										
Cenário Alta - 09999 (+):	266.396.897.235.754.000,00	Cenário Baixa - 10000 (-):	839.812.035.194.682.000,00	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	1.003.118.000.220.230.000,00	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	168.496.539.327.300.000,00	0,00	0,00	0,00
Cenário Alta - 09999 (-):	(6.682.250,31)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(8.379.254,27)	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	(25.322.992,10)	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(40.117.085,90)	0,00	0,00	0,00
Cenário Alta - 09999:	266.396.897.229.072.000,00	Cenário Baixa - 10000:	839.812.035.186.303.000,00	CENÁRIO BRADESCO 1:	1.003.118.000.194.900.000,00	CENÁRIO BRADESCO 2:	168.496.539.287.183.000,00			

Parâmetros de Cálculo			
Modelo:	VaR paramétrico	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95	Lambda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
AEPA1	1.810.321,34	1.860,02	-81,42	-0,01%	-8.119,15	6.826,65	11.340,47	-15.309,49
AMBPI3	2.655.859,59	957,86	280,07	0,02%	-5.216,45	4.288,41	7.434,85	-10.418,76
APRE28	1.363.190,80	115,15	44,13	0,00%	-637,31	521,16	913,68	-1.290,27
BCR15	3.205.751,92	247,33	190,09	0,01%	-1.449,47	1.171,03	2.221,35	-3.221,30
BKR18	1.039.468,11	26,84	22,88	0,00%	-161,48	132,55	282,63	-417,08
BRELETRO	3.252.049,33	40.049,03	9.578,63	0,73%	0,00	0,00	0,00	0,00
BRKPA0	3.297.684,41	1.553,71	415,99	0,03%	-5.163,50	6.702,38	11.374,78	-15.900,07
CAIXA	1.776.065,92	94,09	77,49	0,01%	-551,70	440,44	905,35	-1.326,17
CART13	939.850,74	11.358,06	-186,56	-0,01%	-57.316,15	43.045,73	46.790,72	-58.937,00
CBAN22	4.746.653,11	35.016,99	-18.931,28	-1,44%	-57.589,09	53.966,46	82.594,83	-83.552,08
CCPRA3	41.211,91	0,22	0,18	0,00%	-1,69	1,56	4,08	-6,11
CEA211	1.776.065,92	94,09	77,49	0,01%	-551,70	440,44	905,35	-1.326,17
CEAB22	570.591,54	217,52	50,65	0,00%	-1.147,26	945,28	1.615,61	-2.249,16
CELG12	3.302.296,74	423,12	273,03	0,02%	-2.427,45	1.962,51	3.573,14	-5.133,05
COMPROMISSADA_PRE	93.948.878,82	0,00	0,00	0,00%	-2.615,08	2.666,54	12.205,60	-18.576,57
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-79.321,65	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CSAN2_3	1.132.900,71	1.732,64	-398,16	-0,03%	-5.444,90	5.544,96	9.177,00	-11.891,73
CSMGAT	2.125.780,45	921,81	5,41	0,00%	-4.209,95	3.524,52	5.895,86	-8.006,28
DAPK23	314,20	64.893,67	44.882,06	3,41%	488.276,02	-114.355,75	8.162.448,98	-8.229.263,48
DAPK25	-63.655,95	397.348,29	356.575,50	27,13%	-543.498,15	720.842,78	6.197.770,45	-6.233.464,94
DAPK27	-14.523,11	31.606,40	27.496,97	2,09%	-146.067,07	157.676,89	762.862,90	-763.322,98
DAPK35	1.717,27	16.125,68	6.865,63	0,52%	54.415,34	-55.133,58	-136.065,43	130.209,96
DAPQ24	-106.138,28	648.591,49	579.271,72	44,07%	-724.097,27	1.208.606,78	13.226.724,09	-13.318.353,56
DAPQ26	-114.396,28	297.213,41	286.736,31	21,81%	-1.133.192,34	1.279.966,36	7.216.003,44	-7.236.791,44
DAPQ28	1.819,37	116.994,62	-43.010,45	-3,72%	562.125,97	-673.196,83	-2.744.160,98	2.332.090,15
DAPQ30	9.852,83	68.400,36	8.334,46	0,63%	312.159,82	-315.540,49	-1.029.306,10	1.025.019,72
DASAA2	2.757.340,72	37,06	31,46	0,00%	-223,66	183,03	396,18	-584,24
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DIH26	-2.821,95	79.285,57	9.296,26	0,74%	-36.070,88	200.005,70	482.553,34	-673.353,62
DIH25	-4.958,19	14.049,62	5.742,28	0,44%	-71.296,28	57.410,24	95.379,18	-134.298,98
ELEK27	578.323,91	0,36	-0,16	0,00%	19,81	-20,10	-90,09	137,14
ERDVA0	2.108.525,12	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
GSSP11	2.542.605,08	61.341,09	-14.457,40	-1,10%	-277.119,29	169.626,66	202.511,89	-242.101,44
GGSH12	2.386.764,65	316,94	227,60	0,02%	-1.881,69	1.523,78	2.838,96	-4.039,08
GUAR15	2.797.660,86	317,49	332,49	0,02%	-4.162,98	3.394,98	5.934,57	-8.262,62
HARG11	3.403.615,88	50.509,96	-5.439,38	-0,41%	-277.738,90	165.958,02	192.250,55	-238.932,11
HZT14	2.400.875,43	27.974,84	-269,78	-0,22%	-165.151,22	166.461,82	115.753,07	-145.764,06
IDIF24P380200	-159.357,04	212.352,10	-181.991,89	-13,84%	167.356,48	-5.211.460,68	-16.297.978,02	167.357,04
IDIF24P380300	195.107,16	241.358,76	206.851,44	15,74%	-195.106,37	5.421.510,81	16.521.665,51	-195.107,16
IDIF24P381200	-159.882,65	167.810,23	-143.818,22	-10,84%	159.881,79	-1.996.825,69	-5.081.524,91	159.882,65
IDIF24P381900	177.722,11	163.356,21	157.141,57	11,89%	-177.721,21	2.047.388,19	5.133.122,07	-177.722,11
ICTA37	2.107.376,36	959,83	-735,50	-0,06%	4.924,13	-3.871,97	-1.030,29	10.326,95
INSSSN1	1.792.069,21	34.362,88	-7.365,16	-0,56%	0,00	0,00	0,00	0,00
JSM1B5	3.102.478,61	34.179,13	1.779,13	0,14%	-204.556,18	151.561,90	149.014,72	-189.591,91
LCAAM9	1.980.167,81	253,57	181,46	0,01%	-1.500,21	1.215,54	2.295,80	-3.319,77
LCAAMD1	4.732.231,84	55.165,09	1.919,85	0,12%	-323.150,07	242.004,66	227.224,16	-301.534,57
LF0021003Q1	2.190.151,51	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002100E1F	1.196.269,24	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002200O9	2.225.079,90	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFSC190054B	830.905,04	0,00	0,00	0,00%	-2.494,41	0,00	-4.754,91	7.299,44
LFSC190055S	1.257.278,64	0,00	0,00	0,00%	4.906,10	-3.783,84	-7.225,21	11.076,75
LFSC190051L	831.754,84	0,00	0,00	0,00%	3.316,12	-2.561,35	-4.856,14	7.445,66
LFSC22002IX	4.991.054,10	2.642,24	563,90	0,04%	-13.492,07	11.124,51	18.940,51	-26.396,18
LFSA21002ZN	3.616.501,42	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20240301 - 210100	10.279.844,69	790,12	300,37	0,02%	-22.799,04	28.630,24	28.630,24	-106,80
LFT20240901 - 210100	1.103.959,17	294,47	217,12	0,02%	-4.128,66	5.952,47	76,54	-116,51
LIGHB4	2.198.975,33	17,56	15,04	0,00%	-126,13	111,42	271,14	-404,97
LIGHD3	867.782,99	542,82	17,10	0,00%	-2.495,19	2.062,40	3.464,05	-4.727,41
LIREN1	1.389.683,65	39,22	32,87	0,00%	-233,85	193,50	407,68	-599,69
MOVIZ7	1.177.241,90	1.357,50	-64,55	0,00%	-5.907,21	4.968,23	8.247,43	-11.124,95
MTR1J9	3.460.192,32	24.267,35	7.078,08	0,54%	-184.006,30	118.792,34	121.617,60	-156.176,76
NTEN11	3.524.541,23	21.334,55	10.167,97	0,77%	-174.552,50	103.351,23	107.797,28	-139.665,88
NTNB20230515 - 760199_NEGOCIACAO	88.522,11	78,21	47,81	0,00%	50,89	32,96	30,25	-41,83
NTNB20240515 - 760199_NEGOCIACAO	102.988,48	736,74	658,31	0,05%	-1.690,99	1.843,93	1.260,35	-1.685,48
NTNB20250515 - 760199_NEGOCIACAO	591.041,33	4.943,59	4.596,17	0,35%	-13.071,17	12.440,54	9.771,03	-12.993,91
NTNB20260515 - 760199_NEGOCIACAO	1.514.435,34	10.185,58	9.766,44	0,74%	-47.721,07	51.866,35	38.077,13	-50.106,81
NTNB20270515 - 760199_NEGOCIACAO	760.266,35	4.755,98	4.272,96	0,53%	-25.334,66	27.912,78	20.757,86	-27.177,98
NTNB20280515 - 760199_NEGOCIACAO	4.762.380,27	34.185,64	15.644,06	1,19%	-199.656,65	249.279,17	196.517,66	-240.920,04
NTNB20290515 - 760199_NEGOCIACAO	411.104,37	17.483,87	-9.934,78	-0,76%	-38.889,47	75.440,10	53.714,74	-59.132,89
NTSD35	1.878.209,20	3.295,23	-885,29	-0,07%	-11.700,50	10.149,94	16.829,76	-21.448,34
OWSE13	3.650.536,31	2.207,54	20,35	0,00%	-10.668,27	8.444,85	14.121,06	-19.207,35
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
OVSIA10	1.572.681,34	293,16	179,42	0,01%	-1.708,73	1.383,33	-1.513,61	-3.603,47
PASN12	4.007.860,26	19.937,69	11.689,38	0,89%	-173.585,12	99.119,38	104.780,27	-136.213,25
RAHD11	3.214.418,47	53.311,46	-7.719,41	-0,89%	-281.033,78	165.005,64	196.806,68	-240.572,56
RDCAPMZ	672.520,54	8.891,29	-1.421,32	-0,11%	0,00	0,00	0,00	0,00
RDCO10	2.269.581,14	459,78	240,70	0,02%	-2.690,22	2.168,08	3.923,69	-5.592,36
RDR0B9	1.122.596,98	1.646,67	-369,90	-0,03%	-6.121,37	5.267,19	8.717,20	-11.293,00
RLOG11	1.530.456,80	96,33	77,84	0,01%	-577,76	471,42	927,02	-1.350,45
RSAN24	799.321,42	72,50	51,09	0,00%	-454,02	354,35	671,37	-970,60
RSAN44	834.543,75	5.647,40	2.086,38	0,16%	-44.392,28	27.362,79	28.262,10	-36.503,59
SBFPC11	1.728.376,85	25,46	21,80	0,00%	-163,07	139,56	338,61	-503,95
SNOQ18	2.196.585,20	161,41	124,35	0,01%	-861,03	781,98	1.527,07	-2.212,68
UJEL11	855.021,01	193,89	88,05	0,01%	-1.109,00	904,65	1.589,65	-2.251,91
UNEG11	5.296.409,82	109.154,89	-22.314,07	-1,70%	-526.885,29	306.907,73	373.114,44	-455.488,47
VAMO33	1.454.933,88	15.724,66	1.094,56	0,08%	-94.690,05	70.671,12	69.061,62	-87.970,16
VCCS11	1.297.345,65	1.402,20	-174,75	-0,01%	-5.694,80	4.827,39	7.970,53	-10.614,65
VESE11	1.744.079,64	126,17	98,79	0,01%	-735,60	595,42	1.144,09	-1.661,76
VERECS2	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
VXL14	2.061.238,58	235,66	163,15	0,01%	-1.400,13	1.138,67	2.135,98	-3.083,22
VVEO15	1.784.971,98	489,40	144,51	0,01%	-2.618,60	2.148,81	3.684	



Data: 28/04/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV
CNPJ: 41687175000104

Dados Gerais				Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	2.057,40
PL:	266.773.737,92	VAR / PL:	1,3554%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1.414,75
VAR:	3.615.856,71	ETL / PL:	1,6997%	Benchmark:			
ETL:	4.534.430,19	VAR / CDI:	0,0152%				

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (+):	541.230.794.411.286.000,00	CENARIO BRADESCO 1 (+):	759.504.896.725.792.000,00	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
Cenário Alta - 09999 (-):	(22.361.355,86)	Cenário Baixa - 10000 (-):	-	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(19.268.761,63)
Cenário Alta - 09999:	(22.361.355,86)	Cenário Baixa - 10000:	541.230.794.411.286.000,00	CENARIO BRADESCO 1:	759.504.896.725.792.000,00	CENARIO BRADESCO 2:	(19.268.761,63)

Parâmetros do Cálculo			
Modelo:	Var paramétrico	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95	Lambda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MMI	VAR Tot	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
ANET11	12.428.269,59	100.522,36	178.183,00	4,93%	-372.846,39	563.535,40	674.318,61	-335.129,56
ANET11	2.325.755,38	10.564,46	6.115,55	0,17%	-93.577,81	47.997,40	52.712,94	-69.056,08
BRKP28	5.126.809,21	88.447,90	86.959,57	2,40%	-448.864,13	287.324,90	322.704,26	-402.707,97
BRST11	6.575.088,80	34.314,84	20.108,30	0,56%	-293.033,69	139.454,52	158.027,63	-207.738,84
BTOW15	8.086.347,16	95.103,51	94.930,27	2,63%	-538.849,65	417.443,89	403.227,17	-511.842,12
CAEC21	8.526.242,27	55.749,17	45.851,33	1,27%	-452.871,82	270.369,31	278.335,88	-362.234,62
CAIXA	999,97	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CART13	5.529.251,73	66.820,77	66.744,96	1,85%	-396.028,80	253.243,08	275.275,25	-346.738,53
CBAN32	9.539.940,71	119.704,50	119.454,91	3,30%	-698.603,00	462.015,91	493.613,26	-622.113,02
CBAN72	2.323.704,49	31.214,18	31.099,21	0,86%	-176.770,87	116.839,15	125.501,60	-158.019,41
CJEN13	4.595.983,19	54.397,37	54.350,07	1,50%	-326.603,01	203.374,08	224.494,52	-282.425,49
CNRD11	9.861.392,36	143.576,51	142.521,71	3,94%	-791.150,22	499.796,38	552.820,25	-690.869,20
COMPROMISSADA_PRE	5.930.918,27	0,00	0,00	0,00%	-165,09	168,34	770,53	-1.172,72
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-129.529,62	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CONX12	9.709.789,61	62.676,70	53.344,31	1,48%	-508.392,58	306.423,45	315.360,69	-409.683,18
CREDZM24	1.266.011,94	89.230,76	-13.393,79	-0,37%	0,00	0,00	0,00	0,00
CRMG15	8.306.407,01	53.126,22	49.232,45	1,36%	-412.344,70	263.806,19	268.874,54	-346.677,84
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ERDV17	3.776.536,21	17.119,48	-1.440,16	-0,04%	-105.916,58	30.667,07	45.947,31	-61.367,45
ERDV38	5.539.924,78	26.953,83	9.101,59	0,25%	-216.430,69	72.559,24	100.547,92	-133.439,85
GBSP11	7.806.169,23	188.321,62	180.570,40	4,99%	-850.776,45	520.459,22	621.726,28	-748.269,09
GRRB24	8.137.651,10	58.637,50	51.388,41	1,42%	-454.853,10	288.372,64	292.160,60	-378.615,06
HRRS11	6.447.720,97	95.864,74	94.731,93	2,62%	-526.141,32	314.386,53	364.194,42	-452.626,75
HBSA21	4.421.099,83	52.853,17	52.736,55	1,46%	-304.530,99	229.489,62	224.536,32	-285.141,75
HVRD15	10.117.638,88	157.067,89	156.079,29	4,32%	-855.375,32	562.193,13	609.124,54	-763.750,17
IPIL11	8.897.402,58	83.728,23	83.467,94	2,31%	-557.533,43	341.684,62	373.335,10	-472.684,09
IRBR12	11.240.249,67	57.820,58	29.496,58	0,82%	-473.114,13	210.898,34	244.723,81	-323.048,47
ITPO14	13.091.282,39	241.018,46	237.004,71	6,55%	-1.222.793,62	773.939,23	874.582,27	-1.065.617,18
LAMEA6	9.409.796,16	93.030,45	92.820,08	2,57%	-536.974,57	427.173,55	404.904,29	-514.886,93
LCAMD1	7.235.081,07	83.285,49	83.082,68	2,30%	-487.890,92	365.366,54	358.300,14	-455.468,27
LIGHT7	5.841.555,48	29.715,04	14.349,94	0,40%	-244.137,11	103.285,35	123.501,85	-163.241,69
LORTA7	5.978.362,04	71.336,72	71.163,35	1,97%	-406.518,31	315.201,63	303.972,41	-386.265,70
MOV37	8.201.294,77	91.214,44	90.972,28	2,52%	-543.365,28	403.533,26	396.527,30	-504.406,61
MTRJ19	2.647.850,62	18.570,16	17.676,08	0,49%	-140.807,55	90.903,73	92.953,98	-119.511,49
NTEN11	6.820.766,56	41.287,07	35.125,46	0,97%	-337.855,74	200.007,49	208.611,57	-270.671,39
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PASN12	7.376.049,35	36.693,24	28.186,81	0,78%	-319.465,33	182.418,90	192.837,17	-250.686,29
PEJA11	11.445.823,32	113.014,27	112.134,74	3,10%	-735.060,96	502.427,10	511.082,08	-651.810,84
QUAT12	4.051.620,79	19.184,07	6.806,50	0,19%	-153.632,93	52.750,77	72.105,64	-95.713,42
RAHD11	11.920.291,62	197.699,27	194.374,55	5,38%	-1.042.180,65	611.903,94	726.125,99	-892.134,96
RDVE11	3.882.342,96	52.111,25	51.907,84	1,44%	-303.218,89	180.316,21	206.541,11	-257.754,72
RMSA12	7.602.637,32	204.102,81	195.363,00	5,40%	-910.453,01	542.923,52	660.807,39	-795.227,61
RSAN44	5.361.943,57	36.284,54	33.149,73	0,92%	-285.220,38	175.805,90	181.584,02	-234.535,56
TCIH11	12.984.659,46	239.867,20	234.690,60	6,49%	-1.224.012,62	715.094,37	857.339,04	-1.046.174,49
UNEG11	1.873.853,08	38.618,65	37.412,48	1,03%	-186.410,35	108.582,99	132.006,71	-161.150,39
UTPS21	6.195.373,55	103.792,53	102.261,39	2,83%	-337.569,62	340.303,07	383.935,49	-478.823,31
UTPS22	2.686.687,60	47.273,20	46.425,36	1,28%	-238.200,25	151.728,47	171.613,98	-212.962,51
VAMO33	8.231.473,39	88.964,24	88.557,97	2,45%	-535.721,02	399.830,83	390.724,89	-497.702,34
VAMO34	6.760.431,15	76.809,94	76.637,16	2,12%	-453.664,57	336.298,30	331.410,15	-421.296,31
VERDECS2	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
VERD12	3.236.876,56	23.027,58	20.874,44	0,58%	-177.154,26	115.224,47	115.417,75	-149.276,53
VIMI13	7.009.207,22	97.227,85	96.526,55	2,67%	-540.496,43	334.360,00	377.654,44	-471.243,36
VRDN12	4.804.615,03	56.750,25	56.708,61	1,57%	-341.787,20	216.668,43	236.076,09	-297.725,29
Total Var:	330.018.050,62	3.924.641,03	3.618.856,71	100,03%	-22.361.355,86	14.043.600,52	15.331.999,11	-19.268.761,63



Relatório de Risco de Mercado

Data: 28/04/2023

FUNDO: FIM EMB I A
CNPJ: 2072594600122

Dados Gerais			
PL:	392.174.321,11	VAR / PL:	0,3429%
VAR:	1.341.058,75	ETL / PL:	0,4288%
ETL:	1.681.741,77	VAR / CDI:	0,0038%

Limite Fundo: 0,00% Dotation DC: 63,69
Status: ENQUADRADO Dotation DU: 42,49
Benchmark:

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 9999 (+):	113.449.548.389.456.000,00	Cenário Baixa - 10000 (-):	417.228.518.603.807.000,00	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	450.885.669.774.881.000,00
Cenário Alta - 9999 (-):	(33.814.571,55)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(45.775.734,92)	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	(149.593.805,28)
Cenário Alta - 9999:	113.449.548.355.642.000,00	Cenário Baixa - 10000:	417.228.518.558.031.000,00	CENÁRIO BRADESCO 1:	450.885.669.593.288.000,00
				CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	186.117.706.231.773.000,00
				CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(83.009.156,28)
				CENÁRIO BRADESCO 2:	186.117.706.148.764.000,00

Parâmetros do Cálculo			
Modelo:	VAR paramétrico	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 9999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
ANH10	632.617,08	42,78	22,20	0,00%	-253,70	206,02	372,99	-534,28
BCBF14	262.395,87	18,76	3,84	0,00%	-109,90	89,26	172,78	-251,24
CADXA	8.999,82	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CSAN22	2.281.822,02	16.533,45	15.367,37	1,15%	-27.884,35	25.942,88	39.705,19	-44.576,43
CGBP13	2.138.176,66	1.185,75	1.144,01	0,00%	-5.461,60	4.573,36	7.855,74	-10.402,04
COMPROMISSADA_PRE	315.696.705,29	0,00	0,00	0,00%	-8.787,39	8.960,73	41.014,52	-62.422,91
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-390.398,23	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPMK23C100000	3.642,45	1.339,88	819,38	0,00%	-0,31	0,32	1,42	-2,16
CPMM23C099500	-53,00	28,90	4,74	0,00%	0,07	-0,07	-0,26	0,38
CPMM23C099750	-79,49	75,98	22,48	0,00%	0,10	-0,10	-0,38	0,58
CPMM23C100000	23.107,00	17.895,83	8.958,90	0,67%	-29,27	29,70	111,28	-168,37
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DHF26	-1.952,65	8.768,29	6.265,09	0,47%	-31.079,22	25.516,60	41.193,53	-56.971,77
DHF27	-255.806,71	1.183.356,95	1.180.391,72	88,02%	-4.389.697,75	3.710.805,56	5.918.855,54	-7.897.516,63
DHF31	-15.387,48	115.234,66	108.266,67	8,07%	-305.694,75	279.827,55	472.666,32	-541.302,04
DHN23	0,97	10,58	4,25	0,00%	307,29	-311,78	-1.120,54	1.693,47
DIV123	-1.651,34	9.801,08	-3.990,45	-0,28%	-72.049,85	64.957,86	163.479,34	-244.518,65
DOLK23	-3.405,18	0,00	0,00	0,00%	-89.099,93	89.308,66	-110.112,17	110.977,30
ELET13	2.034.662,41	381,95	213,15	0,02%	-2.176,34	1.761,46	3.128,13	-4.468,52
EQTL13	1.433.729,94	33,01	-6,48	0,00%	-198,76	164,10	355,80	-525,68
ETEN13	1.210.079,43	5,54	-2,31	0,00%	-48,69	45,71	122,69	-184,04
GRRB14	1.089.228,63	75,31	41,03	0,00%	-438,67	356,01	644,12	-922,29
IDIF24C382500	-589.246,75	800.623,91	-244.755,72	-18,25%	-16.602.435,81	589.343,42	589.346,75	-52.716.939,06
IDIF24C382600	643.203,20	873.007,06	266.883,70	19,90%	19.564.211,89	-643.198,23	-643.203,20	63.185.417,30
IDIF24C382700	-99.146,99	133.847,54	-40.916,03	-3,95%	-3.220.891,21	99.146,99	99.146,99	-10.591.009,99
IDIF24P381900	798.178,70	731.975,40	223.738,87	16,88%	-798.174,96	6.005.346,34	14.192.913,93	-798.178,70
IDIF24P381900	-886.288,70	786.731,30	240.508,66	17,93%	886.284,22	-6.099.036,11	-14.288.778,10	886.288,70
IDIF24P382400	-1.453.677,94	1.048.721,24	320.600,62	23,91%	1.453.657,52	-6.440.762,12	-14.641.259,69	1.453.677,94
IDIF24P382500	1.595.476,30	1.090.197,95	-333.289,30	-24,85%	-1.595.440,26	6.480.792,97	14.883.435,50	-1.595.476,30
IDIN23C259100	-8.093,52	2.556,95	-1.029,32	-0,08%	293.249,46	8.093,52	8.093,52	-1.906.049,02
IDIN23C359200	7.918,56	1.725,58	694,00	0,05%	230.776,11	-7.918,40	-7.918,56	1.843.403,54
IDIN23P358900	290.728,55	93.616,93	-37.650,96	-2,81%	-290.728,55	13.256.678,44	56.890.428,18	-290.728,55
IDIN23P359000	-489.759,99	248.439,02	99.917,48	7,45%	489.759,99	-16.809.346,24	-62.590.750,70	489.759,99
IDIN23P359100	-2.743.992,16	416.157,98	167.370,89	12,48%	2.743.988,31	-15.140.750,26	-53.312.287,09	2.743.992,16
IDIN23P359200	5.731.145,85	475.826,45	-191.368,41	-14,27%	-5.703.188,93	15.958.311,32	58.277.695,87	-5.731.145,85
IDIN23P359300	146.475,84	8.394,18	-3.375,98	-0,25%	-139.586,17	272.197,96	994.301,32	-146.475,84
IDIN23P359400	-390.577,30	17.153,34	6.898,75	0,51%	342.336,73	-545.103,94	-1.991.132,73	390.577,30
IDIN23P359500	243.338,14	8.676,81	-3.489,65	-0,26%	-192.805,29	272.251,52	994.701,05	-243.338,14
IVIAS	1.365.670,59	45,34	2,86	0,00%	-285,27	216,95	433,54	-634,28
LF0021006S9	1.150.353,63	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002100HDP	1.367.130,27	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002100HDO	2.437.055,30	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002100HJ	2.911.665,77	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF00220018H	1.165.633,59	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFSC1900089	3.399.386,41	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20230901 - 210100	42.065.146,29	1.924,06	-958,04	-0,07%	-31.898,70	35.675,75	469,85	-715,32
NTNB20500815 - 760199_NEGOCIACAO	2.815.946,16	2.487,83	-2.070,27	-0,16%	-1.618,71	1.684,64	862,20	-1.305,22
NTNB20500815 - 760199_NEGOCIACAO	24.915,42	1.057,81	864,82	0,06%	-2.357,54	4.572,13	3.255,44	-3.583,81
OMGE13	973.283,81	588,56	568,32	0,04%	-2.688,67	2.281,52	3.764,87	-5.120,95
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PRLL14	2.328.995,55	6,03	-1,94	0,00%	-38,93	33,37	81,42	-121,26
VAM022	1.089.009,54	140,93	75,54	0,11%	-537,88	683,14	1.249,10	-1.790,65
WDOM23	3.405,18	0,00	0,00	0,00%	89.099,93	-89.308,66	110.112,17	-110.977,30
WDOM23	-96,57	2.735,63	1.683,92	0,13%	-5.553,71	5.649,76	-7.241,86	7.274,74
Total Var:	391.840.789,69	8.099.626,52	1.341.058,75	100,01%	-8.014.150,42	1.429.738,10	3.946.065,42	-11.896.092,88



Relatório de Risco de Mercado

Data: 28/04/2023

FUNDO:		FIM EMS II A						
CNPJ:		20725957000102						
Dados Gerais								
PL:	184.999.983,73	VAR / PL:	0,1705%	Limite Fundo:		0,00% Dutation DC:	460,47	
VAR:	315.476,36	ETL / PL:	0,2138%	Status:	ENQUADRADO	Dutation DU:	316,38	
ETL:	395.620,08	VAR / CDI:	0,0019%	Benchmark:				
Cenários de STRESS								
Cenário Alta - 09999 (+):	96.474.990.371.855.200,00	Cenário Baixa - 10000 (+):	306.377.582.633.083.000,00	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	460.482.125.063.646.000,00	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	133.092.775.800.319.000,00	
Cenário Alta - 09999 (-):	(2.824.033,35)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(1.636.260,92)	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	(1.737.177,99)	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(4.488.466,36)	
Cenário Alta - 09999:	96.474.990.369.031.100,00	Cenário Baixa - 10000:	306.377.582.631.446.000,00	CENÁRIO BRADESCO 1:	460.482.125.061.909.000,00	CENÁRIO BRADESCO 2:	133.092.775.795.831.000,00	
Parâmetros de Cálculo								
Modelo:	VaR paramétrico	Modelo Volatilidade:		EWMA				
Int. Confiança:	95	Lambda:		0,94				
Horizonte:	21							
Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
AEGP13	667.708,63	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CAXA	9.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	17.255.859,36	0,00	0,00	0,00%	-480,32	489,79	2.241,84	-3.412,01
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-35.248,61	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CRD14	147.918,97	4,55	-9,46	0,00%	94,45	-95,50	-293,73	448,15
CPGT16	297.337,28	55,48	-12,76	0,00%	323,89	-260,40	-528,22	786,54
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DHF24	746,02	3.742,74	-472,24	-0,15%	21.501,93	-17.918,68	-39.823,50	59.006,29
DHF25	-7.824,84	22.137,35	6.492,84	2,06%	-113.099,47	90.663,14	157.343,55	-225.217,20
DHF26	-560,76	1.933,80	603,86	0,17%	-8.879,78	7.290,46	11.769,59	-16.277,65
DHF27	-7.617,07	35.236,44	8.976,28	2,85%	-130.710,60	110.495,45	176.243,84	-235.161,79
DHF29	-615,87	4.458,88	882,96	0,28%	-13.063,72	11.571,77	18.856,45	-23.329,03
DHF33	-620,51	5.342,98	949,24	0,30%	-13.263,98	12.556,59	21.666,34	-22.982,74
DHJ24	-359,27	1.418,18	251,66	0,08%	-7.961,61	6.363,34	12.926,48	-18.983,55
DHJ25	-228,05	661,41	214,37	0,07%	-3.381,61	2.719,17	4.595,05	-6.522,85
DHJ26	8,72	95,19	-3,92	0,00%	2.765,56	-2.806,04	-10.084,85	15.241,19
DHJ28	340,22	1.147,29	-280,62	-0,08%	6.251,91	-4.941,79	-8.399,79	13.681,77
DHJ29	49.851,88	140.496,17	-46.919,44	-14,87%	712.962,78	-574.102,44	-953.791,90	1.342.989,75
DHJ26	22.739,51	94.319,26	-26.741,91	-8,48%	388.444,36	-324.724,57	-518.035,92	703.991,91
DHJ23	-13,67	79,68	8,51	0,00%	-585,77	1.329,10	-1.987,96	-1.987,96
DHJ24	-505,03	1.506,55	378,71	0,12%	-7.614,35	6.056,40	10.967,96	-15.931,85
DOLK23CO05400	0,25	4,09	-2,18	0,00%	50.145,65	0,16	82.705,55	-0,04
DOLK23CO05600	-0,25	2,92	1,56	0,00%	-726,88	0,00	-31.418,46	0,24
ERDV18	1.340.745,57	7,73	0,83	0,00%	-55,55	49,07	119,41	-178,34
INDM23	40.524,00	267.858,22	145.888,72	46,18%	632.317,28	-631.090,84	495.535,18	-497.518,31
LFT20230901 - 210100	41.631.349,47	1.994,22	-439,88	-0,14%	-31.869,75	35.307,85	465,01	-707,95
LFT20240301 - 210100	8.193.969,34	816,52	-162,82	-0,05%	-18.017,65	22.625,94	55,44	-84,40
LFT20240901 - 210100	22.499.739,37	6.001,50	-964,28	-0,14%	-84.146,01	121.316,96	1.559,86	-2.374,64
LFT20250901 - 210100	9.298.037,51	6.228,75	-517,31	-0,20%	-55.654,40	96.882,58	2.374,47	-3.613,89
LFT20260901 - 210100	1.741.352,96	1.412,33	-89,88	-0,02%	-10.356,21	30.627,96	1.802,91	-2.741,29
LTN20230701 - 100000	1.594.958,16	395,20	-11,66	0,00%	-3.038,38	3.278,10	11.453,63	-17.209,54
LTN20240101 - 100000	2.299.190,09	4.432,24	566,07	0,18%	-26.840,66	22.435,10	49.788,19	-73.770,53
LTN20250701 - 100000	15.513.375,14	146.661,04	47.518,21	15,06%	-717.415,77	623.841,66	999.270,47	-1.406.281,61
LTN20260701 - 100000	5.584.275,14	95.019,31	26.565,05	8,42%	-372.311,63	359.143,68	536.145,53	-727.516,59
NTNB20230515 - 760199_NEGOCIACAO	15.897.920,80	13.889,29	175,83	0,05%	-9.024,06	9.391,62	5.364,14	-7.276,43
NTNB20240515 - 760199_NEGOCIACAO	12.494.562,75	89.381,65	18.549,68	5,88%	-205.150,84	223.705,49	152.905,99	-204.482,77
NTNB20250515 - 760199_NEGOCIACAO	9.477.769,93	79.273,93	20.933,41	6,84%	-209.605,59	199.492,94	156.685,38	-208.366,68
NTNB20260515 - 760199_NEGOCIACAO	10.844.363,90	72.935,52	33.889,32	10,74%	-341.714,57	371.397,55	272.657,56	-358.798,06
NTNB20270515 - 760199_NEGOCIACAO	5.140.979,87	35.142,69	17.375,98	5,51%	-168.993,50	204.920,67	152.613,32	-199.526,11
NTNB20280515 - 760199_NEGOCIACAO	2.854.147,57	20.559,62	10.245,99	3,25%	-120.081,71	149.919,22	112.173,76	-144.891,95
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
WDOM23	-2.317,71	65.655,06	33.344,84	10,57%	-133.289,00	135.594,24	-173.804,73	174.593,82
WINM23	5.157,60	32.831,05	18.542,20	5,87%	80.476,75	-80.320,65	63.968,11	-63.320,81
Total Var:	184.997.708,38	1.242.536,83	315.476,36	100,02%	-928.748,80	1.222.391,07	1.777.501,89	-2.177.726,69



Relatório de Risco de Mercado

Data: 28/04/2023

FUNDO: FIM EMB III A IMOBILIÁRIO
CNPJ: 3271199000162

Dados Gerais				Limite Fundo:	0,00%	Duração DC:	4,00
PL:	58.936.853,83	VAR / PL:	4,9434%	Status:	ENQUADRADO	Duração DU:	1,00
VAR:	2.913.499,79	ETL / PL:	6,1993%	Benchmark:			
ETL:	3.653.646,27	VAR / CDI:	0,0556%				

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	159.561.859.484.879.000,00	Cenário Baixa - 10000 (+):	1.511.336.425.319.310,00	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	330.772.685.062.506.000,00	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	-
Cenário Alta - 09999 (-):	(14,82)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(32.219.912,68)	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):		CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(7.815.033,40)
Cenário Alta - 09999:	159.561.859.484.879.000,00	Cenário Baixa - 10000:	1.511.336.393.099.400,00	CENÁRIO BRADESCO 1:	330.772.685.062.506.000,00	CENÁRIO BRADESCO 2:	(7.815.033,40)

Parâmetros do Cálculo			
Modelo:	Var paramétrico	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
AIEC11	2.182.071,70	74.965,61	49.498,24	1,70%	1.091.035,85	-1.091.035,85	319.891,71	-322.510,20
BMLC11	2.994.889,44	106.155,99	55.767,46	1,91%	2.994.889,44	-2.994.889,44	439.050,79	-442.544,56
BPML11	913.750,60	81.855,99	53.323,46	1,83%	913.750,60	-913.750,60	133.955,84	-135.052,34
BTLG11	95.240,70	4.771,07	3.901,76	0,13%	47.620,35	-47.620,35	13.962,29	-14.076,58
CADXA	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CEOC11	762.588,80	27.718,55	2.845,62	0,10%	381.294,40	-381.294,40	111.735,52	-112.710,63
CNES11	413.821,98	31.888,75	-20.817,82	-0,70%	206.910,99	-206.910,99	60.666,30	-61.182,89
COMPROMISSADA_PRE	532.460,86	0,00	0,00	0,00%	-14,82	15,11	69,18	-105,28
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-829.681,03	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
EVPO11	1.042.965,00	133.332,42	122.452,84	4,20%	521.482,50	-521.482,50	152.898,67	-154.150,23
GALG11	1.756.331,27	79.175,53	63.914,53	2,19%	877.665,64	-877.665,64	257.331,56	-259.437,96
GTLG11	1.424.115,00	59.630,02	53.147,71	1,82%	1.424.115,00	-1.424.115,00	208.775,26	-210.484,20
HBRH11	2.683.950,93	96.939,50	-15.976,44	-0,55%	2.683.950,93	-2.683.950,93	393.467,21	-396.687,95
HSLG11	2.321.096,51	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
HSM11	3.741.672,30	250.994,83	237.242,96	5,14%	1.870.836,15	-1.870.836,15	548.529,16	-553.019,17
MALL11	2.442.652,80	130.740,13	119.656,87	4,11%	1.221.326,40	-1.221.326,40	358.092,90	-361.024,08
MAXR11	1.238.158,60	126.535,91	43.464,07	1,49%	619.077,42	-619.077,42	181.514,05	-182.999,84
NEWL11	936.500,00	23.917,24	-8.272,11	-0,28%	468.250,00	-468.250,00	137.290,90	-138.414,70
NEWU11	855.364,32	202.058,06	-130.254,91	-4,47%	855.364,32	-855.364,32	125.396,41	-126.422,85
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PATC11	5.252.811,90	476.466,39	452.486,42	15,53%	2.626.405,95	-2.626.405,95	770.062,23	-776.365,60
QAGR11	4.734.088,16	224.608,98	191.459,20	6,57%	2.367.033,16	-2.367.044,08	694.017,32	-699.698,23
RBRL11	2.692.733,92	256.700,15	228.997,31	7,86%	2.692.733,92	-2.692.733,92	394.754,79	-397.986,07
RCRB11	4.625.913,93	464.653,51	393.220,67	13,90%	0,00	0,00	0,00	0,00
RNGO11	40.883,40	1.788,33	1.105,93	0,04%	20.441,70	-20.441,70	5.993,51	-6.042,57
TEPP11	4.447.159,20	471.730,78	430.229,01	14,77%	2.223.579,60	-2.223.579,60	651.953,54	-657.290,13
TRXF11	6.997.229,92	195.400,12	183.045,35	6,28%	3.498.614,96	-3.498.614,96	1.025.793,91	-1.034.190,58
TRXF12	14.495,78	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
XPM11	3.130.469,00	165.922,41	156.436,70	5,37%	1.565.229,50	-1.565.229,50	458.925,29	-462.681,84
XPPR11	2.096.582,16	390.478,48	246.324,96	8,45%	1.048.291,08	-1.048.291,08	307.358,95	-309.874,84
Total Var:	59.540.217,15	4.078.428,76	2.913.499,79	99,99%	32.219.885,03	-32.219.897,54	7.751.547,27	-7.815.033,40



Data: 28/04/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIA RVA EMB II CNPJ: 13294268000125

Dados Gerais		Limite Fundo:	0,00%	Duration DC:	4,00
PL:	211.771.813,19	Status:	ENQUADRADO	Duration DU:	1,00
VAR:	14.988.325,64	Benchmark:			
ETL:	18.795.965,04				

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	470.012.489.493.654.000,00	Cenário Baixa - 10000 (-):	11.709.538.052.184.500,00	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	702.724.444.386.154.000,00
Cenário Alta - 09999 (-):	(114,83)	Cenário Baixa - 10000 (+):	(52.167.552,19)	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(30.272.037,89)
Cenário Alta - 09999:	470.012.489.493.654.000,00	Cenário Baixa - 10000:	11.709.537.999.417.000,00	CENÁRIO BRADESCO 1:	702.724.444.386.154.000,00
				CENÁRIO BRADESCO 2:	(30.272.037,89)

Parâmetros do Cálculo			
Modelo:	Var paramétrico	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95	Lambda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
ABEV3	6.471.190,80	593.822,29	-4.682,12	-0,03%	905.966,71	-1.941.402,94	948.676,57	-956.442,00
ARZT3	570.868,00	53.731,01	78.949,77	0,53%	171.260,40	-171.261,26	83.689,25	-81.574,59
B3SA3	8.892.610,72	1.187.502,09	910.395,47	6,07%	2.213.152,68	-2.213.152,68	1.297.792,73	-1.308.415,86
BBAS3	8.010.534,00	1.195.552,79	1.118.422,58	7,46%	2.002.633,50	-2.002.652,19	1.174.344,28	-1.183.956,93
BBD04	8.061.808,00	783.850,87	582.635,13	3,89%	2.015.452,00	-2.015.452,00	1.181.861,05	-1.191.535,22
BBSE3	2.912.919,00	284.661,26	251.641,44	1,68%	582.553,80	-582.553,80	427.033,93	-430.529,43
BEEF3	1.624.500,00	403.217,99	-198.124,16	-1,32%	406.125,00	-406.125,00	236.151,70	-240.101,10
BPAC11	3.520.026,00	837.301,39	679.178,74	4,53%	1.056.007,80	-1.232.009,10	516.035,81	-520.259,94
CADXA	10.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CCRO3	117.589,85	117.589,85	62.504,25	0,42%	296.504,50	-296.504,50	173.870,24	-175.293,46
CIEL3	1.913.184,00	161.807,19	76.310,91	0,51%	573.955,20	-478.296,00	280.472,77	-262.768,60
COMPROMISSADA_PRE	4.125.402,29	0,00	0,00	0,00%	-114,33	117,10	535,96	-615,72
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	2.824.351,48	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPFE3	2.565.036,00	348.602,07	257.915,38	1,72%	513.007,20	-513.007,20	376.034,28	-379.112,32
CPLE6	1.502.948,00	289.532,47	249.569,57	1,67%	330.648,56	-330.648,56	220.332,18	-222.135,71
CSMG3	2.126.592,00	190.770,58	15.678,51	0,10%	467.837,76	-574.178,84	311.758,39	-314.310,30
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ECOR3	2.200.839,00	543.016,87	254.678,91	1,70%	550.209,75	-550.245,42	322.643,00	-325.284,00
EGIE3	2.131.591,00	98.134,39	-2.056,33	-0,01%	383.686,38	-383.686,38	312.491,24	-315.049,15
ELET3	4.245.534,70	784.010,96	625.002,72	4,17%	1.309.531,10	-1.254.345,42	622.395,39	-627.490,03
ELET6	3.688.333,00	738.862,60	562.309,38	3,75%	1.392.716,00	-1.060.844,00	540.769,62	-545.135,62
ENEV3	2.121.315,00	219.372,35	169.270,48	1,13%	754.856,55	-1.081.670,65	319.964,78	-313.530,96
ENGH11	2.499.640,00	378.402,11	292.266,81	1,95%	424.938,80	-549.920,80	366.447,22	-369.446,79
EQTL3	4.773.564,00	507.574,99	380.896,01	2,54%	954.712,80	-954.712,80	699.804,48	-705.532,76
GGBR4	4.639.163,20	548.013,46	449.431,07	3,00%	1.159.790,80	-1.159.809,22	680.101,33	-685.868,32
GMA3T	2.042.587,00	251.577,41	73.780,41	0,49%	361.623,19	-326.809,12	299.438,86	-301.589,93
IRAPV3	1.387.270,98	734.648,73	608.936,62	4,05%	464.872,10	-464.872,10	200.441,91	-202.082,64
ITSA4	3.855.152,56	434.575,14	403.561,10	2,69%	732.434,57	-732.478,99	565.165,37	-569.791,55
ITUB4	16.418.687,04	2.024.829,62	1.882.219,13	12,56%	3.283.737,41	-3.119.550,54	2.406.979,52	-2.426.681,95
JBS53	2.973.190,00	306.225,27	-96.016,73	-0,64%	1.040.616,50	-1.040.616,50	435.869,65	-439.437,48
LREN3	3.154.536,00	374.247,84	-50.903,34	-0,34%	630.907,20	-630.907,20	462.454,98	-465.240,42
MLI3J	1.358.378,00	337.911,84	32.395,56	0,22%	706.315,89	-611.270,10	199.138,22	-200.768,27
MRV3	2.150.640,00	389.777,44	-105.183,19	-0,70%	645.192,00	-645.192,00	313.283,82	-317.864,59
MULT3	2.219.630,00	124.150,09	38.329,55	0,26%	665.889,00	-554.907,50	325.397,76	-328.061,31
NTCO3	2.214.212,00	736.268,22	-289.800,31	-1,93%	553.553,00	-553.553,00	324.603,48	-327.260,53
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PETR3	3.917.823,00	672.294,25	607.069,75	4,05%	1.504.549,80	-881.297,17	574.352,85	-579.654,24
PETR4	17.380.608,30	3.024.901,47	2.766.682,73	18,46%	6.966.543,82	-3.746.217,78	2.547.997,18	-2.568.853,91
PRIO3	4.333.325,00	978.223,10	875.868,60	5,84%	2.599.995,00	-2.599.995,00	635.265,45	-640.465,44
RADL3	4.935.384,00	426.326,14	303.898,98	2,03%	987.076,80	-987.076,80	723.527,29	-729.449,76
RALL3	3.393.290,00	248.097,69	134.635,16	0,90%	1.616.876,00	-1.185.600,64	526.774,85	-531.056,78
RDO3	2.300.722,00	500.300,20	447.880,30	2,99%	690.216,60	-690.216,60	337.285,85	-340.046,71
RECV3	1.163.088,00	278.900,95	175.132,97	1,71%	739.459,20	-687.451,20	170.508,70	-171.904,41
RENT3	6.502.921,00	751.712,06	704.952,37	4,70%	2.145.963,93	-1.690.759,46	953.329,22	-961.131,72
SBS3P	1.932.847,00	112.688,74	31.647,94	0,21%	463.211,75	-463.211,75	283.355,37	-285.674,79
STB3	2.278.278,00	221.645,90	171.994,76	1,15%	797.397,30	-797.397,30	333.995,56	-336.729,49
SUBZ3	3.048.680,00	230.342,44	-30.354,62	-0,20%	762.170,00	-609.736,00	446.936,49	-450.584,90
TIMS3	2.115.400,00	186.221,25	61.606,64	0,41%	676.928,00	-486.542,00	310.117,64	-312.656,12
TOTS3	1.852.215,78	165.076,94	-48.616,45	-0,32%	370.443,16	-370.443,16	271.534,83	-273.757,49
VALE3	29.024.798,00	2.532.795,17	-411.445,69	-2,15%	7.256.199,50	-7.256.199,50	4.255.035,39	-4.289.865,14
VAMO3	1.048.476,00	147.273,58	35.668,98	0,24%	366.966,60	-419.390,40	153.706,58	-154.964,75
WEGE3	6.011.744,00	296.356,97	-145.436,12	-0,97%	1.502.936,00	-1.502.950,62	881.321,67	-888.535,76
Total Var:	211.771.811,75	26.834.039,06	14.988.325,64	100,03%	56.963.668,78	-52.767.435,09	30.025.983,66	-30.272.037,89



**DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO
E CONTROLE DE RISCO - ABRIL DE 2023**



Relatório de Risco de Mercado

Data: 28/04/2023

FUNDO:		FIA RVA EMB III				Dados Gerais		Limite Fundo:		0,00% Duration DC:		4,00	
CNPJ:		38452693000108				Status:		ENQUADRADO		Duration DU:		1,00	
PL:	87.503.204,71	VAR / PL:	8,2705%	ETL / PL:	10,3715%	ETL:	7.236.936,75	VAR / CDI:	0,093%	Benchmark:			
Cenários de STRESS													
Cenário Alta - 09999 (+):	413.483.713.329.425.000,00	Cenário Baixa - 10000 (+):	18.392.272.813.794.500,00	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	458.259.882.806.322.000,00	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	10.912.113.834.487.500,00						
Cenário Alta - 09999 (-):	(833.153,50)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(23.854.019,66)	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	(1.086.279,58)	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(12.382.180,03)						
Cenário Alta - 09999:	413.483.713.328.592.000,00	Cenário Baixa - 10000:	18.392.271.989.940.500,00	CENÁRIO BRADESCO 1:	458.259.882.804.236.000,00	CENÁRIO BRADESCO 2:	10.912.113.822.105.300,00						
Parâmetros do Cálculo													
Modelo:	Var paramétrico	Modelo Volatilidade:	Lambda:	EWMA									
Int. Confiança:	95			0,94									
Horizonte:	21												
Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2					
ALP4	380.061,13	42.304,19	17.864,25	6,25%	95.020,28	-95.020,28	55.719,89	-55.719,89					
ALSO3	4.336.670,56	343.179,02	295.083,09	4,08%	1.517.634,70	-1.084.167,64	635.755,90	-640.959,91					
ARZ23	523.671,82	85.981,85	74.463,33	1,03%	157.101,55	-157.102,34	76.770,29	-77.398,70					
ASAJ3	410.424,55	66.751,70	-8.655,47	-0,12%	117.056,15	-105.474,77	60.168,24	-60.660,75					
AURE3	2.104.941,54	143.799,45	124.565,09	1,72%	526.235,39	-652.531,88	308.584,43	-311.110,36					
BSA33	1.705.142,24	254.493,35	239.090,70	3,30%	426.295,56	-426.290,54	249.973,85	-252.020,02					
BPAC11	4.876.559,24	1.159.977,19	890.776,47	12,31%	1.462.967,77	-1.706.795,73	1.743.903,59	-1.720.755,46					
CAXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00					
COMPROMISSADA_PRE	3.494.093,68	0,00	0,00	0,00%	-97,26	99,18	453,94	-690,89					
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	242.208,36	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00					
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00					
DOLM23	-14.485,67	410.344,10	295.285,91	4,08%	-833.056,24	847.463,97	-1.086.279,58	1.091.211,38					
ELET3	7.164.521,75	1.323.052,10	992.927,05	13,72%	2.209.889,86	-2.116.761,66	1.050.318,89	-1.058.916,32					
ENEV3	4.870.989,70	503.725,39	400.043,67	5,53%	1.802.265,82	-2.484.204,24	714.006,94	-719.932,13					
ENUI3	236.130,00	54.122,69	13.622,30	0,19%	163.658,50	-62.135,10	33.737,06	-34.013,21					
EQT13	9.642.025,14	1.025.442,41	737.271,41	10,19%	1.928.405,03	-1.928.405,03	1.413.520,89	-1.425.091,32					
EUCA4	59.685,00	15.034,54	-1.359,24	-0,02%	47.748,00	-47.748,00	8.749,82	-8.821,44					
HAPV3	1.385.329,56	744.352,86	641.342,93	8,86%	471.012,05	-471.012,05	203.089,31	-204.751,71					
IGT11	5.499.376,52	250.457,05	148.211,49	2,05%	1.599.875,70	-1.099.875,70	806.208,69	-812.608,15					
ITUB4	6.255.169,92	771.416,94	704.804,78	9,74%	1.251.033,98	-1.188.482,29	917.007,91	-924.514,11					
LREN3	2.084.955,84	247.354,99	-16.499,23	-0,23%	416.991,17	-416.991,17	305.654,53	-308.156,47					
LWSA3	259.523,14	52.032,84	13.141,04	0,18%	103.804,32	-103.814,19	38.046,09	-38.357,52					
MIRV3	235.440,00	42.670,55	-14.196,67	-0,20%	70.632,00	-70.632,00	34.815,50	-34.796,03					
MUN3	290.000,00	53.686,71	37.735,20	0,52%	178.848,00	-178.848,00	43.696,53	-44.056,22					
NTCO3	3.748.267,18	1.246.405,03	-372.328,04	-5,14%	937.066,80	-937.066,80	549.495,97	-553.993,89					
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00					
PETZ3	1.802.978,89	234.373,80	94.340,36	1,30%	450.744,72	-450.773,94	264.316,71	-266.480,28					
PRIO3	1.473.400,00	332.611,54	288.674,04	3,99%	884.040,00	-884.040,00	216.000,44	-217.765,52					
RDO3	856.710,20	186.294,69	172.377,65	2,38%	257.013,06	-257.013,06	125.593,72	-126.514,77					
RECV3	3.425.481,12	821.408,14	526.634,38	7,28%	2.177.826,21	-2.024.654,29	502.175,53	-506.286,11					
RENT1	8.391,24	3.271,81	-203,15	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00					
RENT3	5.903.039,59	682.368,13	654.433,80	9,04%	1.948.003,07	-1.534.790,29	865.385,60	-872.469,25					
SCAR3	91.764,00	20.809,35	-4.896,11	-0,07%	55.070,40	-55.070,40	13.455,53	-13.565,68					
SMTF3	211.975,00	40.336,10	10.115,61	0,14%	84.788,61	-84.790,00	31.075,54	-31.329,91					
SOMA3	2.315.989,20	215.294,67	106.748,22	1,48%	694.796,76	-694.796,76	339.524,02	-342.303,20					
SUZB3	7.785.158,60	588.206,19	-50.610,41	-0,70%	1.946.289,65	-1.557.031,72	1.141.304,25	-1.150.646,44					
TEND3	190.968,00	43.443,63	-14.941,91	-0,21%	66.838,80	-66.838,80	27.995,91	-28.225,07					
VBR3	3.042.045,60	252.792,57	125.088,59	1,73%	769.511,40	-769.511,40	445.963,09	-449.614,34					
YDUQ3	601.399,68	156.388,88	115.715,62	1,60%	234.545,88	-150.349,92	88.165,19	-88.886,87					
Total Var:	87.503.203,32	12.414.140,02	7.236.936,75	100,01%	23.650.947,67	-23.006.456,81	11.195.137,21	-11.290.968,65					

Relatório de Risco de Mercado



Data: 28/04/2023

FUNDO:		FIA RVA EMB IV				Dados Gerais		Limite Fundo:		0,00% Duration DC:		4,00	
CNPJ:		38452613000132				Status:		ENQUADRADO		Duration DU:		1,00	
PL:	82.133.391,66	VAR / PL:	7,1657%	ETL / PL:	8,9361%	ETL:	5.885.430,83	VAR / CDI:	0,0806%	Benchmark:			
Cenários de STRESS													
Cenário Alta - 09999 (+):	228.539.017.051.568.000,00	Cenário Baixa - 10000 (+):	19.641.259.352.444.000,00	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	160.878.046.687.348.000,00	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	-						
Cenário Alta - 09999 (-):	(192,61)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(21.173.429,77)	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	-	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(11.106.219,99)						
Cenário Alta - 09999:	228.539.017.051.568.000,00	Cenário Baixa - 10000:	19.641.259.371.270.600,00	CENÁRIO BRADESCO 1:	160.878.046.687.348.000,00	CENÁRIO BRADESCO 2:	(11.106.219,99)						
Parâmetros do Cálculo													
Modelo:	Var paramétrico	Modelo Volatilidade:	Lambda:	EWMA									
Int. Confiança:	95			0,94									
Horizonte:	21												
Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2					
ALSO3	5.126.540,56	405.684,76	373.779,66	6,35%	1.794.289,20	-1.281.635,14	751.555,85	-757.702,70					
AURE3	6.040.394,64	412.650,63	347.628,08	5,91%	1.510.098,66	-1.872.523,34	885.521,85	-892.770,33					
CAXA	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00					
COMPROMISSADA_PRE	6.919.837,15	0,00	0,00	0,00%	-192,61	196,41	899,01	-1.368,26					
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	71.324,56	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00					
CXSE3	114.125,44	14.854,67	11.733,57	0,20%	30.213,06	-17.899,36	16.730,79	-16.867,74					
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00					
EQT13	13.090.740,98	1.391.154,49	1.164.233,84	19,78%	2.615.148,20	-2.616.148,20	1.917.636,63	-1.933.333,52					
GPSS3	5.685.203,35	304.841,48	105.376,97	1,79%	2.558.296,35	-2.558.341,51	833.450,81	-840.273,06					
GMAT3	6.707.967,67	826.206,15	400.628,78	6,81%	1.207.312,44	-1.073.274,83	983.388,06	-991.437,62					
HAPV3	1.039.669,56	553.790,13	485.747,99	8,25%	350.427,65	-350.427,65	151.096,16	-152.332,96					
ITUB4	5.262.226,56	648.962,50	567.520,57	9,84%	1.852.445,31	-1.899.823,05	771.442,41	-777.757,09					
MATD3	3.045.615,60	227.523,52	125.611,45	0,89%	385.653,46	-385.653,46	188.470,65	-190.319,39					
MULT3	3.870.081,60	216.464,44	59.297,04	1,01%	1.161.024,48	-967.520,40	567.353,96	-571.998,06					
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00					
PRIO3	5.336.314,25	1.204.642,13	1.075.659,61	18,28%	3.201.788,55	-3.201.788,55	782.303,67	-788.707,25					
RAIL3	1.676.124,79	529.997,33	296.173,46	19,78%	3.454.256,12	-2.533.650,12	1.125.319,98	-1.134.521,23					
RENT1	6.915,48	2.696,40	-588,36	-0,01%	0,00	0,00	0,00	0,00					
RENT3	6.153.642,79	711.336,87	655.896,50	11,14%	2.030.702,12	-1.599.947,13	902.124,03	-909.508,40					
SUZB3	860.038,20	64.990,02	-19.877,84	-0,34%	215.009,55	-172.007,64	126.081,60	-127.113,65					
UGPA3	3.658.142,96	246.001,94	190.893,31	3,07%	914.535,74	-731.628,59	536.283,76	-540.873,53					
VBR3	3.245.687,39	269.211,58	126.516,20	2,15%	811.621,80	-811.621,80	475.932,93	-478.630,81					
Total Var:	82.133.389,25	8.031.569,06	5.885.430,83	99,99%	23.293.680,11	-21.173.233,35	11.015.589,16	-11.106.219,59					



Data: 28/04/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI CNPJ: 4190187100163

Dados Gerais				Limite Fundo:	ENQUADRADO	0,00% Duração DC:	4,8
PL:	95.508.728,49	VAR / PL:	7,2839%	Status:		Duração DU:	1,61
VAR:	6.956.796,39	ETL / PL:	9,1344%	Benchmark:			
ETL:	8.724.103,33	VAR / CDI:	0,0819%				

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	1.056.657.993.110.540.000,00	Cenário Baixa - 10000 (-):	11.290.844.941.211.400,00	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	1.166.976.623.633.680.000,00	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	-
Cenário Alta - 09999 (-):	(563,35)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(24.044.347,27)	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	-	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(14.006.187,23)
Cenário Alta - 09999:	1.056.657.993.110.540.000,00	Cenário Baixa - 10000:	11.290.844.917.167.100,00	CENÁRIO BRADESCO 1:	1.166.976.623.633.680.000,00	CENÁRIO BRADESCO 2:	(14.006.187,23)

Parâmetros do Cálculo			
Modelo:	VaR paramétrico	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95	Lambda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
ALOP4	3.070.247,75	7.485,32	3.415,97	0,05%	-18.621,33	-18.621,33	10.919,55	-11.008,93
ALSO3	491.928,24	38.928,35	31.762,38	0,46%	172.174,88	-122.982,06	72.116,68	-72.706,99
ARZ23	199.936,56	32.827,65	28.570,35	0,41%	59.980,97	-59.981,27	29.310,70	-29.550,62
ASAS3	725.515,57	117.998,29	-19.342,21	-0,28%	206.322,47	-186.449,53	106.380,58	-107.231,20
AZUL4	178.398,98	77.899,31	-34.504,93	-0,50%	79.317,92	-79.370,64	25.860,05	-26.071,77
BZSA3	3.319.736,32	445.314,26	330.017,05	4,74%	829.934,08	-829.934,08	486.673,35	-490.657,03
BBSA3	3.018.629,80	450.523,19	425.079,89	6,11%	754.657,45	-754.664,49	442.531,13	-446.153,48
BBD03	923.936,22	96.926,20	75.029,99	1,08%	230.984,06	-230.984,06	135.449,95	-136.457,77
BDD04	3.233.619,75	343.574,41	248.984,29	3,58%	683.404,94	-683.404,94	510.126,65	-522.209,00
BBS03	1.142.454,38	111.644,88	99.993,60	1,44%	228.490,88	-228.490,88	167.483,81	-168.854,76
BEEF3	110.346,30	27.389,11	-12.831,52	-0,18%	-27.586,58	-27.586,58	16.176,77	-16.309,18
BPAC11	1.422.788,42	338.435,78	265.629,40	3,82%	426.836,53	-497.975,95	208.580,78	-210.288,13
BPAN4	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
BRAP4	239.989,10	18.702,74	9.954,24	0,13%	93.911,43	-92.182,79	43.232,21	-42.886,09
BRFS3	338.340,44	41.209,27	14.322,28	0,21%	84.585,11	-84.585,11	49.600,71	-50.006,72
BRKM5	260.179,13	44.167,75	36.325,82	0,52%	143.098,52	-78.055,05	38.142,26	-38.454,48
CADA	9.059,75	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CASH1	127,00	1.389,66	561,06	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CASH3	29.483,38	6.166,63	-2.713,67	-0,04%	11.793,35	-11.793,35	4.322,26	-4.327,64
CCRO3	671.674,29	66.594,33	32.314,72	0,46%	167.918,57	-167.918,57	98.467,45	-99.273,46
CIEL3	296.494,38	25.075,96	12.307,61	0,18%	88.948,31	-74.123,60	43.466,08	-43.821,87
CMG04	882.901,50	154.843,61	113.728,73	1,63%	230.826,91	-259.215,59	129.433,36	-130.492,64
CMNO	285.650,56	31.824,04	7.767,29	0,11%	99.407,70	-99.407,70	57.578,33	-57.578,33
COGN3	183.604,08	29.232,34	6.707,08	0,10%	45.901,62	-84.261,43	26.916,36	-27.136,68
COMPROMISSADA_PRE	1.974.712,41	0,00	0,00	0,00%	-54,97	56,05	256,55	-390,46
COMTAS_A_PAGAR_RECEBER	1.599.812,68	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPFE3	308.433,98	41.917,82	29.472,99	0,42%	61.688,90	-61.688,90	45.216,42	-45.586,54
CPLE6	621.558,02	119.738,83	100.437,14	1,44%	136.742,76	-136.742,76	91.120,41	-91.866,28
CRFB3	281.779,00	33.569,05	13.424,50	0,19%	70.444,75	-70.444,75	41.308,80	-41.646,94
CSAN3	869.648,92	124.310,17	106.100,45	1,53%	-217.412,23	-217.412,23	127.490,53	-128.534,11
CSNA3	415.400,93	70.864,94	40.532,23	0,59%	166.157,45	-124.623,20	60.897,78	-61.396,26
CVCB3	37.642,08	7.510,68	3.359,39	0,09%	18.821,94	-18.821,94	9.578,33	-9.563,60
CYRE3	209.965,50	30.878,20	17.959,09	0,26%	67.188,96	-60.890,00	30.780,94	-31.032,90
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DXCO3	80.257,14	10.217,05	7.869,25	0,11%	20.064,29	-24.078,51	11.765,70	-11.862,01
EGE3	521.641,96	24.015,40	-281,85	-0,00%	93.895,85	-93.895,85	76.472,71	-77.698,58
ELET3	3.388.012,65	625.654,77	479.577,87	6,89%	1.045.029,25	-1.000.990,09	496.652,65	-500.748,27
ELET6	497.324,19	99.655,77	72.461,49	1,04%	175.654,74	-134.950,92	72.907,73	-73.504,52
EMBR3	707.237,56	118.898,21	-85.805,37	-1,23%	176.809,39	-176.809,39	103.681,03	-104.529,71
ENBR3	274.410,00	16.880,91	-9.335,65	-0,13%	52.137,90	-41.161,90	40.228,91	-40.857,80
ENEV3	897.808,35	91.811,26	71.917,22	1,03%	328.489,09	-452.732,26	130.152,70	-131.118,07
ENGH11	514.892,40	77.945,77	57.396,37	0,83%	87.531,71	-113.276,33	75.483,23	-76.101,10
EQL3	1.491.561,04	158.629,53	113.161,35	1,63%	298.312,21	-298.312,21	218.662,85	-220.452,72
EZTC3	67.942,28	9.139,00	6.860,34	0,10%	13.588,46	-20.382,68	9.960,34	-10.041,87
FLRY3	289.948,24	13.722,09	6.329,17	0,22%	57.969,65	-57.969,65	42.368,75	-42.639,57
GGBR4	1.364.478,02	161.476,83	134.971,77	1,94%	341.119,76	-341.125,17	200.032,62	-201.670,00
GOAU4	385.654,50	38.737,86	31.267,48	0,45%	115.696,35	-96.413,63	56.536,95	-56.999,74
GOLL4	71.831,52	15.583,75	860,30	0,01%	43.088,91	-25.141,03	10.530,50	-10.616,70
HAPV3	591.622,56	317.885,33	262.629,96	3,78%	201.151,67	-201.151,67	86.731,87	-87.441,61
HYPE3	748.094,75	68.244,67	-4.347,67	-0,06%	170.244,78	-155.440,65	106.510,65	-106.800,78
IGT11	217.750,20	9.916,95	5.294,82	0,08%	43.550,04	-43.550,04	31.922,18	-32.183,48
INDM23	42.980,00	273.592,05	272.937,57	3,92%	670.639,54	-669.338,77	625.567,62	-627.670,93
IRBR3	127.075,06	194.423,14	-730,35	-0,01%	82.599,31	-69.891,72	18.629,32	-18.791,61
ITSA4	2.157.613,64	243.619,54	223.219,54	3,20%	469.621,73	-469.621,73	316.385,16	-318.895,36
TUBA	6.169.815,36	760.890,62	705.734,84	10,14%	1.233.963,07	-1.172.254,92	904.493,93	-911.988,71
JBSS3	1.007.143,50	103.731,28	-29.653,70	-0,43%	352.600,23	-352.500,23	147.647,24	-148.855,81
KLBN11	665.647,48	55.341,95	40.707,21	0,59%	166.408,39	-133.129,50	97.583,92	-98.382,70
LFT2020901 - 210100	670.413,27	30,66	-19,55	0,00%	-908,39	568,58	7,49	-11,40
LRN3	746.539,20	85.667,92	-8.492,85	-0,12%	149.307,84	-149.307,84	109.442,65	-110.338,49
LWSA3	112.322,04	22.519,90	5.272,84	0,08%	44.926,68	-44.930,95	16.466,41	-16.601,20
MGLU3	475.893,22	118.383,80	15.257,98	0,22%	247.450,23	-214.151,95	69.765,95	-70.337,02
MRFQ3	94.427,55	11.583,07	-1.235,77	-0,02%	37.769,87	-28.329,72	13.843,08	-13.966,39
MRVE3	109.979,20	19.571,16	-6.217,28	-0,09%	32.693,76	-32.693,76	15.976,35	-16.107,13
MULT3	342.734,70	19.170,11	6.543,96	0,09%	102.820,41	-85.683,68	50.244,91	-50.656,19
NTCO3	459.952,22	152.947,14	-53.315,25	-0,77%	114.988,06	-114.988,06	67.429,00	-67.980,94
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PCAR3	117.405,00	27.924,16	24.795,00	0,36%	21.132,90	-18.784,80	17.211,57	-17.352,46
PETR3	3.954.207,56	678.654,97	616.211,61	8,36%	1.518.560,86	-880.595,21	579.701,49	-584.446,66
PETRA	5.365.134,90	933.742,03	858.636,74	12,34%	2.150.468,31	-1.156.401,63	786.528,78	-792.966,94
PETZ3	102.730,50	13.354,20	4.185,96	0,06%	25.682,63	-25.684,29	15.060,29	-15.183,57
PRIO3	1.445.600,00	326.335,85	291.517,78	4,19%	867.360,00	-867.360,00	211.924,96	-213.659,68
QUAL3	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
RADI3	1.459.068,96	121.850,09	85.808,83	1,23%	291.613,39	-291.613,39	213.752,62	-215.502,30
RAIL3	1.187.181,10	81.968,81	42.106,08	0,61%	534.231,50	-391.775,79	174.040,75	-175.465,37
RAIZ4	189.843,28	66.130,47	56.104,40	0,18%	66.445,15	-66.445,15	27.831,03	-28.058,84
RDOR3	1.241.698,04	270.002,97	244.557,62	3,52%	372.497,41	-372.497,41	182.027,07	-183.917,06
RENT1	1.853,29	722,61	-54,35	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
RENT3	2.224.509,47	257.144,53	242.781,28	3,49%	734.088,13	-578.372,46	326.113,09	-328.782,50
RRRP1	13.731,84	207.644,71	120.114,94	1,73%	0,00	0,00	0,00	0,00
RRRP3	368.448,78	99.170,87	62.928,93	0,90%	221.069,27	-221.069,27	54.014,59	-54.456,73
SANB11	473.718,10	47.109,64	42.735,14	0,61%	94.743,62	-84.743,62	69.447,07	-70.015,54
SBSP3	777.521,15	46.331,00	13.372,46	0,20%	194.380,28	-194.380,28	113.956,80	-114.917,63
SLEC3	207.625,50	21.592,30	4.624,52	0,07%	62.287,65	-62.287,65	30.437,90	-30.687,05
SMTQ3	223.065,60	41.954,86	32.094,15	0,46%	66.919,68	-66.919,68	32.701,42	-32.969,10
SOMA3	204.346,80	18.996,11	8.201,22	0,12%	61.304,04	-61.304,04	29.957,24	-30.202,46
SUEZ3	1.434.033,00	103.340,98	-9.529,97	-0,14%	388.808,45	-388.808,45	210.229,36	-211.950,20
TAEI11	395.152,45	21.138,76	3.283,04	0,05%	98.788,11	-98.788,11	57.929,35	-58.403,53
TIMS3	561.078,00	49.392,38	14.608,51	0,21%	179.544,96	-129.047,94	82.254,04	-82.927,33
TOTS3	653.662,84	65.315,24	-15.396,44	-0,22%	130.732,57	-130.732,57	95.826,97	-96.611,37
UGPA3	778.749,20	52.369,14	37.558,20	0,54%	194.687,90	-185.749,84	114.164,63	-115.



3. RISCO DE CRÉDITO

Para o acompanhamento do risco de crédito da carteira, a Entidade adotará as notas emitidas por agências de *rating* (agências de avaliação de risco de crédito) para os títulos privados de crédito. Limites de alocação por classificação de risco e a lista das agências de *rating* estão definidas na Política de Investimento dos Planos administrados pela EMBRAER PREV. O seguinte relatório elaborado pelo administrador é utilizado pela EMBRAER PREV para o controle de risco de crédito:

3.1. Relatório de Risco de Crédito



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

28/04/2023

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	12/08/15	16/07/13	16/07/23	DUKE GEP	1.548.970,08	-	Aaa.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	18/05/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	1.259.555,21	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	465.538,20	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	279.322,92	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	20/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	930.307,74	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	25/08/17	25/08/17	15/08/24	PETR	18.488.489,42	AAA	Aaa.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	18/12/17	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	3.549.754,98	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	21/12/17	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	1.036.092,36	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/01/18	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	3.687.660,17	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB II	19/02/18	19/02/18	15/02/25	SABESP	9.319.593,14	brAAA	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/02/18	19/02/18	15/02/25	SABESP	5.783.825,62	brAAA	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	13/03/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	12.541.143,36	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB II	23/05/18	23/05/18	15/05/28	COMGAS	27.363.948,60	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	617.193,00	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	617.193,00	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	617.193,00	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	615.849,49	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	617.193,00	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	04/07/18	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	12.638.987,01	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/07/18	26/07/18	15/07/25	AEGEA SA	14.545.827,52	brA	Aa1.br	AA(bra)
FI RF EMB II	26/07/18	26/07/18	15/07/25	CSMG	13.127.590,83	-	Aa3.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/02/13	15/02/25	CEMIG	1.301.967,42	brA+	A1.br	AA(bra)
FIM EMB I A	12/02/19	09/01/19	15/01/25	ITAUUBB	2.555.882,80	-	AAA.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	574.217,95	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	3.635.793,48	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	2.070.497,42	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	6.259.803,88	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	716.739,56	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	5.799.074,67	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	8.600.874,79	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	886.150,74	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	628.050,88	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	30/09/20	28/09/20	22/09/25	BCBF	256.106,65	-	-	AA+(bra)
FIM EMB II A	08/01/21	22/05/19	15/04/24	ECORODOV	1.316.138,49	-	-	AA(bra)
FIM EMB II A	20/01/21	26/07/18	15/07/23	AEGEA SA	369.141,80	-	Aa1.br	AA(bra)
FIM EMB II A	20/01/21	31/07/18	23/07/23	COPEL GT	90.630,03	-	-	AA+(bra)
FIM EMB II A	04/02/21	26/07/18	15/07/23	AEGEA SA	124.780,33	-	Aa1.br	AA(bra)
FIM EMB II A	05/02/21	31/07/18	23/07/23	COPEL GT	56.959,16	-	-	AA+(bra)
FIM EMB II A	05/02/21	26/07/18	15/07/23	AEGEA SA	171.572,95	-	Aa1.br	AA(bra)
FIM EMB II A	05/02/21	07/08/19	15/07/24	COPEL GT	294.327,75	-	-	AA+(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	6.110.336,26	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	6.123.927,25	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	4.251.634,68	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/07/19	15/06/29	NEOENERG	612.371,90	brAA+	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/07/19	15/06/29	NEOENERG	6.087.282,29	brAA+	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	1.760.583,51	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	3.374.394,64	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	3.610.265,30	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	31/07/20	15/07/34	IGUA SAN	2.645.364,28	brAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	23/05/18	15/05/28	COMGAS	23.833.116,52	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	16/07/13	16/07/23	DUKE GEP	6.210.148,74	-	Aaa.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	472.367,40	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	831.366,62	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	944.734,79	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	472.367,40	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	578.177,69	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	486.249,07	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	1.410.780,67	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	26/10/16	27/01/25	BRADESCO	13.532.360,15	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	12/12/17	15/11/24	CCR	6.254.986,41	brAAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	14/12/17	15/11/24	ECORODOV	4.168.880,44	brAA	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	19/02/18	15/02/25	SABESP	1.358.343,26	brAAA	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	23/05/18	15/05/28	COMGAS	10.592.496,23	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	28/06/18	15/06/27	JAGUARA	1.856.962,14	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	28/06/18	15/06/27	ENERGMIR	1.155.492,97	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	31/07/18	01/08/25	BRADESCO	4.382.763,81	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB I A	28/05/21	28/05/21	28/11/23	B.ALFA	1.192.830,59	-	Aa1.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	173.175,31	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	326.800,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	22/12/20	15/12/26	IRB	2.614.426,98	brAA+	-	-



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

28/04/2023

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	160.000,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	28/04/21	15/03/28	BRISANET	3.213.901,45	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	952.145,06	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	75.000,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	1.341.502,74	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	07/04/21	15/03/31	LOCALIZA	5.081.116,13	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	298.281,39	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	1.566.014,77	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/06/21	06/01/21	15/11/25	QUATA	1.185.259,17	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	687.669,45	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	28.850,46	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	446.022,37	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	778.962,38	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	BCBF	521.797,76	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	BCBF	521.797,76	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	427.231,21	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	868.356,12	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	855.330,78	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	1.811.504,57	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	452.348,93	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	194.740,60	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	487.366,67	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	BCBF	1.564.319,63	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	14/06/21	19/06/19	19/06/24	BNBBM	603.844,03	brAAA	AAbr	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	14/06/21	12/06/19	12/06/24	BNBBM	916.189,56	brAAA	AAbr	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/06/21	06/07/20	29/06/24	SBF COME	498.532,59	brA+	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/06/21	06/07/20	29/06/24	SBF COME	1.193.669,59	brA+	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	15/06/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	81.200,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	16/06/21	14/07/20	13/07/23	ECORODOV	2.095.116,97	brAAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	16/06/21	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	1.749.889,00	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	17/06/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	760.433,09	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	17/06/21	18/03/21	15/02/26	CORSAN	775.150,13	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	18/06/21	18/06/21	15/12/30	MG050	532.043,99	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	49.000,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	1.500.922,13	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	254.000,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	82.034,21	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	25/06/21	25/06/21	20/06/26	OURO VER	1.487.709,62	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	3.038.303,91	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	01/07/21	06/12/19	15/10/26	LIGHT	1.721.991,80	D	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	01/07/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	2.657.503,15	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/07/21	01/03/21	18/02/25	RENNER	1.124.382,14	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/07/21	01/03/21	18/02/25	RENNER	237.790,94	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/07/21	07/04/21	15/03/29	CAGECE	1.168.279,20	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	08/07/21	08/07/21	15/06/31	VAMOS	253.246,92	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/07/21	07/04/21	15/03/29	CAGECE	2.662.564,96	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/07/21	08/07/21	15/06/31	VAMOS	5.024.740,56	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	12/07/21	12/07/21	12/07/26	BRADESCO	3.817.433,02	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	2.053.522,09	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	215.672,32	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	997.425,02	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	292.400,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	518.661,01	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	258.000,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	378.400,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	189.200,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	1.814.622,28	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	283.667,53	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	4.107.044,18	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	371.927,15	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	371.927,15	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	1.326.001,13	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	2.359.848,71	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	28/06/18	15/05/23	ELEKTRO	578.057,02	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/07/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	2.803.040,87	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	19/07/21	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	622.484,77	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/21	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	1.904.029,57	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	323.600,00	-	-	D



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

28/04/2023

Fundo	INFORMAÇÕES DOS ATIVOS					INFORMAÇÕES DE RATING		
	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/07/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	1.839.478,27	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/07/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	674.043,29	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	11/06/18	15/05/25	INTERVIA	1.338.412,26	-	Aa2.br	-
FIM EMB I A	21/07/21	17/03/21	05/03/24	ENERG TR	1.290.277,16	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.134.431,91	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	884.568,89	-	-	AA-(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	20/09/19	20/08/26	VAMOS	1.036.232,09	brAA+	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	23/07/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.596.131,97	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/07/21	07/11/19	15/10/24	BKBR	1.000.839,07	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/07/21	23/12/20	15/12/26	RD COLIN	2.164.752,86	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/07/21	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	1.056.413,27	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	04/08/21	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	1.007.109,54	A	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	06/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	1.151.289,67	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	11/08/21	11/08/21	15/08/31	CSAN	1.005.525,80	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	11/08/21	19/11/19	15/06/27	AUTOPIST	1.306.680,58	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	17/08/21	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	3.204.039,32	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	18/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	1.167.557,89	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	18/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	906.014,91	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	27/08/21	27/08/21	20/08/31	S LUIZ A	981.404,30	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/09/21	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	520.749,60	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	663.610,41	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	59.427,80	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	297.138,99	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/06/19	15/06/24	PROLAGOS	2.304.213,61	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	12/05/21	15/04/26	ELETROB	1.933.647,36	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/09/21	22/10/19	21/10/26	AUTOBAN	612.578,91	brAAA	-	-
FIM EMB I A	17/09/21	04/10/18	01/10/24	EQUATENE	1.401.356,13	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	17/09/21	28/04/21	15/03/28	BRISANET	1.431.989,59	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/09/21	20/09/21	15/09/29	MOV_PART	994.910,85	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.064.087,98	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.064.087,98	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	1.054.644,14	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	781.556,23	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	781.556,23	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	259.814,64	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	259.814,64	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	736.813,52	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	736.813,52	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	946.811,45	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	367.799,83	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	367.799,83	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	23/09/21	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	3.984.805,19	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	23/09/21	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	4.038.312,84	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	24/09/21	05/04/21	15/03/24	CCPR	40.567,79	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	24/09/21	31/05/21	20/05/25	CEA MODA	1.660.788,16	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	24/09/21	09/09/21	11/09/23	PANAMERI	1.223.779,28	brAAA	AAAbr	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	27/09/21	28/12/20	15/01/26	LOCAMERI	1.875.297,54	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	27/09/21	29/03/21	01/04/24	CNH	2.266.907,64	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	30/09/21	30/09/21	15/09/31	SIMPAR	834.689,50	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	04/10/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	618.192,49	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/10/21	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	5.164.854,32	-	-	AA-(bra)
FIM EMB I A	20/10/21	20/10/21	20/10/25	DAYCOVAL	2.503.591,90	brAA+	AA.br	AA(bra)
FIM EMB I A	20/10/21	20/10/21	20/10/24	DAYCOVAL	1.397.693,72	brAA+	AA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/10/21	22/10/21	15/12/35	CART	2.619.701,51	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	22/10/21	22/10/21	15/12/35	CART	806.868,07	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	25/10/21	22/04/21	15/03/26	VIX LOGI	997.753,06	-	-	A+(bra)
FIM EMB I A	27/10/21	27/10/21	15/10/29	CONT GLO	1.997.955,89	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/10/21	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	774.840,13	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/10/21	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	1.122.748,48	brAAA	-	-
FIM EMB I A	28/10/21	28/10/21	07/11/23	TOYOTA	2.656.029,14	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	04/11/21	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	3.013.398,61	A	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/11/21	10/11/21	15/10/28	LIGHT	245.738,79	D	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	12/11/21	12/11/21	15/10/31	VAMOS	2.056.526,48	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	18/11/21	18/11/21	15/10/31	HIDRO BR	3.907.202,73	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/11/21	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	1.661.603,76	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/11/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	2.097.551,51	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/11/21	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	2.161.417,72	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/11/21	28/04/21	15/03/28	BRISANET	816.126,40	brA+	-	-



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

28/04/2023

Fundo	INFORMAÇÕES DOS ATIVOS					INFORMAÇÕES DE RATING		
	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	03/12/21	11/06/19	11/06/24	BNBBM	604.745,58	brAAA	AAbr	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/12/21	06/12/21	15/12/35	TESC	2.544.253,36	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/12/21	06/01/21	15/11/25	QUATA	2.461.507,93	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/12/21	20/12/21	15/11/35	ORIZON	2.113.097,51	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/01/22	22/04/21	15/03/26	VIX LOGI	979.408,26	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/01/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.260.508,82	brAA	-	-
FIM EMB I A	19/01/22	19/01/22	19/01/24	BES INV	1.193.726,97	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/01/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	334.153,53	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/01/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	1.997.153,06	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	335.321,79	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	324.842,99	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	3.989.358,22	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/02/22	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	2.052.556,63	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	775.431,65	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	691.601,20	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	25/03/22	25/03/22	15/03/44	GBS PART	1.999.984,04	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/03/22	25/03/22	15/03/44	GBS PART	3.406.298,86	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/03/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	991.853,05	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	12/04/22	12/04/22	08/04/27	UNIGEL P	809.806,40	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	19/04/22	19/04/22	16/04/29	VERT-10	1.191.003,60	-	-	AAAsf(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/04/22	26/04/22	15/04/24	LIGHT	652.710,26	D	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	2.610.596,94	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.287.931,05	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	12/05/22	12/05/22	15/04/27	BRKA	1.830.138,64	-	A+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	12/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.543.871,93	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	19/05/22	19/05/22	13/05/28	CEA MODA	519.298,02	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/05/22	26/05/22	10/05/27	GUAR	2.437.976,94	-	-	A
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	2.235.234,17	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	562.198,17	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.187.382,85	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	03/03/22	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	2.752.867,35	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/03/22	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	2.562.434,32	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/03/22	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	1.056.100,91	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/03/22	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	3.167.256,96	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/03/22	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	2.535.162,82	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/06/22	06/12/21	15/12/35	TESC	791.811,73	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/06/22	28/04/21	15/03/28	BRISANET	486.661,12	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	449.758,54	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	06/12/21	15/12/35	TESC	496.652,20	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	253.239,08	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	30/09/21	15/09/31	SIMPAR	1.796.778,97	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	08/07/21	15/06/31	VAMOS	862.245,48	brAA+	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	08/07/21	15/06/31	VAMOS	70.346,37	brAA+	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	735.828,33	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	832.072,22	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/06/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	1.219.660,38	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	27/06/22	27/06/22	07/07/24	LAGE	2.246.406,88	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	2.990.674,07	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	12/11/21	15/10/31	VAMOS	1.988.661,10	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	12/11/21	15/10/31	VAMOS	1.490.981,70	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	25/07/22	25/07/22	22/07/27	CM HOSPI	1.621.824,13	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/07/22	10/01/22	10/01/28	AMBIPAR	2.387.897,04	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/07/22	03/05/21	26/04/26	GGSH PAR	2.264.940,50	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	27/07/22	25/03/22	15/03/44	GBS PART	2.733.798,14	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/07/22	28/07/22	18/07/25	1V11	1.669.628,43	brAAA(sf)	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	29/07/22	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	1.518.467,17	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/08/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	1.197,23	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	509.977,99	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	07/04/21	15/03/29	CAGECE	1.444.048,68	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	07/04/21	15/03/29	CAGECE	2.406.035,21	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	1.624.390,76	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	796.659,89	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	23/08/22	23/08/22	15/08/32	PETRJ	5.833.742,56	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/08/22	30/08/22	15/08/29	TRBR	9.051.954,00	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/09/22	02/09/22	02/09/29	AEGEA SA	1.670.666,13	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	27/09/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	51.480,95	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/09/22	28/09/22	28/09/27	B.BRASIL	4.573.656,83	-	AAA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	06/10/22	06/10/22	13/09/32	NTRASSUD	1.681.571,50	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/10/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	35.916,94	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	03/11/22	06/04/21	15/03/29	ANET	2.055.641,98	brA	-	-



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

28/04/2023

Fundo	INFORMAÇÕES DOS ATIVOS					INFORMAÇÕES DE RATING		
	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	03/11/22	15/12/21	15/11/36	ITAPOA T	4.344.827,72	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	08/11/22	08/11/22	27/10/27	CM HOSPI	986.255,54	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/11/22	08/11/22	15/06/42	BRK AMBI	4.531.138,01	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/11/22	02/05/22	15/04/38	RDVE	1.518.514,47	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/11/22	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	1.422.443,09	A	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	11/11/22	11/11/22	15/10/40	RAHOLD	2.766.008,01	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	11/11/22	11/11/22	15/10/40	RAHOLD	10.257.414,51	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	3.751.171,46	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	1.688.593,80	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	1.382.607,00	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.253.783,51	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.526.217,78	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.249.877,64	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	01/12/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	1.570.526,55	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	2.044.436,16	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	2.168.824,63	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	1.581.966,20	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	16/11/20	15/10/36	PAMPASUL	2.201.599,81	brAAA	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/12/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	3.104.458,30	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/12/22	20/12/22	16/12/29	CSMG	1.983.951,69	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	15/12/21	15/11/36	ITAPOA T	2.953.288,39	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	02/05/22	15/04/38	RDVE	1.757.300,61	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	2.951.123,79	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/01/23	26/01/23	20/01/26	CELG	3.150.698,13	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/03/23	26/01/23	20/01/26	BCBF	487.440,71	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	26/01/23	20/01/26	AESTUCAN	1.013.344,42	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	26/01/23	20/01/26	ITAPOA T	3.091.646,02	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	26/01/23	20/01/26	BRV_VDR	7.971.347,53	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	26/01/23	20/01/26	PETRJ	4.155.032,85	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/03/23	26/01/23	20/01/26	PARANAGU	1.006.396,09	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	14/04/23	26/01/23	20/01/26	PARANAGU	712.978,16	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	17/04/23	26/01/23	20/01/26	VERO	2.763.863,59	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/04/23	26/01/23	20/01/26	BRKA	1.086.856,52	-	A+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/04/23	26/01/23	20/01/26	BRKA	30.002,27	-	A+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/04/23	26/01/23	20/01/26	HOLDARAG	1.998.163,88	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	26/01/23	20/01/26	PAMPASUL	1.691.000,21	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	26/01/23	20/01/26	LOCAMERI	2.112.037,61	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	26/01/23	20/01/26	MG050	3.227.378,85	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	26/01/23	20/01/26	BRK AMBI	1.127.182,69	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	26/01/23	20/01/26	VAMOS	1.684.293,04	brAA+	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	-	FIDC VERDECARD SN3	2.142.002,05	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	-	FIDC CREDZ SN4	6.943,20	-	-	AAAsf(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	-	FIDC CREDZ SN6	2.516.653,11	brAA (sf)	-	A+sf(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	FIDC VERDECARD SN5	413.101,66	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	FIDC VERDECARD SN6	1.416.899,12	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	FIDC VERDECARD SN8	1.515.679,85	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	RB CAP CREDIT AL SN3	755.870,38	brAA-(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	BR ELETRO FIDC S1	1.791.018,71	-	-	Aasf(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	INSS CONS PDL I FIDC	1.729.775,49	-	-	AAAsf(bra)

Observação: Em abril de 2023, três ativos da carteira de crédito da EMBRAER PREV sofreram rebaixamentos de suas classificações de risco: o rating de LIGHB4, LIGHD3 e LIGHTD7 (Light SESA) foi revisado pela S&P de brCCC- para S&P D, portanto, abaixo da classificação mínima de crédito estabelecida pela Política de Investimentos do Plano Embraer Prev. Os gestores dos fundos de investimento em que estão alocados esses ativos acompanham atentamente a evolução dessas classificações, sob o monitoramento do administrador desses fundos e da Entidade, visando ao seu enquadramento aos limites estabelecidos na Política de Investimento.



4. RISCO OPERACIONAL

Para acompanhamento do risco operacional, são monitorados o fluxo de informações, processos e movimentações nas carteiras e/ou fundos exclusivos da Entidade, sempre que ocorram, para atestar que os controles implementados estejam sendo eficientes.

5. RISCO DE LIQUIDEZ

Para acompanhamento do risco de liquidez, a EMBRAER PREV realiza, anualmente, estudo de *LDI (Liability Driven Investments)*, elaborado pelo atuário do Plano Embraer Prev, em conjunto com o consultor de investimentos da Entidade, que avalia o comprometimento do Patrimônio de Cobertura, no que diz respeito à sua liquidez, quando confrontado com o respectivo fluxo de receitas e despesas previdenciais, conforme exigido pela Resolução CGPC Nº 04/2002. Semestralmente, com base no resultado da campanha de alteração de perfis de investimento, o atuário do Plano realiza ainda, estudo de fluxo de liquidez para atestar que a estratégia da carteira de investimento vigente esteja aderente ao estudo de *LDI* anual.

6. RISCO LEGAL

Para acompanhamento do risco legal, a Entidade controlará diariamente seus investimentos, através dos relatórios elaborados pelo administrador dos fundos e/ou carteiras da EMBRAER PREV, para que estes estejam enquadrados às determinações legais e aos limites estabelecidos na Política de Investimento dos Planos sob sua administração. Os seguintes relatórios elaborados pelo administrador são utilizados pela EMBRAER PREV para o controle do risco legal:

6.1. Relatório de Enquadramentos Legais



Relatório Resumo de Enquadramento

Patrimônio Líquido da Fundação **4.317.543.187,62**

Tópico do Enquadramento	Limite	Aplicação Atual	Valor Limite	% Aplicado	Status
% do Segmento RF/PL PLANO	100,00%	3.737.111.777,35	4.317.543.187,62	86,56%	Enquadrado
% do PL em Títulos de Emissão do Tesouro Nacional e/ou do BAC	100,00%	3.059.334.709,91	4.317.543.187,62	70,86%	Enquadrado
% do PL em Títulos RF1, exceto títulos do Tesouro Nacional	80,00%	677.777.067,44	3.454.034.601,57	15,70%	Enquadrado
% do PL em FIDC	20,00%	Verificar Rel. de Diversificação de FIDC's	863.508.650,39	0,00%	Enquadrado
% do PL em uma mesma pessoa jurídica não-financeira	10,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Não Financ.	431.754.325,20	0,00%	Enquadrado
% do PL em Instituições Financeiras	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Financ.	1.079.385.796,91	0,00%	Enquadrado
% de uma mesma Série de Debêntures	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Debêntures	1.079.385.796,91	0,00%	Enquadrado
% do PL em RV	70,00%	478.397.526,86	3.022.280.179,86	11,08%	Enquadrado
% do capital votante de uma empresa	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação RV	1.079.385.796,91	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Imobiliários	20,00%	68.361.177,73	863.508.650,39	1,58%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Empréstimos	15,00%	26.060.506,11	647.631.503,88	0,60%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Estruturados	20,00%	0,00	863.508.650,39	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos no Exterior	10,00%	0,00	431.754.325,20	0,00%	Enquadrado

(*) O Relatório Completo de Enquadramentos Legais está disponível no portal da EMBRAER PREV (www.embraerprev.com.br)

6.2. Relatório de Túnel de Preços

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV
Período: 03 DE ABRIL DE 2023 À 28 DE ABRIL DE 2023



FIM EMB I A

DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	FONTE ANBIMA					FORA DO TÚNEL
							TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	
05/04/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/09/2023	Compra	0,0213%	0,0183%	-0,0230%	0,0567%	0,0030%	NÃO

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV
Período: 03 DE ABRIL DE 2023 À 28 DE ABRIL DE 2023



FIM EMB II A

DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	FONTE ANBIMA					FORA DO TÚNEL
							TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	
03/04/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2025	Compra	5,7990%	5,7501%	5,5255%	6,2155%	0,0489%	NÃO
03/04/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2026	Compra	5,7490%	5,7297%	5,4708%	6,0735%	0,0193%	NÃO
03/04/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2028	Venda	5,9210%	5,8900%	5,6129%	6,1682%	0,0310%	NÃO
03/04/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2028	Venda	5,9210%	5,8900%	5,6129%	6,1682%	0,0310%	NÃO
18/04/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2026	Compra	5,5427%	5,5825%	5,3029%	5,8828%	-0,0398%	NÃO
19/04/2023	FIM EMB II A	BNP	LIQUIDEZ	NTN-B	15/05/2025	Compra	5,7690%	5,8400%	5,5046%	6,1975%	-0,0710%	NÃO
19/04/2023	FIM EMB II A	BNP	XP CCTVM	NTN-B	15/08/2028	Venda	5,7410%	5,8543%	5,4264%	5,9834%	-0,1133%	NÃO
19/04/2023	FIM EMB II A	BNP	XP CCTVM	NTN-B	15/08/2028	Venda	5,7410%	5,8543%	5,4264%	5,9834%	-0,1133%	NÃO
19/04/2023	FIM EMB II A	BNP	XP CCTVM	NTN-B	15/08/2028	Venda	5,7410%	5,8543%	5,4264%	5,9834%	-0,1133%	NÃO
19/04/2023	FIM EMB II A	BNP	XP CCTVM	NTN-B	15/08/2028	Venda	5,7410%	5,8543%	5,4264%	5,9834%	-0,1133%	NÃO

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV
Período: 03 DE ABRIL DE 2023 À 28 DE ABRIL DE 2023



FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI

DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	FONTE ANBIMA					FORA DO TÚNEL
							TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	
12/04/2023	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	BNP	RENASCEN	LFT	01/09/2023	Compra	0,0153%	0,0143%	-0,0324%	0,0525%	0,0010%	NÃO



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO
E CONTROLE DE RISCO - ABRIL DE 2023



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 03 DE ABRIL DE 2023 À 28 DE ABRIL DE 2023

DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
03-04-23	FIA RVA EMB II	Venda	BBD4	12,88	87.300,00	1.124.192,50	12,78	12,86	13,22	73.942,00
03-04-23	FIA RVA EMB II	Venda	INTB3	22,92	39.600,00	907.632,00	22,48	22,81	23,25	5.879,00
03-04-23	FIA RVA EMB II	Compra	PRI03	32,44	13.300,00	431.400,51	32,15	32,55	33,24	60.216,00
03-04-23	FIA RVA EMB II	Compra	RECV3	20,66	30.500,00	630.238,03	20,42	20,84	21,51	16.172,00
03-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	17,14	5.000,00	85.683,19	17,02	17,21	17,68	16.556,00
03-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	17,16	3.900,00	66.916,66	17,02	17,21	17,68	16.556,00
03-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	17,18	200,00	3.435,19	17,02	17,21	17,68	16.556,00
03-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	ARZ23	61,99	6.200,00	384.341,38	59,98	61,58	64,10	11.228,00
03-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	14,85	700,00	10.392,91	14,75	14,91	15,51	28.495,00
03-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	14,54	8.900,00	129.366,94	14,36	14,51	14,79	16.020,00
03-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	38,49	500,00	19.243,65	38,21	38,47	39,28	24.971,00
03-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	19,57	2.400,00	46.958,31	19,37	19,57	19,72	19.290,00
03-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	32,83	1.900,00	62.383,05	32,68	32,91	33,49	17.552,00
03-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	10,20	3.600,00	36.705,47	10,12	10,25	10,41	14.889,00
03-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	26,85	3.400,00	91.277,00	26,31	26,77	27,03	23.711,00
03-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	2,42	4.000,00	9.684,00	2,36	2,46	2,68	79.888,00
03-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGT11	18,52	2.600,00	48.147,49	18,39	18,60	19,29	17.278,00
03-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	23,98	2.100,00	50.366,18	23,81	24,02	24,70	56.174,00
03-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	LTRE3	15,25	11.200,00	170.845,26	15,18	15,46	16,63	67.591,00
03-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	LWSA3	4,71	1.300,00	6.120,00	4,66	4,75	4,93	18.789,00
03-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	5,99	1.500,00	8.978,38	5,96	6,02	6,21	9.309,00
03-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	32,40	400,00	12.958,00	32,15	32,55	33,24	60.216,00
03-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	RAIZ4	2,84	25.500,00	72.525,71	2,81	2,85	2,91	27.994,00
03-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	20,82	1.000,00	20.817,50	20,70	20,89	21,42	7.636,00
03-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	20,66	3.800,00	78.502,40	20,42	20,84	21,51	16.172,00
03-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	51,90	1.000,00	51.899,79	51,70	52,11	53,30	31.562,00
03-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	7,60	4.400,00	33.426,23	7,30	7,59	8,06	23.313,00
03-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	7,61	2.600,00	19.793,24	7,30	7,59	8,06	23.313,00
03-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	7,65	7.200,00	55.106,28	7,30	7,59	8,06	23.313,00
03-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	14,03	2.000,00	28.059,33	13,87	14,04	14,50	17.097,00
03-04-23	FIA RVA EMB IV	Venda	HAPV3	2,43	29.467,00	71.738,20	2,36	2,46	2,68	79.888,00
03-04-23	FIA RVA EMB IV	Venda	HAPV3	2,45	36.639,00	89.731,33	2,36	2,46	2,68	79.888,00
03-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	SUZB3	42,44	1.248,00	52.962,62	41,41	42,16	42,86	20.712,00
03-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	SUZB3	42,42	1.155,00	48.995,10	41,41	42,16	42,86	20.712,00
03-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	SUZB3	42,21	1.562,00	65.930,41	41,41	42,16	42,86	20.712,00
03-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	SUZB3	42,72	128,00	5.468,35	41,41	42,16	42,86	20.712,00
04-04-23	FIA RVA EMB II	Venda	ITUB4	24,28	9.300,00	225.759,00	24,12	24,49	24,71	33.222,00
04-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	14,74	57.400,00	846.315,95	13,11	13,96	14,93	105.674,00
04-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	ALSO3	17,57	2.500,00	43.914,76	17,30	17,60	17,94	13.366,00
04-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	ARZ23	63,30	400,00	25.318,59	62,35	63,02	63,78	8.477,00
04-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	ARZ23	62,99	100,00	6.298,77	62,35	63,02	63,78	8.477,00
04-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	ARZ23	63,19	200,00	12.638,07	62,35	63,02	63,78	8.477,00
04-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	14,72	700,00	10.300,79	14,56	14,78	15,10	35.930,00
04-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	14,55	3.000,00	43.654,64	14,36	14,49	14,68	12.479,00
04-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	39,11	600,00	23.468,19	38,73	39,17	39,48	18.029,00
04-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	20,31	2.700,00	54.843,58	19,62	20,20	20,46	26.244,00
04-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	33,39	2.300,00	76.806,73	32,86	33,36	33,68	15.328,00
04-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	10,33	4.400,00	45.456,01	10,24	10,33	10,53	19.082,00
04-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	27,45	3.700,00	101.569,14	26,82	27,50	27,76	16.279,00
04-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	27,59	4.700,00	129.659,07	26,82	27,50	27,76	16.279,00
04-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	2,51	4.800,00	12.051,80	2,42	2,52	2,65	53.760,00
04-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	19,09	3.200,00	61.079,26	18,62	19,03	19,25	13.871,00
04-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	24,60	2.500,00	61.492,40	24,12	24,49	24,71	33.222,00
04-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	LTRE3	15,54	4.400,00	68.363,30	15,39	15,59	15,94	35.778,00
04-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	LWSA3	4,78	400,00	1.911,67	4,65	4,76	4,84	10.178,00
04-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	14,51	3.700,00	53.687,00	13,11	13,96	14,93	105.674,00
04-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	14,52	700,00	10.161,42	13,11	13,96	14,93	105.674,00
04-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	PETZ3	6,02	3.000,00	18.058,08	5,95	6,03	6,17	8.579,00
04-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	33,53	500,00	16.766,08	32,86	33,73	34,53	73.238,00
04-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	RAIZ4	2,84	13.200,00	37.474,25	2,79	2,83	2,88	18.126,00
04-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	RAIZ4	2,83	16.700,00	47.261,00	2,79	2,83	2,88	18.126,00
04-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	RAIZ4	2,85	24.200,00	69.035,14	2,79	2,83	2,88	18.126,00
04-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	RDOR3	21,79	1.200,00	26.151,00	20,99	21,63	21,92	18.091,00
04-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	20,79	3.600,00	74.835,71	20,43	20,79	21,25	13.495,00
04-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	20,74	1.500,00	31.111,08	20,43	20,79	21,25	13.495,00
04-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	53,38	1.200,00	64.052,08	52,30	53,36	54,15	28.726,00
04-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	7,63	3.100,00	23.640,93	7,47	7,65	8,00	28.049,00
04-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	7,61	6.100,00	46.430,70	7,47	7,65	8,00	28.049,00
04-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	42,82	400,00	17.127,82	42,35	42,96	43,36	21.046,00
04-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	14,22	2.400,00	34.120,93	13,98	14,18	14,34	15.295,00
04-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	14,16	4.300,00	60.872,58	13,98	14,18	14,34	15.295,00
04-04-23	FIA RVA EMB IV	Venda	EQLT3	27,42	4.064,00	111.450,10	26,82	27,50	27,76	16.279,00
04-04-23	FIA RVA EMB IV	Venda	EQLT3	27,70	297,00	8.225,48	26,82	27,50	27,76	16.279,00
04-04-23	FIA RVA EMB IV	Venda	HAPV3	2,53	11.861,00	29.958,09	2,42	2,52	2,65	53.760,00
04-04-23	FIA RVA EMB IV	Venda	HAPV3	2,51	20.093,00	50.462,61	2,42	2,52	2,65	53.760,00
04-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	14,09	1.887,00	26.590,13	13,98	14,18	14,34	15.295,00
04-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	14,21	2.642,00	37.544,54	13,98	14,18	14,34	15.295,00
04-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	14,22	3.774,00	53.663,68	13,98	14,18	14,34	15.295,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ALSO3	17,56	91,00	1.597,90	17,30	17,60	17,94	13.366,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ARZ23	62,95	38,00	2.392,16	62,35	63,02	63,78	8.477,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ASAI3	14,67	12.765,00	187.263,76	14,56	14,78	15,10	35.930,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	AZUL4	11,20	61,00	683,20	11,21	11,44	11,90	10.497,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	B3SA3	10,83	215,00	2.328,45	10,67	10,82	10,96	41.088,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BBAS3	39,29	49,00	1.925,33	38,73	39,17	39,48	18.029,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBD4	13,11	318,00	4.168,62	12,88	13,06	13,18	24.600,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBSE3	33,16	53,00	1.757,30	32,20	33,07	33,35	15.592,00



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO
E CONTROLE DE RISCO - ABRIL DE 2023



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 03 DE ABRIL DE 2023 À 28 DE ABRIL DE 2023

DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BPAC11	20,22	45,00	910,00	19,62	20,20	20,46	26.244,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRFS3	6,13	88,00	539,09	5,86	6,04	6,17	17.716,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CASH3	0,95	2.260,00	2.147,00	0,94	0,96	0,99	5.334,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CCRO3	12,70	97,00	1.232,35	12,45	12,71	12,92	16.641,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CIEL3	4,71	225,00	1.059,87	4,67	4,73	4,80	26.455,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CMIG4	11,67	78,00	910,59	11,56	11,65	11,77	13.888,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CMIN3	4,61	129,00	594,74	4,54	4,60	4,70	12.156,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CPFE3	32,42	56,00	1.815,68	31,74	32,26	32,47	6.196,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CPLE6	7,15	108,00	772,16	6,94	7,07	7,15	15.750,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CRFB3	12,06	59,00	711,54	11,93	12,05	12,26	7.304,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CSAN3	14,99	47,00	704,53	14,96	15,10	15,28	19.263,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CYRE3	13,97	86,00	1.201,20	13,56	13,89	14,05	9.581,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	EGIE3	40,23	20,00	804,56	39,46	40,05	40,40	6.217,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ELET3	33,35	91,00	3.035,06	32,86	33,36	33,68	15.328,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ELET6	36,31	67,00	2.432,51	35,79	36,27	36,60	4.906,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ENBR3	22,29	38,00	847,18	22,19	22,29	22,37	6.666,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ENEV3	10,35	55,00	569,47	10,24	10,33	10,53	19.082,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ENGI11	41,33	14,00	578,57	39,91	40,97	41,35	8.775,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	EQTL3	27,60	101,00	2.787,60	26,82	27,50	27,76	16.279,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	FLRY3	14,18	42,00	595,38	14,07	14,21	14,50	7.659,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	GGBR4	24,77	126,00	3.120,52	24,78	24,98	25,50	19.622,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	GOAU4	11,69	118,00	1.379,46	11,67	11,74	11,96	13.076,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	HAPV3	2,48	212,00	525,88	2,42	2,52	2,65	53.760,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	HYPE3	37,89	35,00	1.326,07	36,60	37,33	37,94	26.780,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ITSA4	8,15	189,00	1.540,43	8,08	8,16	8,23	19.055,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ITUB4	24,51	190,00	4.656,98	24,12	24,49	24,71	33.222,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	JBSS3	17,44	145,00	2.528,80	17,33	17,51	17,80	17.301,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	KLBN11	18,32	95,00	1.740,37	18,21	18,35	18,53	9.074,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	LREN3	15,40	56,00	862,20	15,39	15,59	15,94	35.778,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	MULT3	25,05	108,00	2.705,40	24,38	24,91	25,19	14.226,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	NTCO3	13,12	50,00	655,98	13,11	13,96	14,93	105.674,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PETR3	27,37	115,00	3.147,92	27,24	27,52	27,99	15.695,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PETR4	24,27	95,00	2.305,65	24,10	24,36	24,76	61.263,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PRIQ3	33,85	45,00	1.523,07	32,86	33,73	34,53	73.238,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RADL3	24,53	74,00	1.814,92	23,81	24,39	24,54	20.026,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RDOR3	21,84	87,00	1.899,71	20,99	21,63	21,92	18.091,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RENT3	53,20	139,00	7.394,77	52,30	53,36	54,15	28.729,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SANB11	26,59	22,00	585,02	26,37	26,55	26,71	5.194,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	SLCE3	46,11	34,00	1.567,90	45,25	46,00	46,43	4.290,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SUZB3	42,35	57,00	2.413,69	42,35	42,96	43,36	21.046,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	TAEI11	35,18	84,00	2.955,30	34,60	35,00	35,29	9.233,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	TIMS3	12,77	66,00	842,64	12,34	12,67	12,80	11.951,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	UGPA3	14,20	149,00	2.115,81	14,01	14,21	14,36	15.627,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	USIM5	7,16	75,00	536,94	7,13	7,18	7,27	12.496,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VALE3	78,04	158,00	12.330,24	77,75	78,66	80,18	58.341,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VBBR3	14,22	101,00	1.436,30	13,98	14,18	14,34	15.295,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VIVT3	39,00	47,00	1.833,00	38,22	38,88	39,18	6.499,00
04-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	WEGE3	39,64	65,00	2.576,30	39,25	39,61	39,94	20.026,00
05-04-23	FIA RVA EMB II	Venda	EQTL3	27,42	23.200,00	636.150,29	26,95	27,28	27,67	19.972,00
05-04-23	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	76,66	10.300,00	789.625,00	75,90	76,60	77,76	58.760,00
05-04-23	FIA RVA EMB II	Venda	WEGE3	38,80	10.500,00	407.430,23	38,46	39,02	39,93	20.560,00
05-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	ARZ3	59,99	1.600,00	95.982,65	59,29	60,34	63,09	10.257,00
05-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	13,77	7.300,00	100.553,31	13,35	13,77	14,80	41.774,00
05-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	13,72	7.600,00	104.272,00	13,35	13,77	14,80	41.774,00
05-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	10,30	12.200,00	125.631,13	10,15	10,35	10,47	13.544,00
05-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	10,30	2.500,00	25.756,25	10,15	10,35	10,47	13.544,00
05-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	27,39	900,00	24.651,00	26,95	27,28	27,67	19.972,00
05-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	27,21	4.500,00	122.437,51	26,95	27,28	27,67	19.972,00
05-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGT11	19,42	2.500,00	48.550,35	18,73	19,18	19,50	17.842,00
05-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGT11	19,20	4.100,00	78.719,29	18,73	19,18	19,50	17.842,00
05-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	15,14	2.300,00	34.822,00	14,85	15,07	15,49	45.598,00
05-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	15,11	5.900,00	89.143,38	14,85	15,07	15,49	45.598,00
05-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	15,23	200,00	3.046,88	14,85	15,07	15,49	45.598,00
05-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	LWSA3	4,70	400,00	1.880,60	4,65	4,72	4,85	14.057,00
05-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	LWSA3	4,70	1.300,00	6.110,00	4,65	4,72	4,85	14.057,00
05-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	12,11	10.600,00	128.317,11	11,78	12,13	12,75	70.477,00
05-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	12,00	2.300,00	27.592,75	11,78	12,13	12,75	70.477,00
05-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	RAIZ4	2,79	1.900,00	5.309,43	2,75	2,78	2,86	21.644,00
05-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	RAIZ4	2,80	3.200,00	8.960,00	2,75	2,78	2,86	21.644,00
05-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	RAIZ4	2,78	12.100,00	33.652,48	2,75	2,78	2,86	21.644,00
05-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	RAIZ4	2,80	2.200,00	6.159,44	2,75	2,78	2,86	21.644,00
05-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	RAIZ4	2,78	20.200,00	56.246,62	2,75	2,78	2,86	21.644,00
05-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	20,70	400,00	8.281,31	20,13	20,65	20,99	11.731,00
05-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	20,44	1.900,00	38.835,36	20,13	20,65	20,99	11.731,00
05-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	7,29	2.300,00	16.767,27	7,11	7,37	7,58	21.696,00
05-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	40,70	1.200,00	48.841,50	40,36	40,89	42,62	30.840,00
05-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	14,19	400,00	5.676,74	13,84	14,07	14,28	13.250,00
05-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	14,00	1.900,00	26.600,00	13,84	14,07	14,28	13.250,00
05-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	14,10	2.200,00	31.024,08	13,84	14,07	14,28	13.250,00
05-04-23	FIA RVA EMB IV	Venda	EQTL3	27,23	13.335,00	363.157,68	26,95	27,28	27,67	19.972,00
05-04-23	FIA RVA EMB IV	Venda	EQTL3	27,23	1.161,00	31.617,56	26,95	27,28	27,67	19.972,00
05-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	14,22	888,00	12.624,10	13,84	14,07	14,28	13.250,00
05-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	14,13	3.809,00	53.839,45	13,84	14,07	14,28	13.250,00
05-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	14,05	1.375,00	19.318,75	13,84	14,07	14,28	13.250,00
05-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	14,10	2.001,00	28.207,30	13,84	14,07	14,28	13.250,00
05-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	14,05	11.831,00	166.282,32	13,84	14,07	14,28	13.250,00



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO
E CONTROLE DE RISCO - ABRIL DE 2023



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 03 DE ABRIL DE 2023 À 28 DE ABRIL DE 2023

DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
06-04-23	FIA RVA EMB II	Compra	CSMG3	16,50	13.200,00	217.739,88	16,20	16,43	16,61	7.579,00
06-04-23	FIA RVA EMB II	Compra	ECOR3	5,43	62.900,00	341.391,08	5,31	5,42	5,52	10.475,00
06-04-23	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	41,85	8.500,00	355.684,50	40,77	41,80	42,16	11.405,00
06-04-23	FIA RVA EMB II	Compra	MGLU3	3,34	100.100,00	334.456,41	3,25	3,34	3,41	17.931,00
06-04-23	FIA RVA EMB II	Compra	RAI13	18,70	15.700,00	293.553,00	18,50	18,65	18,80	15.931,00
06-04-23	FIA RVA EMB II	Venda	TOTS3	27,50	37.400,00	1.028.399,79	27,21	27,48	28,44	31.461,00
06-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	ARZZ3	62,41	500,00	31.203,33	60,02	61,57	62,96	8.457,00
06-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	ARZZ3	62,40	600,00	37.440,00	60,02	61,57	62,96	8.457,00
06-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	13,58	3.400,00	46.161,94	13,47	13,70	14,06	44.545,00
06-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	14,77	400,00	5.909,50	14,65	14,75	14,89	12.890,00
06-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	10,61	6.400,00	67.911,35	10,36	10,64	10,81	12.725,00
06-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	10,62	900,00	9.558,00	10,36	10,64	10,81	12.725,00
06-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENJU3	0,84	7.900,00	6.600,09	0,81	0,84	0,88	1.715,00
06-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	27,67	11.100,00	307.126,91	27,06	27,61	27,83	30.313,00
06-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	27,59	1.300,00	35.866,21	27,06	27,61	27,83	30.313,00
06-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	LENR3	15,52	4.000,00	62.084,58	14,92	15,36	15,73	44.390,00
06-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	LWSA3	4,72	6.600,00	31.162,51	4,61	4,71	4,79	11.421,00
06-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	11,04	22.700,00	250.669,03	10,84	11,31	12,29	77.415,00
06-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	11,09	4.200,00	46.583,53	10,84	11,31	12,29	77.415,00
06-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	PETZ3	5,65	2.800,00	15.815,05	5,52	5,63	5,74	6.841,00
06-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	RAIZ4	2,77	30.200,00	83.654,00	2,75	2,77	2,82	11.380,00
06-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	RAIZ4	2,79	3.800,00	10.583,00	2,75	2,77	2,82	11.380,00
06-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	20,70	700,00	14.490,00	20,35	20,60	20,96	12.086,00
06-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	20,52	800,00	16.418,31	20,35	20,60	20,96	12.086,00
06-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	20,55	800,00	16.440,00	20,35	20,60	20,96	12.086,00
06-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	40,50	1.600,00	64.797,00	40,26	40,67	41,41	16.858,00
06-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	14,16	3.300,00	46.732,77	14,06	14,16	14,41	12.968,00
06-04-23	FIA RVA EMB IV	Venda	EQTL3	27,67	2.885,00	79.822,79	27,06	27,61	27,83	30.313,00
06-04-23	FIA RVA EMB IV	Venda	SUZB3	40,60	2.837,00	115.176,79	40,26	40,67	41,41	16.858,00
06-04-23	FIA RVA EMB IV	Venda	SUZB3	40,52	1.256,00	50.889,18	40,26	40,67	41,41	16.858,00
06-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	14,18	3.298,00	46.765,64	14,06	14,16	14,41	12.968,00
06-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	14,15	5.639,00	79.802,67	14,06	14,16	14,41	12.968,00
06-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	14,18	7.946,00	112.646,19	14,06	14,16	14,41	12.968,00
10-04-23	FIA RVA EMB II	Compra	BBDC4	13,20	32.100,00	423.654,00	13,04	13,18	13,25	26.446,00
10-04-23	FIA RVA EMB II	Compra	BPAC11	20,90	10.700,00	223.662,84	20,34	20,72	21,04	17.792,00
10-04-23	FIA RVA EMB II	Venda	CIEL3	4,68	174.100,00	814.089,15	4,66	4,69	4,74	9.255,00
10-04-23	FIA RVA EMB II	Compra	CPL6	7,13	143.700,00	1.023.890,58	7,07	7,13	7,20	12.112,00
10-04-23	FIA RVA EMB II	Venda	EGIE3	39,89	16.400,00	654.172,45	39,63	39,92	40,28	6.325,00
10-04-23	FIA RVA EMB II	Compra	PETR3	27,69	13.000,00	360.010,00	27,17	27,64	27,82	12.992,00
10-04-23	FIA RVA EMB II	Compra	RECV3	21,09	19.100,00	402.767,00	20,46	20,99	21,21	10.830,00
10-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	ALSO3	17,79	900,00	16.014,00	17,67	17,81	18,20	9.847,00
10-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	ARZZ3	63,48	1.500,00	95.225,23	62,26	63,44	63,98	6.667,00
10-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	13,80	4.600,00	63.502,58	13,56	13,78	13,96	24.349,00
10-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	15,01	800,00	12.008,00	14,63	14,97	15,13	7.740,00
10-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	20,93	1.000,00	20.926,00	20,34	20,72	21,04	17.792,00
10-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	33,23	700,00	23.259,00	32,76	33,16	33,36	14.566,00
10-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	10,90	5.800,00	63.218,97	10,67	10,90	11,03	17.794,00
10-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	10,89	1.700,00	18.511,00	10,67	10,90	11,03	17.794,00
10-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENJU3	0,85	500,00	425,00	0,81	0,83	0,86	2.078,00
10-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	27,65	1.300,00	35.941,27	27,43	27,71	27,94	14.259,00
10-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	27,68	1.500,00	41.520,77	27,43	27,71	27,94	14.259,00
10-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	19,22	1.100,00	21.140,00	19,07	19,20	19,59	8.688,00
10-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	24,65	900,00	22.188,00	24,51	24,65	24,75	24.384,00
10-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	LENR3	15,67	2.100,00	32.898,07	15,43	15,64	15,99	24.758,00
10-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	LWSA3	4,82	2.000,00	9.633,07	4,73	4,89	5,01	9.448,00
10-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	NINJ3	2,19	200,00	438,00	2,13	2,16	2,21	407,00
10-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	PETZ3	5,54	5.200,00	28.806,79	5,50	5,57	5,80	16.367,00
10-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	RAIZ4	2,79	32.700,00	91.395,20	2,78	2,80	2,84	12.559,00
10-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	21,90	2.700,00	59.138,67	21,37	21,72	22,51	11.024,00
10-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	21,04	900,00	18.938,00	20,46	20,99	21,21	10.830,00
10-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	21,01	2.100,00	44.122,82	20,46	20,99	21,21	10.830,00
10-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	52,15	400,00	20.858,00	51,72	52,18	52,99	16.300,00
10-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	7,71	1.200,00	9.250,00	7,54	7,68	7,81	7.934,00
10-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	41,06	600,00	24.633,00	39,90	41,05	41,56	17.608,00
10-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	14,03	900,00	12.631,00	13,90	14,03	14,33	13.629,00
10-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	14,07	3.100,00	43.604,65	13,90	14,03	14,33	13.629,00
10-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	5,45	2.244,00	12.229,92	5,31	5,41	5,49	7.224,00
10-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	5,44	26.586,00	144.531,14	5,31	5,41	5,49	7.224,00
10-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	14,51	11.000,00	159.653,00	14,39	14,51	14,61	19.485,00
10-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	14,07	10.100,00	142.091,00	13,90	14,03	14,33	13.629,00
10-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	14,09	1.200,00	16.904,00	13,90	14,03	14,33	13.629,00
11-04-23	FIA RVA EMB II	Compra	B3SA3	11,56	13.400,00	154.879,04	11,01	11,43	11,66	62.710,00
11-04-23	FIA RVA EMB II	Compra	CPL6	7,46	43.700,00	326.178,67	7,31	7,46	7,63	23.415,00
11-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	14,59	4.900,00	71.502,48	14,00	14,59	14,84	45.996,00
11-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	14,58	1.900,00	27.702,00	14,00	14,59	14,84	45.996,00
11-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	14,59	1.900,00	27.721,00	14,00	14,59	14,84	45.996,00
11-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,28	1.300,00	19.864,00	14,95	15,09	15,34	6.830,00
11-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,09	1.800,00	27.155,77	14,95	15,09	15,34	6.830,00
11-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	22,50	3.200,00	72.000,00	21,20	22,36	22,85	58.203,00
11-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	22,25	2.900,00	64.516,73	21,20	22,36	22,85	58.203,00
11-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	22,40	11.400,00	255.342,99	21,20	22,36	22,85	58.203,00
11-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENJU3	0,85	19.000,00	16.150,00	0,81	0,84	0,88	3.398,00
11-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	28,32	1.100,00	31.150,53	27,90	28,29	28,61	27.264,00
11-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	2,56	36.900,00	94.420,79	2,38	2,55	2,68	39.971,00
11-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	19,89	2.400,00	47.724,50	19,30	19,88	20,28	24.451,00
11-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	LENR3	16,77	11.200,00	187.854,80	15,85	16,76	17,22	82.352,00



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO
E CONTROLE DE RISCO - ABRIL DE 2023



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 03 DE ABRIL DE 2023 À 28 DE ABRIL DE 2023

DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
11-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	35,71	900,00	32.142,63	34,84	35,48	35,85	36.124,00
11-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	22,96	2.400,00	55.104,00	21,87	22,89	23,36	22.663,00
11-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	22,95	8.600,00	197.364,31	21,87	22,89	23,36	22.663,00
11-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	21,47	2.300,00	49.379,93	21,01	21,35	21,60	13.349,00
11-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	55,85	3.300,00	184.307,73	53,31	55,79	57,10	58.957,00
11-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	54,72	1.000,00	54.720,48	53,31	55,79	57,10	58.957,00
11-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	8,30	20.900,00	173.514,06	7,81	8,31	8,59	27.540,00
11-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	14,54	10.900,00	158.450,75	14,06	14,52	14,67	19.782,00
11-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	7,85	5.900,00	46.293,26	7,40	7,82	8,00	14.577,00
11-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	CXSE3	9,46	5.957,00	56.360,37	9,31	9,43	9,59	9.105,00
11-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	5,87	14.100,00	82.771,80	5,42	5,81	5,93	11.247,00
12-04-23	FIA RVA EMB II	Compra	ELET3	35,02	14.600,00	511.253,00	34,28	35,33	35,87	50.759,00
12-04-23	FIA RVA EMB II	Compra	ELET3	35,10	15.900,00	558.080,00	34,28	35,33	35,87	50.759,00
12-04-23	FIA RVA EMB II	Venda	SUZB3	42,12	21.200,00	892.912,62	41,96	42,37	43,00	27.240,00
12-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	8,21	2.193,00	18.004,09	8,17	8,27	8,48	24.024,00
12-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	18,63	2.600,00	48.443,36	18,33	18,66	18,99	20.429,00
12-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	ARZZ3	69,47	489,00	33.971,55	68,91	69,96	70,91	13.119,00
12-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	14,45	1.095,00	15.827,07	14,34	14,56	14,99	46.384,00
12-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBA53	42,90	9.416,00	403.976,02	40,01	42,31	43,25	110.923,00
12-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	23,27	20.478,00	476.544,20	22,55	23,27	23,74	54.545,00
12-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	35,42	4.783,00	169.435,81	34,28	35,33	35,87	50.759,00
12-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	11,53	5.400,00	62.264,23	11,27	11,49	11,68	27.702,00
12-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	28,55	5.400,00	154.155,41	28,00	28,57	28,97	32.599,00
12-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	2,71	11.442,00	30.974,20	2,60	2,70	2,80	77.806,00
12-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGT11	20,30	3.200,00	64.970,06	19,90	20,39	20,78	26.120,00
12-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	25,79	7.100,00	183.119,44	25,37	25,73	26,02	65.434,00
12-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	25,77	5.354,00	137.950,50	25,37	25,73	26,02	65.434,00
12-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	17,65	11.800,00	208.311,71	17,15	17,51	18,00	66.900,00
12-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	LWSA3	5,44	2.339,00	12.733,78	5,28	5,42	5,55	16.749,00
12-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	11,79	7.000,00	82.552,06	11,39	11,75	12,15	41.481,00
12-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	11,80	2.378,00	28.055,97	11,39	11,75	12,15	41.481,00
12-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	PETZ3	6,23	7.417,00	46.210,11	6,06	6,24	6,40	17.975,00
12-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	36,49	900,00	32.844,55	35,92	36,49	37,09	35.974,00
12-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	36,61	500,00	18.306,04	35,92	36,49	37,09	35.974,00
12-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	24,02	3.800,00	91.262,13	23,28	24,07	24,79	27.783,00
12-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	22,19	700,00	15.533,00	21,51	22,04	22,39	15.673,00
12-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	22,10	2.977,00	65.781,36	21,51	22,04	22,39	15.673,00
12-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	21,92	1.500,00	32.879,77	21,51	22,04	22,39	15.673,00
12-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	58,63	5.500,00	322.440,83	56,93	58,41	60,18	68.676,00
12-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	14,31	1.300,00	18.608,41	14,08	14,38	14,78	6.750,00
12-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	14,35	1.500,00	21.531,40	14,08	14,38	14,78	6.750,00
12-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	14,30	5.900,00	84.372,45	14,08	14,38	14,78	6.750,00
12-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	8,54	12.300,00	105.085,04	8,37	8,54	8,78	25.454,00
12-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	42,34	4.131,00	174.891,28	41,96	42,37	43,00	27.240,00
12-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	14,67	4.962,00	72.793,04	14,43	14,67	15,00	22.713,00
12-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	8,18	2.964,00	24.238,18	7,97	8,15	8,34	11.241,00
12-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	CXSE3	10,17	78,00	793,31	9,51	9,89	10,19	12.775,00
13-04-23	FIA RVA EMB II	Compra	CPFE3	33,63	6.000,00	201.780,00	33,31	33,53	33,74	6.462,00
13-04-23	FIA RVA EMB II	Compra	EQLT3	28,76	9.200,00	264.592,00	28,44	28,69	28,88	24.180,00
13-04-23	FIA RVA EMB II	Venda	HYPE3	37,65	13.300,00	500.745,00	37,22	38,06	38,87	34.471,00
13-04-23	FIA RVA EMB II	Venda	LREN3	16,91	40.900,00	691.523,33	16,62	16,93	17,31	39.283,00
13-04-23	FIA RVA EMB II	Compra	MRVE3	7,64	48.800,00	372.747,64	7,21	7,57	7,84	35.956,00
13-04-23	FIA RVA EMB II	Compra	RECV3	22,24	9.500,00	211.280,00	21,63	22,09	22,47	14.069,00
13-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	ALSO3	18,60	7.000,00	130.186,24	18,26	18,63	18,90	18.965,00
13-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,25	2.800,00	42.691,33	15,03	15,20	15,32	6.873,00
13-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,21	2.400,00	36.498,64	15,03	15,20	15,32	6.873,00
13-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	23,08	7.800,00	180.044,31	22,74	23,01	23,52	31.777,00
13-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	34,95	2.800,00	97.850,37	34,63	35,00	35,55	29.011,00
13-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	11,62	15.900,00	184.746,70	11,34	11,57	11,76	16.318,00
13-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENJ03	0,98	10.700,00	10.494,73	0,90	0,96	1,00	2.723,00
13-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	28,70	9.400,00	269.757,13	28,44	28,69	28,88	24.180,00
13-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	2,66	5.600,00	14.895,86	2,54	2,64	2,74	59.880,00
13-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	2,68	24.889,00	66.702,52	2,54	2,64	2,74	59.880,00
13-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	20,40	6.600,00	134.622,44	20,00	20,32	20,50	11.466,00
13-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	25,72	3.200,00	82.306,84	25,45	25,70	25,91	43.048,00
13-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	LREN3	16,98	6.600,00	112.056,08	16,62	16,93	17,31	39.283,00
13-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	MRVE3	7,66	1.400,00	10.721,00	7,21	7,57	7,84	35.956,00
13-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	NINJ3	2,37	2.200,00	5.206,97	2,27	2,36	2,46	995,00
13-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	11,74	7.100,00	83.356,32	11,59	11,71	11,82	23.494,00
13-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	11,72	1.100,00	12.890,28	11,59	11,71	11,82	23.494,00
13-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	PETZ3	6,11	3.900,00	23.833,68	6,00	6,10	6,28	18.969,00
13-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	36,72	1.600,00	58.745,06	36,40	36,64	37,18	28.579,00
13-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	RDOR3	23,72	3.700,00	87.752,59	23,05	23,63	24,07	15.412,00
13-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	22,03	8.100,00	178.426,61	21,63	22,09	22,47	14.069,00
13-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	21,97	400,00	8.786,52	21,63	22,09	22,47	14.069,00
13-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	22,06	1.800,00	39.710,93	21,63	22,09	22,47	14.069,00
13-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	22,00	2.000,00	43.998,61	21,63	22,09	22,47	14.069,00
13-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	58,32	3.900,00	227.450,30	56,88	58,18	58,80	35.221,00
13-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	14,63	500,00	7.316,78	13,99	14,73	15,00	5.615,00
13-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	14,25	100,00	1.424,80	13,99	14,73	15,00	5.615,00
13-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	8,47	9.800,00	83.012,00	8,22	8,45	8,59	18.568,00
13-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	41,65	2.400,00	99.965,13	41,15	41,72	42,46	26.227,00
13-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	14,13	3.100,00	43.806,70	13,95	14,12	14,77	26.689,00
13-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	8,34	200,00	1.667,50	8,11	8,31	8,45	6.428,00
13-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	8,29	900,00	7.457,40	8,11	8,31	8,45	6.428,00
13-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	8,30	1.300,00	10.786,13	8,11	8,31	8,45	6.428,00



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO
E CONTROLE DE RISCO - ABRIL DE 2023



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 03 DE ABRIL DE 2023 À 28 DE ABRIL DE 2023

DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
13-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	CXSE3	9,79	94,00	920,01	9,73	9,85	9,94	13.693,00
13-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	CXSE3	9,90	593,00	5.870,70	9,73	9,85	9,94	13.693,00
13-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	CXSE3	9,90	297,00	2.940,30	9,73	9,85	9,94	13.693,00
13-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	CXSE3	9,90	297,00	2.940,30	9,73	9,85	9,94	13.693,00
13-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	CXSE3	9,89	750,00	7.418,08	9,73	9,85	9,94	13.693,00
13-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	CXSE3	9,86	1.483,00	14.620,89	9,73	9,85	9,94	13.693,00
14-04-23	FIA RVA EMB II	Compra	PETR3	29,68	56.100,00	1.664.928,25	29,23	29,66	29,83	24.409,00
14-04-23	FIA RVA EMB II	Venda	RDOR3	21,84	25.700,00	561.328,09	21,44	22,10	22,81	33.969,00
14-04-23	FIA RVA EMB II	Venda	SUZB3	40,72	10.100,00	411.225,19	40,41	40,64	41,22	28.501,00
14-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	18,48	3.100,00	57.300,98	18,17	18,53	18,71	11.815,00
14-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,31	8.500,00	130.112,96	15,11	15,29	15,45	8.687,00
14-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,33	8.400,00	128.767,44	15,11	15,29	15,45	8.687,00
14-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	28,77	1.300,00	37.401,00	28,22	28,67	28,86	15.097,00
14-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	28,57	3.400,00	97.145,44	28,22	28,67	28,86	15.097,00
14-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	20,52	900,00	18.468,00	19,84	20,40	20,60	11.738,00
14-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	20,32	2.800,00	56.903,98	19,84	20,40	20,60	11.738,00
14-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	11,55	9.100,00	105.148,41	11,39	11,51	11,72	35.463,00
14-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	11,50	74.200,00	853.438,77	11,39	11,51	11,72	35.463,00
14-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	11,45	800,00	9.160,00	11,39	11,51	11,72	35.463,00
14-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	22,03	200,00	4.406,55	21,44	22,10	22,81	33.969,00
14-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	22,23	2.600,00	57.795,75	21,94	22,17	22,47	8.694,00
14-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	22,18	1.900,00	42.140,30	21,94	22,17	22,47	8.694,00
14-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	14,58	3.400,00	49.568,15	14,31	14,67	15,04	5.634,00
14-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	CXSE3	9,80	2.220,00	21.745,48	9,73	9,80	9,89	7.677,00
14-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	CXSE3	9,76	295,00	2.878,23	9,73	9,80	9,89	7.677,00
14-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	5,62	5.073,00	28.508,18	5,51	5,58	5,69	9.046,00
14-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	5,64	9.761,00	55.020,37	5,51	5,58	5,69	9.046,00
17-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	18,41	900,00	16.571,96	18,30	18,47	18,81	10.897,00
17-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	ARZ3	67,90	1.000,00	67.903,64	67,53	68,12	69,65	4.969,00
17-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,24	2.400,00	36.576,00	15,18	15,33	15,50	11.133,00
17-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,33	5.100,00	78.168,74	15,18	15,33	15,50	11.133,00
17-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	28,18	1.900,00	53.544,35	27,91	28,29	29,06	22.248,00
17-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	20,19	1.800,00	36.345,82	20,04	20,20	20,67	13.487,00
17-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	11,28	21.000,00	236.831,38	11,12	11,27	11,58	36.628,00
17-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	11,36	2.300,00	26.128,00	11,12	11,27	11,58	36.628,00
17-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	11,28	30.300,00	341.703,69	11,12	11,27	11,58	36.628,00
17-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	11,15	2.300,00	25.641,10	11,12	11,27	11,58	36.628,00
17-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	5,99	5.500,00	32.956,24	5,82	6,00	6,16	11.987,00
17-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	36,37	600,00	21.819,09	35,93	36,24	36,80	22.559,00
17-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	21,48	2.700,00	57.997,89	21,35	21,65	22,10	9.909,00
17-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	21,68	700,00	15.177,92	21,35	21,65	22,10	9.909,00
17-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	TEND3	6,00	3.100,00	18.612,29	5,79	6,03	6,26	5.691,00
17-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	8,19	1.700,00	13.923,37	8,11	8,22	8,38	5.105,00
17-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	5,53	33.321,00	184.251,96	5,45	5,54	5,62	6.988,00
18-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	ARZ3	66,86	1.500,00	100.282,76	66,01	67,02	68,53	7.577,00
18-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	13,17	2.000,00	26.339,80	13,07	13,22	13,42	18.836,00
18-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,36	3.300,00	50.674,30	15,25	15,39	15,53	8.811,00
18-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	23,05	1.500,00	34.570,85	22,62	23,01	23,23	17.857,00
18-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	20,16	2.500,00	50.397,69	19,95	20,13	20,37	13.488,00
18-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	10,77	22.300,00	240.236,19	10,58	10,82	11,29	41.095,00
18-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	10,75	1.900,00	20.425,00	10,58	10,82	11,29	41.095,00
18-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	10,72	1.800,00	19.293,15	10,58	10,82	11,29	41.095,00
18-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	22,58	3.000,00	67.730,76	22,14	22,69	23,22	19.738,00
18-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	20,76	1.700,00	35.292,00	20,57	20,79	21,72	10.965,00
18-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	20,94	3.000,00	62.809,53	20,57	20,79	21,72	10.965,00
18-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	35,39	9.217,00	326.181,16	35,05	35,40	36,30	35.694,00
18-04-23	FIA RVA EMB IV	Venda	UGPA3	14,54	16.713,00	243.021,61	14,34	14,55	14,68	22.517,00
19-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	18,11	2.300,00	41.650,97	17,91	18,11	18,41	20.145,00
19-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	ARZ3	64,71	1.000,00	64.706,26	64,02	64,70	66,78	7.446,00
19-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,30	5.100,00	78.015,60	15,15	15,29	15,40	7.967,00
19-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,28	2.500,00	38.200,00	15,15	15,29	15,40	7.967,00
19-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENIU3	1,03	9.932,28	9.932,28	0,94	1,01	1,10	1.897,00
19-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	27,10	3.800,00	102.974,44	26,90	27,34	27,95	28.448,00
19-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	EUCA4	9,35	200,00	1.869,28	8,99	9,33	9,60	196,00
19-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	19,31	1.300,00	25.102,26	19,16	19,38	19,87	21.367,00
19-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	10,56	23.800,00	251.398,63	10,38	10,58	10,80	38.229,00
19-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	34,00	1.000,00	33.999,82	33,76	34,25	35,00	52.294,00
19-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	22,56	8.900,00	200.745,80	21,75	22,46	22,99	29.666,00
19-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	22,49	6.900,00	155.157,54	21,75	22,46	22,99	29.666,00
19-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	22,49	5.800,00	130.437,61	21,75	22,46	22,99	29.666,00
19-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	20,27	5.700,00	115.533,27	20,05	20,25	20,65	14.546,00
19-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	54,81	2.200,00	120.573,44	54,29	55,12	56,14	34.604,00
19-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	13,68	1.000,00	13.683,06	13,54	13,79	14,51	7.388,00
19-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	7,74	8.600,00	66.557,25	7,65	7,76	7,94	18.052,00
19-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	5,23	1.397,00	7.306,59	5,15	5,22	5,34	13.780,00
19-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	5,22	3.043,00	15.877,35	5,15	5,22	5,34	13.780,00
19-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	5,22	5.123,00	26.736,01	5,15	5,22	5,34	13.780,00
19-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	5,23	3.260,00	17.054,59	5,15	5,22	5,34	13.780,00
19-04-23	FIA RVA EMB IV	Venda	PRI03	34,06	2.948,00	100.421,04	33,76	34,25	35,00	52.294,00
19-04-23	FIA RVA EMB IV	Venda	PRI03	34,05	491,00	16.719,68	33,76	34,25	35,00	52.294,00
19-04-23	FIA RVA EMB IV	Venda	PRI03	34,50	983,00	33.913,17	33,76	34,25	35,00	52.294,00
19-04-23	FIA RVA EMB IV	Venda	PRI03	34,43	254,00	8.745,44	33,76	34,25	35,00	52.294,00
19-04-23	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	19,37	3.935,00	76.227,85	19,19	19,35	19,53	17.815,00
19-04-23	FIA RVA EMB IV	Venda	UGPA3	14,62	302,00	4.415,27	14,43	14,56	14,74	17.159,00
19-04-23	FIA RVA EMB IV	Venda	UGPA3	14,53	7.698,00	111.865,85	14,43	14,56	14,74	17.159,00
20-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,40	400,00	6.160,00	15,33	15,43	15,50	9.296,00



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO
E CONTROLE DE RISCO - ABRIL DE 2023



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 03 DE ABRIL DE 2023 À 28 DE ABRIL DE 2023

DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
20-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,43	3.800,00	58.635,20	15,33	15,43	15,50	9.296,00
20-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,44	1.100,00	16.984,00	15,33	15,43	15,50	9.296,00
20-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	33,58	1.700,00	57.084,54	33,21	33,70	34,02	40.342,00
20-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	33,76	500,00	16.880,00	33,21	33,70	34,02	40.342,00
20-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	33,58	200,00	6.715,51	33,21	33,70	34,02	40.342,00
20-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	EUCA4	9,00	100,00	900,22	8,85	9,00	9,43	97,00
20-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	2,47	39.400,00	97.245,95	2,34	2,50	2,59	57.326,00
20-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	2,45	14.400,00	35.280,00	2,34	2,50	2,59	57.326,00
20-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	10,88	6.900,00	75.072,00	10,43	10,80	11,02	25.641,00
20-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	10,87	3.100,00	33.697,00	10,43	10,80	11,02	25.641,00
20-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	10,85	29.900,00	324.392,76	10,43	10,80	11,02	25.641,00
20-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	10,85	700,00	7.595,00	10,43	10,80	11,02	25.641,00
20-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	10,99	600,00	6.592,00	10,43	10,80	11,02	25.641,00
20-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	10,70	2.900,00	31.023,17	10,43	10,80	11,02	25.641,00
20-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	22,90	2.200,00	50.388,63	22,02	22,89	23,15	30.325,00
20-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	22,84	4.000,00	91.342,20	22,02	22,89	23,15	30.325,00
20-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	22,98	10.500,00	241.323,55	22,02	22,89	23,15	30.325,00
20-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	22,86	4.400,00	100.569,45	22,02	22,89	23,15	30.325,00
20-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	20,18	2.900,00	58.530,32	19,85	20,16	20,48	9.198,00
20-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	20,25	1.900,00	38.475,00	19,85	20,16	20,48	9.198,00
20-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	20,10	1.600,00	32.160,00	19,85	20,16	20,48	9.198,00
20-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	13,90	200,00	2.779,06	13,55	14,12	14,42	2.933,00
20-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	EQLT3	28,00	4.455,00	124.741,91	27,18	27,91	28,13	16.103,00
20-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	EQLT3	27,99	2.509,00	70.223,46	27,18	27,91	28,13	16.103,00
20-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	EQLT3	27,88	2.231,00	62.193,34	27,18	27,91	28,13	16.103,00
20-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	56,36	2.764,00	155.789,11	54,79	56,22	56,62	28.589,00
20-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	56,09	1.472,00	82.562,15	54,79	56,22	56,62	28.589,00
20-04-23	FIA RVA EMB IV	Venda	UGPA3	14,43	16.493,00	237.924,43	14,26	14,41	14,69	20.503,00
20-04-23	FIA RVA EMB II	Venda	INTB3	23,30	36.300,00	845.713,49	23,15	23,31	23,65	5.856,00
20-04-23	FIA RVA EMB II	Compra	PETRA	27,13	17.000,00	461.267,57	26,50	27,02	27,26	77.036,00
20-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	18,20	2.700,00	49.148,10	18,15	18,39	18,75	20.665,00
20-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,45	4.300,00	66.435,00	15,36	15,45	15,54	4.598,00
20-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	43,43	500,00	21.716,37	43,05	43,48	44,04	20.962,00
20-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	22,44	8.800,00	197.483,54	22,34	22,49	22,83	16.419,00
20-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	34,38	2.700,00	92.834,29	33,20	34,17	34,76	48.936,00
20-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	11,28	11.000,00	124.129,36	11,09	11,30	11,45	16.888,00
20-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	27,73	2.700,00	74.858,51	27,62	27,84	28,34	23.187,00
20-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	2,59	4.400,00	11.411,00	2,53	2,64	2,75	34.113,00
20-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	25,34	3.800,00	96.275,95	25,18	25,40	25,78	39.709,00
20-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	LTREN3	15,26	1.700,00	25.948,53	14,97	15,19	15,46	19.075,00
20-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	NINJ3	2,63	3.500,00	9.204,00	2,50	2,60	2,70	419,00
20-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	10,90	9.800,00	106.845,29	10,66	10,90	11,07	19.177,00
20-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	10,86	6.200,00	67.301,40	10,66	10,90	11,07	19.177,00
20-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	6,31	3.100,00	19.573,86	6,17	6,32	6,45	11.782,00
20-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	6,30	10.300,00	64.927,74	6,17	6,32	6,45	11.782,00
20-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRIO3	35,15	500,00	17.573,00	34,00	34,98	35,34	20.313,00
20-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	22,88	1.200,00	27.458,49	22,66	23,02	23,50	15.341,00
20-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	22,98	3.600,00	82.718,89	22,66	23,02	23,50	15.341,00
20-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	20,01	2.900,00	58.015,10	19,86	20,02	20,22	8.859,00
20-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	56,73	1.400,00	79.418,19	56,00	56,64	57,31	19.047,00
20-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	8,10	4.000,00	32.391,55	8,04	8,14	8,50	17.277,00
20-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	8,08	2.900,00	23.430,54	8,04	8,14	8,50	17.277,00
20-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	39,66	2.300,00	91.214,77	39,01	39,77	40,21	27.351,00
20-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	13,25	3.000,00	39.758,01	13,05	13,25	13,36	16.794,00
20-04-23	FIA RVA EMB IV	Venda	UGPA3	14,47	24.853,00	359.704,46	14,21	14,49	14,68	13.667,00
20-04-23	FIA RVA EMB IV	Venda	UGPA3	14,50	11.189,00	162.280,42	14,21	14,49	14,68	13.667,00
25-04-23	FIA RVA EMB II	Venda	CBAV3	5,25	100.000,00	525.232,16	5,15	5,25	5,49	8.751,00
25-04-23	FIA RVA EMB II	Compra	GGBR4	24,23	17.500,00	424.004,18	24,05	24,27	24,86	21.864,00
25-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,46	3.200,00	49.479,14	15,28	15,39	15,50	6.879,00
25-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENJ3	0,92	500,00	460,00	0,91	0,92	0,94	1.265,00
25-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	19,67	1.700,00	33.430,82	19,38	19,69	20,16	7.947,00
25-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	39,01	3.400,00	132.641,30	38,64	39,17	39,80	18.216,00
25-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	39,12	2.500,00	97.796,01	38,64	39,17	39,80	18.216,00
25-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	EQLT3	27,50	14.698,00	404.156,27	27,26	27,49	27,80	22.360,00
25-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	5,21	4.986,00	25.981,65	5,18	5,23	5,38	7.228,00
25-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	56,09	7.272,00	407.895,10	55,64	56,09	56,49	18.904,00
25-04-23	FIA RVA EMB IV	Venda	UGPA3	14,47	14.979,00	216.746,13	14,44	14,51	14,66	17.588,00
25-04-23	FIA RVA EMB IV	Venda	UGPA3	14,53	4.853,00	70.505,21	14,44	14,51	14,66	17.588,00
25-04-23	FIA RVA EMB IV	Venda	UGPA3	14,51	4.085,00	59.283,64	14,44	14,51	14,66	17.588,00
25-04-23	FIA RVA EMB IV	Venda	UGPA3	14,53	11.686,00	169.808,28	14,44	14,51	14,66	17.588,00
25-04-23	FIA RVA EMB IV	Venda	UGPA3	14,48	2.723,00	39.428,70	14,44	14,51	14,66	17.588,00
26-04-23	FIA RVA EMB II	Venda	CBAV3	5,15	86.000,00	443.159,61	5,08	5,15	5,40	8.628,00
26-04-23	FIA RVA EMB II	Venda	EGIE3	40,31	15.500,00	624.837,38	40,19	40,53	41,10	5.706,00
26-04-23	FIA RVA EMB II	Compra	ELET6	38,32	13.100,00	501.974,78	37,95	38,17	38,82	9.344,00
26-04-23	FIA RVA EMB II	Compra	VALE3	70,64	4.400,00	310.801,50	70,27	70,69	71,43	56.746,00
26-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	ARZZ3	61,86	2.700,00	167.029,79	60,54	61,91	64,01	10.078,00
26-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	15,34	1.600,00	24.548,98	15,26	15,33	15,48	7.883,00
26-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	42,62	1.500,00	63.935,58	42,52	42,89	43,26	24.711,00
26-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	27,24	2.000,00	54.479,06	27,04	27,27	27,74	14.986,00
26-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	19,28	2.300,00	44.336,44	19,12	19,28	19,48	9.416,00
26-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	6,29	2.100,00	13.215,27	6,21	6,30	6,40	7.846,00
26-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	23,22	4.300,00	99.846,00	22,48	23,05	23,40	13.369,00
26-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	19,43	2.800,00	54.409,74	19,07	19,35	19,80	11.396,00
26-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	7,85	4.300,00	33.755,00	7,38	7,64	8,07	21.861,00
26-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	7,81	2.700,00	21.096,49	7,38	7,64	8,07	21.861,00
26-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	38,58	2.400,00	92.592,89	38,25	38,62	39,24	24.474,00



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO
E CONTROLE DE RISCO - ABRIL DE 2023



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 03 DE ABRIL DE 2023 À 28 DE ABRIL DE 2023

DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
26-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	5,30	46.000,00	243.779,00	5,20	5,31	5,44	6.643,00
26-04-23	FIA RVA EMB IV	Venda	PRI03	33,59	5.721,00	192.162,36	33,39	34,15	35,20	29.539,00
26-04-23	FIA RVA EMB IV	Venda	PRI03	34,42	2.043,00	70.315,84	33,39	34,15	35,20	29.539,00
26-04-23	FIA RVA EMB IV	Venda	PRI03	33,97	1.795,00	60.976,97	33,39	34,15	35,20	29.539,00
26-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	56,55	4.316,00	244.067,63	55,48	56,46	57,05	19.005,00
26-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	SUZB3	38,62	10.437,00	403.103,12	38,25	38,62	39,24	24.474,00
26-04-23	FIA RVA EMB IV	Venda	UGPA3	14,22	4.005,00	56.941,92	14,11	14,24	14,50	13.066,00
26-04-23	FIA RVA EMB IV	Venda	UGPA3	14,28	553,00	7.899,32	14,11	14,24	14,50	13.066,00
27-04-23	FIA RVA EMB II	Venda	ARZ23	61,82	9.300,00	574.930,06	59,54	61,72	64,08	11.014,00
27-04-23	FIA RVA EMB II	Venda	CBAV3	5,18	23.800,00	123.305,71	5,07	5,21	5,29	6.981,00
27-04-23	FIA RVA EMB II	Venda	HYPE3	36,04	10.700,00	385.671,32	35,56	35,96	36,20	11.626,00
27-04-23	FIA RVA EMB II	Compra	MRVE3	6,88	43.900,00	301.880,89	6,39	6,91	7,20	36.490,00
27-04-23	FIA RVA EMB II	Compra	VALE3	70,83	11.800,00	835.783,02	69,18	70,86	71,78	73.768,00
27-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	ARZ23	62,68	800,00	50.140,73	59,54	61,72	64,08	11.014,00
27-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	23,21	800,00	18.565,50	22,32	22,99	23,31	22.082,00
27-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	10,97	3.000,00	32.911,57	10,94	11,02	11,11	11.149,00
27-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQT13	27,12	2.800,00	75.948,66	26,83	27,11	27,44	17.830,00
27-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	19,74	2.500,00	49.343,59	19,25	19,74	19,94	13.308,00
27-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	33,56	4.400,00	147.645,66	33,16	33,53	33,87	28.219,00
27-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	18,95	1.100,00	20.846,32	18,50	18,97	19,23	10.209,00
27-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	38,15	4.600,00	175.473,87	37,81	38,13	38,76	21.119,00
27-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	EQT13	27,10	17.213,00	466.480,81	26,83	27,11	27,44	17.830,00
27-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	5,29	84.200,00	445.772,00	5,14	5,26	5,38	13.666,00
27-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ITUB4	25,64	23.000,00	589.721,00	25,33	25,67	25,80	28.942,00
27-04-23	FIA RVA EMB IV	Venda	PRI03	33,56	5.006,00	167.994,33	33,16	33,53	33,87	28.219,00
27-04-23	FIA RVA EMB IV	Venda	PRI03	33,40	2.086,00	69.667,56	33,16	33,53	33,87	28.219,00
27-04-23	FIA RVA EMB IV	Venda	PRI03	33,65	3.788,00	127.474,05	33,16	33,53	33,87	28.219,00
27-04-23	FIA RVA EMB IV	Venda	PRI03	33,49	1.669,00	55.886,76	33,16	33,53	33,87	28.219,00
27-04-23	FIA RVA EMB IV	Venda	PRI03	33,53	3.747,00	250.488,90	33,16	33,53	33,87	28.219,00
27-04-23	FIA RVA EMB IV	Venda	PRI03	33,61	3.754,00	126.186,01	33,16	33,53	33,87	28.219,00
27-04-23	FIA RVA EMB IV	Venda	UGPA3	14,17	10.577,00	149.839,40	14,01	14,14	14,25	14.524,00
27-04-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	TRXF11	103,55	4.829,00	500.042,95	103,05	103,50	103,64	3.073,00
28-04-23	FIA RVA EMB II	Compra	CSMG3	17,04	17.400,00	296.496,00	16,52	16,96	17,15	8.331,00
28-04-23	FIA RVA EMB II	Compra	ECOR3	6,17	81.600,00	503.472,00	5,90	6,12	6,19	16.139,00
28-04-23	FIA RVA EMB II	Venda	EGIE3	41,05	9.300,00	381.804,37	40,68	41,08	41,23	6.583,00
28-04-23	FIA RVA EMB II	Venda	HYPE3	37,25	29.300,00	1.091.459,14	35,49	36,97	37,62	16.499,00
28-04-23	FIA RVA EMB II	Compra	MRVE3	7,07	28.200,00	199.502,62	6,90	7,11	7,22	18.466,00
28-04-23	FIA RVA EMB II	Compra	PETRA	23,69	14.700,00	348.236,76	23,15	23,64	24,05	93.824,00
28-04-23	FIA RVA EMB II	Venda	TIMS3	14,00	73.700,00	1.031.445,71	13,83	13,97	14,15	15.581,00
28-04-23	FIA RVA EMB II	Compra	VALE3	72,20	8.100,00	584.837,76	71,06	72,16	72,42	47.098,00
28-04-23	FIA RVA EMB II	Compra	VAMO3	12,00	85.800,00	1.029.455,76	11,85	12,07	12,42	22.393,00
28-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	18,46	1.200,00	22.156,80	18,16	18,55	18,69	20.834,00
28-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	ARZ23	64,94	1.500,00	97.412,34	62,63	65,51	67,00	9.919,00
28-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,79	600,00	9.473,00	15,34	15,72	15,90	12.926,00
28-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,67	2.700,00	42.309,00	15,34	15,72	15,90	12.926,00
28-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,67	2.500,00	39.180,47	15,34	15,72	15,90	12.926,00
28-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,76	600,00	9.454,49	15,34	15,72	15,90	12.926,00
28-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	23,50	1.100,00	25.846,32	22,95	23,41	23,61	20.518,00
28-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	11,20	2.200,00	24.643,56	10,97	11,24	11,35	14.841,00
28-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQT13	27,14	1.600,00	43.417,71	26,87	27,24	27,36	13.398,00
28-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQT13	27,15	2.200,00	59.730,00	26,87	27,24	27,36	13.398,00
28-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	20,33	1.400,00	28.463,75	19,83	20,32	20,53	24.382,00
28-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	20,37	4.000,00	81.462,43	19,83	20,32	20,53	24.382,00
28-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	25,88	1.300,00	33.639,67	25,51	25,83	25,93	29.078,00
28-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	15,59	700,00	10.914,75	15,01	15,57	15,86	28.865,00
28-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	PETZ3	6,07	6.200,00	37.634,00	5,84	6,03	6,17	12.630,00
28-04-23	FIA RVA EMB III	Compra	PETZ3	6,06	10.800,00	65.472,51	5,84	6,03	6,17	12.630,00
28-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	34,65	300,00	10.395,00	33,51	34,47	35,07	25.584,00
28-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	19,19	5.100,00	97.849,70	18,76	19,36	19,68	12.944,00
28-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	57,97	1.700,00	98.550,19	57,16	58,01	58,50	20.748,00
28-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	58,09	600,00	34.854,00	57,16	58,01	58,50	20.748,00
28-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	8,31	2.800,00	23.268,55	7,86	8,25	8,46	18.640,00
28-04-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	13,06	1.200,00	15.672,00	12,97	13,11	13,39	18.121,00
28-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	2,70	49.334,00	133.259,04	2,53	2,69	2,76	35.472,00
28-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	2,67	8.903,00	23.780,18	2,53	2,69	2,76	35.472,00
28-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	2,72	2.968,00	8.072,27	2,53	2,69	2,76	35.472,00
28-04-23	FIA RVA EMB IV	Venda	PRI03	34,20	8.191,00	280.141,96	33,51	34,47	35,07	25.584,00
28-04-23	FIA RVA EMB IV	Venda	PRI03	34,23	3.510,00	120.134,27	33,51	34,47	35,07	25.584,00
28-04-23	FIA RVA EMB IV	Venda	PRI03	34,49	1.170,00	40.350,40	33,51	34,47	35,07	25.584,00
28-04-23	FIA RVA EMB IV	Venda	PRI03	33,79	2.726,00	92.102,78	33,51	34,47	35,07	25.584,00
28-04-23	FIA RVA EMB IV	Venda	PRI03	34,57	4.681,00	161.824,08	33,51	34,47	35,07	25.584,00
28-04-23	FIA RVA EMB IV	Venda	PRI03	34,75	7.658,00	266.115,50	33,51	34,47	35,07	25.584,00
28-04-23	FIA RVA EMB IV	Venda	PRI03	34,04	5.441,00	185.220,20	33,51	34,47	35,07	25.584,00
28-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	SUZB3	39,40	3.565,00	140.443,21	37,15	38,94	39,88	55.647,00
28-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	SUZB3	39,31	180,00	7.076,24	37,15	38,94	39,88	55.647,00
28-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	SUZB3	39,72	3.862,00	153.413,38	37,15	38,94	39,88	55.647,00
28-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	SUZB3	38,98	1.528,00	59.559,93	37,15	38,94	39,88	55.647,00
28-04-23	FIA RVA EMB IV	Compra	SUZB3	39,44	2.037,00	80.334,65	37,15	38,94	39,88	55.647,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ABEV3	14,16	3.526,00	49.928,61	13,98	14,13	14,22	29.430,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ALPA4	7,41	192,00	1.422,67	7,12	7,39	7,60	37.588,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ALSO3	18,64	9.759,00	181.908,81	18,16	18,55	18,69	20.834,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ARZ23	66,38	49,00	3.252,62	62,63	65,51	67,00	9.919,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ASAI3	12,29	913,00	11.222,93	12,08	12,23	12,43	18.177,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	AZUL4	10,86	265,00	2.878,01	10,15	10,71	10,97	12.535,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	B3SA3	11,68	13.127,00	153.324,01	11,35	11,62	11,77	26.965,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BBA53	42,86	1.152,00	49.374,72	42,35	42,83	43,30	19.008,00



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO
E CONTROLE DE RISCO - ABRIL DE 2023



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 03 DE ABRIL DE 2023 À 28 DE ABRIL DE 2023

DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BBD3	12,42	1.626,00	20.193,37	12,13	12,35	12,44	6.127,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BBD4	13,85	4.647,00	64.358,43	13,60	13,81	13,98	30.048,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BBSE3	34,30	544,00	18.660,46	33,94	34,32	34,73	14.982,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BEEF3	8,55	259,00	2.213,73	8,24	8,48	8,60	16.795,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BPAC11	23,42	993,00	23.255,36	22,95	23,41	23,61	20.518,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BPAN4	5,36	17.208,00	92.234,32	5,03	5,30	5,40	19.398,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BRAP4	23,68	196,00	4.641,56	23,25	23,53	23,70	7.774,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BRFS3	6,34	873,00	5.534,82	5,82	6,20	6,38	16.481,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BRKM5	19,77	191,00	3.776,65	18,84	19,64	19,99	10.233,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CASH3	0,86	1.132,00	973,52	0,82	0,85	0,88	6.795,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CCRO3	13,57	809,00	10.978,38	13,31	13,48	13,57	13.587,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CIEL3	5,46	887,00	4.842,09	5,18	5,36	5,48	22.072,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CMIG4	12,35	1.168,00	14.423,35	12,24	12,34	12,45	23.362,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CMIN3	4,64	900,00	4.176,24	4,45	4,60	4,68	7.760,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	COGN3	2,04	1.543,00	3.147,72	1,99	2,03	2,06	12.744,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CPFE3	33,14	152,00	5.037,28	32,44	32,94	33,23	6.802,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CPL6	8,02	1.267,00	10.161,33	7,84	7,96	8,02	13.281,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CRFB3	10,75	428,00	4.599,80	10,17	10,58	10,75	13.655,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CSAN3	14,98	948,00	14.203,68	14,42	14,82	14,98	12.475,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CSNA3	14,21	458,00	6.509,68	13,53	13,97	14,21	15.883,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CYRE3	15,40	222,00	3.419,83	15,15	15,43	15,63	12.226,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	DXCO3	5,89	152,00	894,60	5,62	5,78	5,89	7.797,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ECOR3	6,17	15.687,00	96.785,16	5,90	6,12	6,19	16.139,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	EGIE3	41,23	206,00	8.493,35	40,68	41,08	41,23	6.583,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ELET3	33,85	5.810,00	196.669,66	33,46	33,74	34,16	26.346,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ELET6	36,41	223,00	8.119,11	36,27	36,56	37,35	9.800,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	EMBR3	19,42	582,00	11.300,52	19,01	19,36	19,53	15.103,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ENBR3	22,50	200,00	4.499,99	22,34	22,49	22,70	4.949,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ENEV3	11,35	1.229,00	13.949,15	10,97	11,24	11,35	14.841,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ENGI11	41,81	201,00	8.404,74	41,15	41,64	42,01	8.180,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	EQLT3	27,34	892,00	24.388,82	26,87	27,24	27,36	13.398,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	EZTC3	14,50	101,00	1.464,73	14,01	14,32	14,53	7.355,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	FLRY3	14,52	2.231,00	32.394,44	14,13	14,41	14,52	14.799,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	GGBR4	25,18	3.640,00	91.655,20	24,37	25,09	25,28	15.656,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	GOAU4	11,66	541,00	6.308,00	11,29	11,57	11,66	12.820,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	GOLL4	6,64	1.285,00	8.532,80	6,10	6,49	6,66	9.922,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	HAPV3	2,76	10.151,00	28.015,56	2,53	2,69	2,76	35.472,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	HYPE3	37,29	325,00	12.118,00	35,49	36,97	37,62	16.499,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	IGTI11	20,35	54,00	1.098,72	19,83	20,32	20,53	24.382,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	IRBR3	31,47	4.038,00	127.073,77	28,21	30,62	31,47	15.744,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ITSA4	8,68	15.088,00	130.963,04	8,51	8,65	8,71	19.932,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ITUB4	25,92	3.883,00	100.646,96	25,51	25,83	25,93	29.078,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	JBSS3	17,90	920,00	16.468,00	16,95	17,63	17,90	15.997,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	KLBN11	19,13	568,00	10.864,52	18,41	18,95	19,34	22.848,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	LREN3	15,84	1.517,00	24.028,72	15,01	15,57	15,86	28.865,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	LWSA3	5,26	286,00	1.504,54	5,18	5,25	5,36	6.046,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	MGLU3	3,34	2.217,00	7.404,30	3,14	3,25	3,34	19.543,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	MRFG3	6,51	1.394,00	9.074,94	6,22	6,44	6,55	13.297,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	MRVE3	7,20	265,00	1.906,90	6,90	7,11	7,22	18.466,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	MULT3	25,89	277,00	7.170,22	25,42	25,82	26,34	25.423,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	NTCO3	11,06	532,00	5.883,83	10,68	10,98	11,11	15.851,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	PCAR3	15,01	101,00	1.515,52	14,16	14,73	15,16	8.869,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	PETR3	26,67	27.315,00	728.488,67	25,87	26,58	27,10	25.792,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	PETR4	23,70	3.697,00	87.618,06	23,15	23,64	24,05	93.824,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	PETZ3	6,17	233,00	1.437,24	5,84	6,03	6,17	12.630,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	PRI03	34,75	680,00	23.627,12	33,51	34,47	35,07	25.584,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	QUAL3	3,97	13.910,00	55.216,92	3,68	3,89	3,99	10.504,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	RADL3	26,28	4.780,00	125.620,20	26,07	26,29	26,47	12.161,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	RAIL3	19,70	985,00	19.408,02	19,39	19,67	19,85	15.001,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	RAIZ4	3,19	882,00	2.813,58	3,09	3,17	3,25	13.875,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	RDOR3	22,87	3.634,00	83.108,08	22,28	22,80	22,95	9.635,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	RENT3	58,01	801,00	46.467,36	57,16	58,01	58,50	20.748,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RRRP3	31,67	1.763,00	55.833,43	29,80	31,31	32,39	31.394,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	SANB11	26,87	289,00	7.765,59	26,23	26,69	26,87	5.598,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	SBS3	46,13	274,00	12.639,84	45,32	45,76	46,69	19.474,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	SLCE3	43,48	78,00	3.391,10	42,68	43,27	43,54	5.714,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	SMT03	31,40	116,00	3.642,54	30,15	31,20	32,09	15.570,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	SOMA3	8,41	428,00	3.600,20	7,86	8,25	8,46	18.640,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	SUZB3	39,80	589,00	23.442,20	37,15	38,94	39,88	55.647,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	TAE11	36,47	177,00	6.455,69	35,40	36,24	36,47	15.816,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	TIMS3	14,00	655,00	9.167,85	13,83	13,97	14,15	15.581,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	TOTS3	25,66	770,00	19.757,90	25,15	25,62	26,17	14.656,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	UGPA3	14,44	882,00	12.735,24	14,13	14,45	14,58	15.081,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	USIM5	7,20	417,00	3.002,40	6,84	7,08	7,20	13.623,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VALE3	72,40	28.989,00	2.098.803,09	71,06	72,16	72,42	47.098,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	VBBR3	13,20	903,00	11.917,44	12,97	13,11	13,39	18.121,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	VIA3	1,84	1.150,00	2.115,88	1,75	1,81	1,84	13.182,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	VIT3	41,09	343,00	14.093,84	40,76	41,16	41,42	7.171,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	WEGE3	41,12	3.940,00	162.011,44	40,11	40,94	41,12	17.659,00
28-04-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	YDUQ3	8,12	187,00	1.518,12	7,81	8,04	8,16	6.110,00



7. RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS

Para o acompanhamento da rentabilidade dos investimentos dos Planos que administra, a EMBRAER PREV adotará a variação do valor da cota do Plano, dos segmentos de aplicação e dos fundos de investimentos e/ou carteiras onde o(s) Plano(s) aplica(m) seus recursos. A periodicidade da avaliação será no mínimo, mensal, com foco no resultado do semestre e ano. A rentabilidade dos segmentos, fundos de investimentos e/ou carteiras deve ser monitorada e comparada com indicadores de mercado e índices de referência definidos na Política de Investimento dos respectivos Planos.

Mensalmente são disponibilizados no portal da Entidade, www.embraerprev.com.br, os seguintes relatórios:

- 7.1. Composição da Carteira de Investimentos: Indica a composição da carteira de investimento da EMBRAER PREV, por segmento de aplicação (Renda Fixa, Renda Variável ou outros), bem como todos os títulos, ações e outros investimentos que sejam realizados pela Entidade.
- 7.2. Rentabilidade e Resultados dos Investimentos: Apresenta os principais resultados da administração da EMBRAER PREV e do Plano Embraer Prev, tais como fatos relevantes, benefícios concedidos, inscrições de novos Participantes, estatísticas de atendimento, rentabilidade dos investimentos e evolução patrimonial.



8. GLOSSÁRIO

Administrador

Atividade profissional aprovada pelos órgãos governamentais competentes para a administração de fundos e carteiras de investimentos. Nessa atividade, o administrador realiza a contabilização de ativos e passivos e todas as demais atividades correlatas para o bom funcionamento de um fundo ou carteira de investimentos.

Carteira

Conjunto composto por títulos, ações e contratos. A título de exemplo, a carteira de investimentos da EMBRAER PREV compõe-se de todos os investimentos vinculados aos Planos que a Entidade administra.

Dados Gerais

Compõem-se dos indicadores de risco de mercado, considerando os parâmetros definidos para seu cálculo e a composição dos investimentos de cada carteira ou fundo, como por exemplo: *Var (Value at Risk)* sobre o PL (Patrimônio Líquido), *ETL (Expected Tail Loss)* sobre o PL (Patrimônio Líquido) e o *Var (Value at Risk)* sobre a variação do CDI. Vide também glossário de *Value at Risk*, Patrimônio Líquido e *Expected Tail Loss*.

Duration

É o cálculo do prazo médio de vencimento de um título, fundo ou carteira, ajustado pelo fluxo de recebimento de juros e do valor principal, calculado pelo seu valor presente.

Vide também glossário de Valor Presente.

ETL (Expected Tail Loss)

Expressão em inglês, também chamada de “Risco de Cauda”, que representa o cálculo de probabilidade de perdas de um título, fora do intervalo de confiança determinado como parâmetro.

Fundo de Investimento

É um tipo de aplicação financeira que reúne recursos de um conjunto de investidores, regido por um regulamento, destinado à aplicação em títulos, valores mobiliários ou em quaisquer outros ativos disponíveis no mercado financeiro e de capitais.

Índice de Referência (Benchmark)

Indicador usado para comparar a rentabilidade entre investimentos, produtos, serviços e taxas. No mercado de ações, por exemplo, o índice BOVESPA é o *benchmark* mais utilizado.



LDI (Liability Driven Investments)

É uma técnica de construção de carteira de investimento para Planos de Aposentadoria, que busca imunizar os compromissos (pagamento de benefícios) do Plano, aumentando a segurança para o cumprimento desse objetivo.

Parâmetros do Cálculo do VaR (Value at Risk)

É a etapa inicial para o cálculo do Var, onde são definidos os métodos estatísticos e os elementos de análise do ativo, fundo ou carteira, para medir seu risco de mercado.

Patrimônio de Cobertura

É o total de recursos do Plano para cobertura de suas obrigações.

Patrimônio Líquido (PL)

Para fins de entendimento desse relatório, trata-se do somatório de todos os títulos e direitos de um fundo ou uma carteira de investimentos.

Rating

Expressão em inglês que significa classificação do risco oferecido por um banco, um fundo de investimento, uma empresa ou um país. Feito por agências especializadas, é utilizado como referência aos investidores na hora de decidirem onde aplicar os recursos. A classificação é expressa em termos de qualidade (excelente à péssima) ou nível de risco (grau de investimento à inadimplente). Entre as maiores agências, estão as norte-americanas *Standard & Poor's*, *Fitch IBA* e *Moody's Investors*.

Stress Testing

É uma simulação para avaliar o desempenho de um ativo, fundo ou carteira, sob um conjunto específico de condições adversas de mercado, que podem ser definidas pelo seu Administrador, nesse caso chamado de “cenário próprio”, ou pelo cenário disponibilizado pela BM&F Bovespa.

Tracking Error

Termo em inglês que define a diferença entre os retornos de uma carteira e o retorno do seu índice de referência (*benchmark*). É o desvio padrão da diferença calculada entre esses retornos.



Túnel de Preços

É o intervalo de preços estabelecido pelo administrador, que determina se a operação de compra ou venda de um determinado ativo foi realizada em condições de mercado, no momento daquela negociação.

Valor Presente

É o valor de uma série de fluxos de caixa futuros, descontados por uma taxa de juros (taxa de desconto).

Value at Risk (VaR)

Expressão em inglês para o cálculo de probabilidade de perdas de uma aplicação em vários cenários adversos da economia. Avalia a perda máxima que uma carteira poderá ter dentro de um horizonte e intervalo de confiança determinados.