



# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO



Maio/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 Risco



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



Data: 31/05/2023

**Relatório de Risco de Mercado**

**FUNDO:** EMBRAERPREV - CONSOL. FUNDOS  
**CNPJ:** 10679245000140

Dados Gerais		Limite Fundo:		ENQUADRADO		0,00% Dutation DC:		1,826,15	
PL:	4.353.869.830,20	VAR / PL:	2,2655%	Status:		Dutation DU:			1,256,43
VAR:	98.637.389,49	ETL / PL:	2,8410%	Benchmark:					
ETL:	123.695.265,80	VAR / CDI:	0,0255%						

Cenários de STRESS										
Cenário Alta - 09999 (+):	197.141.810,38	Cenário Baixa - 10000 (+):	297.865.066,33	CENARIO BRADESCO 1 (+):	385.117.501,77	CENARIO BRADESCO 2 (+):	94.703.947,70			
Cenário Alta - 09999 (-):	(216.514.688,49)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(191.035.252,46)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(74.821.480,35)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(432.683.271,19)			
Cenário Alta - 09999:	(19.372.878,11)	Cenário Baixa - 10000:	106.829.813,87	CENARIO BRADESCO 1:	310.296.021,42	CENARIO BRADESCO 2:	(337.979.323,49)			

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	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
17H0164854	8.369.153,50	26.770,17	4.113,29	0,00%	-340.562,36	57.684,94	136.097,20	-180.266,69
AEGP23	15.048.814,42	53.850,94	-34.507,58	-0,03%	1.271.498,63	-2.724.639,92	1.331.440,71	-1.342.339,27
CCRDD1	6.139.202,77	17.718,38	-7.049,76	-0,01%	0,00	0,00	0,00	0,00
CMDT33	1.354.084,42	4.352,73	-2.678,26	0,00%	-560.077,83	-18.140,20	179.716,55	-240.130,30
CSMIG3	13.368.911,94	39.007,38	-25.605,90	-0,03%	-8.153,50	6.856,42	10.550,25	-14.383,82
ELET42	13.938.412,37	96.342,15	71.012,05	0,07%	1.166.401,03	-1.166.404,55	341.989,84	-344.703,22
ENJG21	1.932.940,97	5.973,68	469,67	0,00%	26.234,72	-26.235,72	15.384,63	-15.510,56
ENMI21	1.204.973,04	3.878,66	499,70	0,00%	3.473.958,87	-2.481.399,20	1.455.092,49	-1.467.003,20
ENTV12	31.483.114,90	254.020,80	203.163,63	0,21%	-5.082,66	4.176,17	6.766,43	-9.547,25
ERDV17_VENCIMENTO	13.188.170,01	49.452,90	-34.703,07	-0,04%	-985.475,47	611.480,83	652.589,46	-808.005,48
ERDV36	4.210.754,07	12.141,77	-4.670,66	0,00%	-110.025,65	29.786,57	49.382,11	-64.891,52
GASP17	60.055.683,84	1.319.470,39	-650.208,67	-0,66%	-239,75	195,08	337,73	-486,49
GEP24	7.835.602,17	24.166,96	-14.523,75	-0,01%	-616,58	503,61	824,26	-1.171,05
GRRB24_VENCIMENTO	15.854.311,73	108.939,72	79.628,45	0,08%	562.392,97	-562.395,51	274.822,70	-277.072,27
IGSN15	2.859.039,11	28.229,31	23.845,92	0,02%	281.218,28	-281.131,26	147.237,86	-148.443,08
LSFN1600GM	14.051.222,94	49.078,96	-17.044,93	-0,02%	1.748.032,00	-2.167.559,68	1.025.045,97	-1.033.436,52
LSFN1600DC5	4.583.910,68	16.701,40	-3.919,02	0,00%	123.162,65	-123.162,65	48.133,62	-48.452,05
NEOE16	7.262.009,14	50.981,43	37.835,59	0,04%	3.470.369,49	-3.470.369,49	2.035.024,67	-2.051.682,44
NTNB20240815 - 760199_VENCIMENTO	121.215.525,65	1.212.420,95	-1.105.785,20	-1,12%	3.469.361,17	-3.469.392,27	2.034.433,39	-2.051.086,32
NTNB20260815 - 760199_VENCIMENTO	42.424.197,23	283.420,34	-202.594,28	-0,21%	246.792,14	-246.792,14	144.718,91	-145.903,52
NTNB20300815 - 760199_VENCIMENTO	26.647.463,71	308.437,76	278.513,89	0,28%	3.330.830,66	-3.330.830,66	1.953.199,10	-1.969.187,09
NTNB20350515 - 760199_VENCIMENTO	237.241.323,92	4.973.107,11	4.772.553,79	4,84%	625.392,23	-625.392,23	458.412,50	-462.164,86
NTNB20400815 - 760199_VENCIMENTO	29.811.742,73	689.198,80	662.498,75	0,67%	0,00	0,00	0,00	0,00
NTNB20450515 - 760199_VENCIMENTO	224.873.133,79	5.783.939,69	5.494.539,14	5,67%	-100,02	81,60	154,11	-225,03
NTNB20500815 - 760199_VENCIMENTO	726.176.705,17	20.074.530,10	19.031.779,70	19,29%	-1.334,80	1.081,32	1.986,82	-2.893,60
NTNB20550515 - 760199_VENCIMENTO	225.815.051,63	6.448.349,48	6.065.116,34	6,15%	667.391,33	-667.391,33	391.352,41	-394.555,94
OMGE31	12.404.923,44	52.565,38	9.244,29	0,01%	-137,15	114,23	247,23	-366,09
PETRA5	18.629.953,15	60.360,77	-40.202,79	-0,04%	3.030.144,00	-3.030.144,00	444.219,11	-447.855,28
SBSPP2	16.624.456,60	53.465,43	-32.921,30	-0,03%	3.169.199,97	-3.697.399,97	1.548.682,39	-1.561.359,19
TAE33	8.330.273,15	24.136,58	-12.365,46	-0,01%	919.959,01	-919.959,01	134.865,99	-135.969,94
ABEV3	9.082.133,06	420.464,10	-105.142,68	-0,11%	66.227,87	-66.227,87	38.836,02	-39.153,92
AEGP13	675.209,10	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
AEGP1	1.934.248,62	1.385,64	1.015,12	0,00%	281.228,90	-281.228,90	164.912,62	-166.262,52
AIEC11	2.332.809,30	217.089,77	186.798,70	0,19%	385.994,19	-210.542,29	102.885,00	-103.727,17
ALPA4	104.942,88	57.482,11	50.409,91	0,05%	-796.975,58	484.702,81	520.050,98	-652.882,37
ALSO3	9.525.596,79	1.415.583,13	1.306.393,10	1,32%	-8.010,80	6.582,17	10.439,70	-14.709,32
AMBP13	2.687.017,74	698,62	376,15	0,00%	-345.693,39	82.973,81	142.956,05	-194.681,73
ANEM11	12.791.490,53	176.289,38	150.342,23	0,15%	950.883,02	-950.883,02	278.798,90	-281.081,02
ANET11	2.369.174,00	8.523,65	3.851,70	0,00%	-486.146,31	250.057,44	287.200,45	-365.343,75
ANHB10	639.773,03	29,01	7,12	0,00%	-512.987,20	211.830,55	260.647,63	-340.417,13
APRB28	1.378.657,47	81,28	37,57	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ARZZ3	1.874.643,24	415.754,57	376.853,80	0,38%	-864.073,36	470.103,62	524.891,89	-664.567,48
ASAI3	1.004.351,00	117.765,67	27.575,44	0,03%	12.204,75	-12.204,75	4.473,04	-4.509,65
AURE3	6.992.128,00	372.314,50	135.186,19	0,14%	-86.792,78	81.056,76	111.046,28	-130.034,75
AZUL4	273.894,55	123.833,09	77.176,84	0,08%	-770.352,86	420.690,94	468.345,23	-594.269,30
B3A3	13.891.477,96	2.710.993,92	2.551.615,22	2,59%	-193.470,93	106.386,75	119.419,40	-151.207,19
BBA3	13.877.444,68	1.299.290,78	860.538,85	0,78%	-1,15	1,13	3,19	-4,78
BBD3	987.168,57	130.296,68	125.138,71	0,13%	-155.885,36	4.225,62	52.316,40	-70.198,24
BBD4	13.323.322,65	2.365.528,66	2.200.956,43	2,23%	167.918,57	-167.918,57	98.467,45	-99.273,46
BBS3	3.126.961,14	327.174,31	-121.393,17	-0,12%	-1.125,62	927,92	1.479,88	-2.075,76
BBTOPIND	272.019.228,71	2.329.014,31	2.042.415,69	2,07%	-2.011,18	1.640,07	2.666,18	-3.794,11
BCBF14	265.358,06	11,55	-0,83	0,00%	-2.297,04	1.854,44	3.212,40	-4.638,03
BCBF15	3.017.595,97	155,99	-4,98	0,00%	394.565,50	-394.565,50	116.686,61	-116.633,56
BEF3	2.669.525,32	879.152,38	626.856,88	0,64%	-5.451,80	4.568,08	7.108,08	-9.748,42
BKBR18	1.051.151,46	15,05	-5,67	0,00%	614.482,80	-512.069,00	300.277,26	-302.735,19
BMLC11	3.030.144,00	106.574,23	9.472,01	0,01%	-351.951,01	192.008,53	214.307,58	-270.917,32
BPG111	10.563.989,90	1.847.443,49	1.711.985,24	1,74%	-41.025,10	549,50	13.983,15	-18.730,54
BPML11	919.959,01	82.540,86	-15.115,68	-0,02%	209.108,25	-250.929,90	122.621,08	-123.624,80
BRAP4	2.849.911,47	16.387,75	-40,25	0,00%	84.783,16	-84.783,16	35.512,03	-35.802,72
BRELETR0	299.809,89	70.583,94	-21.953,89	-0,02%	212.908,41	-212.908,41	62.424,75	-62.935,73
BRFS3	1.124.915,58	366.455,35	316.742,43	0,32%	-825.488,71	497.549,17	530.745,98	-666.560,63
BRKM5	701.807,62	166.302,19	166.302,19	0,17%	65.026,45	-91.037,02	38.131,51	-38.443,63
BRKP28	8.940.139,78	152.625,84	133.289,28	0,14%	-28.928,96	29.499,62	135.023,87	-205.502,41
BRKPA0	3.336.937,72	1.147,43	647,76	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
BRST11	6.703.816,03	29.149,40	13.586,95	0,01%	-587.912,94	228.425,76	294.626,72	-384.233,46
ETLG11	1.901.765,03	82.359,15	70.959,91	0,07%	470.593,59	-470.593,59	344.945,10	-347.768,66
ETDW15	5.084.287,08	83.357,08	-27.778,65	0,07%	49,02	-49,93	186,53	254,33
CAEC21	8.738.727,04	54.207,13	38.248,10	0,04%	289,67	-229,93	-452,55	675,32
CAD4	57.000,21	0,00	0,00	0,00%	432.424,39	-432.424,39	288.151,89	-290.510,57
CART13	11.434.559,80	137.749,89	117.796,64	0,12%	0,01	-0,01	-0,04	0,05
CASH3	30.511,87	4.991,25	1.497,15	0,00%	0,02	-0,02	-0,07	0,11
CBAN22	6.547.645,77	32.914,65	27.540,33	0,03%	-5,36	5,45	24,69	-37,49
CBAN32	9.874.627,56	123.733,22	106.145,12	0,11%	5,92	-5,73	-15,95	23,97
CBAN72	2.407.263,96	32.208,25	27.769,67	0,03%	-5.978,43	5.088,35	7.848,67	-10.490,19
CCPRAS	41.674,85	0,07	-0,03	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CCRO3	671.674,29	48.313,25	3.672,19	0,00%	62.056,91	-62.056,91	36.390,17	-36.688,05
CEAB2	538.323,34	159,77	92,41	0,00%	-496.818,42	183.801,21	259.593,85	-324.853,97
CEBA3	1.894.091,85	269,72	121,99	0,00%	-5.590,25	5.672,62	8.663,59	-11.360,95
CELG12	3.339.858,38	282,91	48,33	0,00%	217.702,50	-217.702,50	127.660,75	-128.705,72
CEOC11	789.131,00	52.318,14	37.563,70	0,04%	318.920,36	-391.402,26	212.516,93	-214.256,50
CGBP13	2.163.792,33	884,61	625,70	0,00%	-4.207,63	3.523,68	5.462,77	-7.486,15
CIEL3	2.048.276,01	330.155,22	14.228,79	0,01%	-372.993,64	-18.573,25	119.836,02	-160.404,76
CJEN13	4.739.818,36	55.742,43	47.505,99	0,05%	142.069,46	-106.557,21	52.069,53	-52.495,74
CMIG4	836.433,00	96.350,98	-10.313,59	-0,01%	23.387,91	-23.387,91	6.857,34	-6.913,47
CMIN3	242.237,60	29.279,72	20.942,49	0,02%	81.235,58	-73.619,75	37.216,05	-37.520,69
CNES11	425.816,82	35.393,66	-3.924,71	0,00%	-584.558,56	751.521,47	6.827.380,66	-6.865.698,17
CNRD11	10.188.297,90	146.350,67	126.408					



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



Data: 31/05/2023

**Relatório de Risco de Mercado**

**FUNDO:** EMBRAERPREV - CONSOL. FUNDOS  
**CNPJ:** 10679245000140

Dados Gerais		Limite Fundo:		ENQUADRADO		0,00% Dutation DC:		1,826,15	
PL:	4.353.869.830,20	VAR / PL:	2,2655%	Status:		Dutation DU:			1,256,43
VAR:	98.637.389,49	ETL / PL:	2,8410%	Benchmark:					
ETL:	123.695.265,80	VAR / CDI:	0,0255%						

Cenários de STRESS										
Cenário Alta - 09999 (+):	197.141.810,38	Cenário Baixa - 10000 (+):	297.865.066,33	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	385.117.501,77	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	94.703.947,70			
Cenário Alta - 09999 (-):	(216.514.688,49)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(191.035.252,46)	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	(74.821.480,35)	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(432.683.271,19)			
Cenário Alta - 09999:	(19.372.878,11)	Cenário Baixa - 10000:	106.829.813,87	CENÁRIO BRADESCO 1:	310.296.021,42	CENÁRIO BRADESCO 2:	(337.979.323,49)			

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
COGN3	260.105,78	98.931,36	84.507,23	0,09%	57.691,86	-57.929,71	-138.855,98	133.706,04
COMPROMISSADA_PRE	1.039.304.810,73	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	982.728,70	0,00	0,00	0,00%	-624.610,18	1.003.818,58	12.295.414,71	-12.378.231,59
CONX12	9.958.889,82	61.784,13	44.453,83	0,05%	-1.313.493,82	1.442.986,51	8.371.107,22	-8.398.045,00
CPFE3	2.352.967,96	231.424,80	-84.504,62	-0,06%	562.620,36	-569.795,27	-2.344.154,45	2.337.021,79
CPFT14	149.882,18	1,02	0,71	0,00%	284.221,70	-286.391,77	-927.393,12	916.933,41
CPGT16	300.645,39	33,71	8,33	0,00%	-8.574,77	8.527,27	23.952,55	-23.435,33
CPLE6	1.965.565,42	256.064,15	45.947,51	0,05%	-192,22	156,45	320,19	-472,55
CPMM23C099500	-17,86	24,90	20,80	0,00%	18.132,46	-15.441,75	-34.777,69	51.718,31
CPMM23C099750	-35,73	34,73	26,27	0,00%	-371.044,48	295.455,42	490.774,85	-706.629,19
CPMM23C100000	12.668,22	4.831,29	1.933,65	0,00%	-648.695,04	533.042,62	792.393,64	-1.106.631,37
CPMU23C100000	-1.556,74	446,84	221,02	0,00%	-1.975.171,14	1.668.128,06	2.441.170,31	-3.298.024,66
CPT12	2.118.794,82	1.077,98	839,89	0,00%	-13.684,86	12.102,42	18.121,88	-22.804,88
CREDZM24	1.058.045,85	117.236,87	-53.873,82	-0,05%	-521.876,10	476.673,97	741.048,55	-867.061,67
CRFB3	248.227,64	28.618,60	10.917,30	0,01%	-14.355,32	13.575,30	21.574,57	-23.478,56
CRMG15	8.533.702,99	53.598,90	40.925,90	0,04%	-7.032,11	5.715,83	11.639,40	-17.169,35
CSAN23	1.147.707,99	1.298,05	1.056,70	0,00%	-3.302,24	2.645,68	4.219,03	-8.030,61
CSAN3	870.810,00	102.438,79	91.670,53	0,09%	1.350,24	-1.374,23	-6.221,98	9.437,19
CSMG3	1.449.639,00	189.935,58	158.045,06	0,16%	-438.871,46	346.690,50	645.866,28	-944.505,53
CSMG7	2.150.901,82	686,43	486,86	0,00%	1.060.520,32	-856.193,75	-1.324.520,74	1.879.551,04
CSNA3	355.180,95	40.673,98	-7.318,10	-0,01%	393.474,50	-327.775,35	-480.891,57	660.930,19
CVCB3	46.775,82	13.605,26	11.193,56	0,01%	-413,28	392,31	1.067,08	-1.601,80
CYRE3	253.861,20	55.280,39	46.902,62	0,05%	-7.254,25	5.741,85	10.069,64	-14.608,10
DAFK25	-34.069,08	449.174,42	-398.144,73	-0,40%	213.504,17	-213.646,85	259.975,38	-262.174,98
DAFK27	-1.013,39	37.281,41	-7.107,03	-0,01%	-1.159.148,13	1.178.810,22	-1.502.108,30	1.509.825,08
DAFK35	681,10	16.755,31	-16.175,60	-0,02%	30.147,53	-36.178,39	17.675,51	-17.823,22
DAPM23	0,00	0,00	0,00	0,00%	550.560,00	-550.560,00	322.848,38	-325.491,07
DAPQ24	-3.993,21	780.387,83	-713.087,43	-0,72%	365.802,22	-365.802,22	297.925,59	-300.364,27
DAPQ26	-20.834,14	336.115,87	-224.048,13	-0,23%	-2.078,71	1.684,37	2.844,07	-4.087,16
DAPQ28	1.692,31	94.924,11	-68.061,08	-0,07%	4.733.369,94	-4.733.369,94	2.313.040,11	-2.331.973,59
DAPQ30	3.605,60	69.939,33	-64.842,42	-0,07%	-855.495,50	395.512,96	457.106,77	-595.107,96
DAPQ32	75,89	2.614,70	2.492,53	0,00%	1.423.825,38	-1.423.825,38	695.776,00	-701.471,30
DASAA2	2.604.829,33	21,27	-7,40	0,00%	173.167,59	-173.167,59	101.545,48	-102.376,68
DHF24	221,52	1.904,67	800,71	0,00%	53.296,52	-42.076,20	41.122,47	-41.459,08
DHF25	-8.958,70	49.377,14	1.617,34	0,00%	3.138.327,18	-4.325.802,33	1.243.456,12	-1.253.634,48
DHF26	-572,96	107.334,60	71.148,58	0,07%	572.116,64	-740.396,72	493.374,78	-497.413,32
DHF28	2.385,05	386.834,53	299.353,35	0,30%	-76.861,23	10.710,59	320.929,84	-385.451,11
DHF29	7,23	3.294,84	2.819,49	0,00%	127.278,00	-76.366,80	41.464,34	-41.803,75
DHF31	-26,32	141.207,41	126.158,75	0,13%	-49.462,47	7.265,19	19.250,99	-25.522,15
DHF33	-46,92	4.189,85	3.793,89	0,00%	-2.075.346,81	916.854,75	1.111.925,67	-1.438.586,63
DHJ24	-97,20	832,35	-314,19	0,00%	-166,44	140,22	309,02	-458,10
DHJ25	-35,48	456,20	131,89	0,00%	6.050.121,86	-6.050.121,86	4.434.739,32	-4.471.040,06
DHJ26	-2,63	18,76	6,98	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DHJ28	-7.488,93	53.224,34	-14.138,83	-0,01%	-131.107,24	-1.033,84	43.971,78	-58.774,40
DHJ29	6.844,19	155.679,07	-71.122,68	-0,07%	-453.135,60	-3.571,19	151.976,20	-203.137,34
DHJ28	-705,85	71.632,20	-53.216,20	-0,05%	-46,43	37,43	97,69	-146,43
DHJ23	-91,57	31,56	-14,38	0,00%	-106.183,20	-2.907,91	35.656,54	-47.519,92
DHJ24	-131,33	940,13	-133,80	0,00%	-267.392,29	16.129,25	94.335,84	-125.431,38
DOLM23	17.967,93	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DOLN23	-62.713,76	406.618,93	56.963,00	0,06%	-31,82	32,05	93,57	-140,87
DXCO3	120.590,10	53.848,78	48.069,65	0,05%	35.260,00	-35.260,43	6.461,40	-6.514,29
ECOR3	2.202.240,00	294.250,07	53.271,09	0,05%	16.487,58	-24.731,36	12.085,39	-12.184,32
EGIE3	2.032.234,56	150.865,16	108.564,06	0,11%	62.239,52	-62.241,52	45.623,03	-45.996,48
ELET13	2.057.878,19	261,55	71,84	0,00%	537.285,00	-537.285,00	157.531,96	-158.821,45
ELET3	15.777.899,80	2.256.400,61	2.091.763,85	2,12%	895.281,12	-895.281,12	262.496,42	-264.645,10
ELET6	4.746.084,60	728.723,95	674.904,66	0,68%	-1.890.297,81	2.469.032,40	1.955.195,77	-2.545.015,38
EMBR3	692.670,36	154.712,37	-119.560,75	-0,12%	-442.239,67	314.775,29	320.929,84	-385.451,11
ENBR3	280.508,00	11.695,29	-7.310,01	-0,01%	-47.773,31	-19.783,87	10.695,84	-14.491,23
ENGV3	8.481.965,35	935.524,51	786.994,38	0,80%	1.649.909,03	-1.649.909,03	967.506,66	-975.426,22
ENH11	3.365.448,72	321.544,72	265.592,39	0,27%	3.023.679,24	-3.023.679,24	985.047,50	-993.110,65
ENJ3	282.840,00	79.051,09	62.384,69	0,06%	-1.748,91	1.420,72	2.557,90	-3.711,48
EQLT13	1.449.843,33	18,13	-7,08	0,00%	1.692.865,28	-1.504.769,14	1.378.744,73	-1.390.030,49
EQLT3	30.250.609,30	2.063.871,38	1.458.390,63	1,48%	111.231,23	-92.692,69	54.354,99	-54.799,92
EQLT9	348.975,55	16.824,21	16.824,21	0,02%	54.003,46	-31.502,02	13.194,84	-13.302,85
ERDV17	3.815.777,19	14.308,37	-10.040,75	-0,01%	-416,74	337,69	579,32	-833,88
ERDV18	1.355.806,45	3,36	1,49	0,00%	-505.844,43	240.613,74	274.449,55	-357.053,60
ERDV38	5.824.626,36	21.515,04	1.344,19	0,00%	-961.986,03	456.692,65	520.902,70	-677.684,43
ERDVA0	2.132.210,51	0,00	0,00	0,00%	1.393.906,50	-1.393.906,50	204.346,69	-205.019,38
ETEN13	1.324.795,40	1,56	-0,81	0,00%	-4.022,29	3.282,29	5.399,47	-7.685,74
EUCA4	44.075,00	9.198,39	5.934,80	0,01%	3.136.289,63	-3.136.289,63	1.352.294,29	-1.363.363,55
EZTC3	82.437,88	17.438,54	15.394,85	0,02%	-1.128.053,63	691.184,77	735.874,62	-918.684,17
FLRY3	311.207,58	50.571,74	43.765,28	0,04%	2.770.846,62	-2.770.846,62	406.206,11	-409.531,13
FVPQ11	1.074.570,00	136.310,84	98.250,96	0,10%	-598.090,22	293.986,86	343.505,56	-439.211,69
GALG11	1.790.562,24	167.947,70	148.347,40	0,15%	0,00	0,00	0,00	0,00
GBSP11	4.246.419,77	89.800,14	75.930,58	0,08%	275.408,07	-275.408,70	80.749,83	-81.410,81
GGBR4	6.599.636,13	784.400,30	660.596,45	0,67%	-968.861,32	563.947,51	581.943,23	-733.430,14
GGPS3	6.719.287,20	1.137.458,89	992.792,18	1,01%	185.558,88	-170.338,19	118.912,28	-119.855,64
GGSH12	2.413.881,34	205,05	15,55	0,00%	-182.031,37	98.726,52	110.480,50	-139.802,54
GMAT3	4.904.807,13	3.060.782,33	2.662.842,41	2,70%	-7.602.608,35	4.003.857,19	6.471.637,53	-28.495.242,12
GOAU4	370.770,75	39.732,82	31.720,37	0,03%	9.729.556,45	-4.557.569,33	-6.809.338,37	37.357.425,89
GOLL4	90.005,76	26.129,04	21.518,33	0,02%	-2.045.942,04	833.382,35	1.145.478,94	-8.014.485,77
GRRB14	1.101.552,93	51,14	12,59	0,00%	275.825,51	-357.022,00	-958.991,50	483.159,56
GRRB24	8.353.208,22	57.397,40	41.954,08	0,04%	-289.569,05	360.484,22	955.749,89	-528.741,00
GTLG11	1.393.906,50	54.289,40	17.468,43	0,02%	5.308.560,88	-5.005.414,92	-11.889.315,20	13.522.860,80
GUAR15	2.638.726,64	521,77	222,45	0,00%	-5.395.408,48	5.018.592,43	11.842.223,35	-13.965.768,37
HAPV3	9.224.361,25	5.948.174,10	5.576.834,16	5,65%	-1.855.726,30	1.458.741,40	3.347.579,21	-4.556.728,60
HARG11	13.907.275,77	198.071,02	169.791,39	0,17%	1.686.049,75	-1.476.532,86	-3.377.405,79	4.670.449,82



Data: 31/05/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: EMBRAERPREV - CONSOL. FUNDOS  
CNPJ: 10679245000140

		Dados Gerais				0,00% Dutation DC:		1,826,15	
PL:	4.353.869.830,20	VAR / PL:	2,2655%	Limite Fundo:		ENQUADRADO	Dutation DC:		1,826,15
VAR:	98.637.389,49	ETL / PL:	2,8410%	Status:			Dutation DU:		1,256,43
ETL:	123.695.265,80	VAR / CDI:	0,0255%	Benchmark:					

Cenários de STRESS										
Cenário Alta - 09999 (+):	197.141.810,38	Cenário Baixa - 10000 (+):	297.865.066,33	CENARIO BRADESCO 1 (+):	385.117.501,77	CENARIO BRADESCO 2 (+):	94.703.947,70			
Cenário Alta - 09999 (-):	(216.514.688,49)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(191.035.252,46)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(74.821.480,35)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(432.683.271,19)			
Cenário Alta - 09999:	(19.372.878,11)	Cenário Baixa - 10000:	106.829.813,87	CENARIO BRADESCO 1:	310.296.021,42	CENARIO BRADESCO 2:	(337.979.323,49)			

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
HBRH11	2.770.846,62	103.432,51	61.764,19	0,06%	1.513.735,22	-1.494.461,53	-3.621.547,41	3.638.024,25
HBSA21	7.522.174,67	77.008,76	77.008,76	0,08%	-1.901.829,83	1.636.263,19	3.706.457,14	-5.367.698,36
HSLG11	931.443,87	0,00	0,00	0,00%	-86.291,78	648,00	648,00	-941.610,08
HSM11	550.817,40	24.046,87	15.078,96	0,02%	37.306,71	-647,86	-648,00	877.807,33
HVRD15	10.495.406,49	160.726,47	139.437,44	0,14%	-30.064,97	3.387.292,55	27.135.337,46	-30.065,00
HYPE3	811.134,22	134.390,10	106.612,07	0,11%	3.045.909,84	-3.696.597,10	-23.147.900,99	9.434.020,56
HZT14	2.404.727,33	28.760,83	24.523,40	0,02%	3.027.241,91	-3.348.556,38	-17.242.835,79	15.908.700,57
IDF24C382500	-7.569.936,00	630.354,75	-264.997,19	-0,27%	-3.382.294,90	3.454.915,88	15.743.136,33	-23.394.015,81
IDF24C382600	7.413.630,00	765.116,07	321.650,01	0,33%	-59.266,53	60.458,41	274.847,01	-411.395,62
IDF24C382700	-1.192.347,00	151.186,72	-63.557,95	-0,06%	121.757,40	-124.125,98	-563.640,90	846.806,16
IDF24P380200	-520.781,00	36.903,29	15.513,91	0,02%	-62.361,44	63.550,41	288.380,72	-434.210,00
IDF24P380300	584.116,00	37.855,44	-15.914,19	-0,02%	-190.322,36	95.338,54	111.304,60	-141.508,52
IDF24P381200	-31.079.037,00	590.008,52	248.036,89	0,25%	4.667,41	-3.657,77	-5.441,65	9.526,41
IDF24P381300	53.802.948,00	595.078,46	-250.167,26	-0,25%	1.024.904,70	-1.024.904,70	751.255,15	-757.404,58
IDF24P381800	25.064.571,00	177.179,49	-74.485,16	-0,08%	1.690.870,45	-1.690.048,40	1.362.277,38	-1.371.860,60
IDF24P381900	-29.872.376,01	179.827,39	75.598,31	0,08%	0,00	0,00	0,00	0,00
IDF24P382400	-6.265.014,01	172.768,47	72.630,79	0,07%	-616.018,53	301.315,88	354.956,44	-451.506,22
IDF24P382500	70.459.283,88	200.885,98	-84.451,21	-0,09%	-573.011,67	102.358,33	226.841,29	-300.207,68
IDIN23C359100	-648,00	93,10	-34,65	0,00%	99.738,60	-84.394,60	22.494,89	-22.679,02
IDIN23C359200	648,00	53,94	20,08	0,00%	-1.257.991,30	814.893,47	842.476,31	-1.051.027,55
IDIN23P358900	30.065,00	3.609,55	-1.343,38	0,00%	1.155.517,89	-1.155.587,16	891.626,73	-898.925,17
IDIN23P359000	-9.650.016,02	47.692,25	17.749,77	0,02%	7.785.475,57	-7.396.201,79	5.706.753,59	-5.753.466,45
IDIN23P359100	-23.874.032,34	43.872,03	16.327,99	0,02%	-236,95	193,15	376,68	-562,70
IDIN23P359200	539.551.065,46	47.076,42	-17.520,57	-0,02%	330.838,20	-330.838,20	138.573,94	-139.708,25
IDIN23P359300	14.118.776,00	824,35	-306,60	0,00%	-246.424,94	117.467,92	139.331,09	-178.456,62
IDIN23P359400	-38.105.515,00	1.693,02	630,09	0,00%	182.505,02	-146.004,02	107.020,94	-107.396,97
IDIN23P359500	23.848.442,00	866,96	-322,66	0,00%	-675.908,70	309.940,64	376.238,51	-482.026,46
IGTA37	2.130.348,13	596,43	91,71	0,00%	-1.395,09	1.128,25	2.041,89	-2.965,14
IGTI11	5.124.623,52	478.855,79	404.476,31	0,41%	-5.685,87	4.671,87	7.409,86	-10.440,32
INDM23	-43.172,00	855.989,07	822.778,03	0,83%	-977.857,96	473.049,96	556.914,81	-712.755,63
INSSSN11	1.743.010,74	44.302,62	-17.941,40	-0,02%	0,00	0,00	0,00	0,00
IPIL11	9.151.042,58	85.521,67	71.034,67	0,07%	0,00	0,00	0,00	0,00
IRBR12	11.457.194,86	52.780,23	20.696,13	0,02%	0,00	0,00	0,00	0,00
IRBR3	153.444,00	176.937,84	146.511,62	0,15%	0,00	0,00	0,00	0,00
ITPO14	13.578.534,12	238.584,16	207.436,12	0,21%	0,00	0,00	0,00	0,00
ITSA4	6.062.037,70	486.233,93	404.679,03	0,41%	0,00	0,00	0,00	0,00
ITUSA	38.927.377,86	3.406.649,98	2.791.274,39	2,83%	0,00	0,00	0,00	0,00
IVIA35	1.290.551,64	27,38	-6,52	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
JBSS3	945.252,00	79.080,85	28.288,66	0,03%	0,00	0,00	0,00	0,00
JMSL85	3.223.262,38	35.625,21	30.209,16	0,03%	2.995,89	-2.310,80	-4.328,94	6.631,66
KLBN11	730.020,08	128.928,39	114.155,03	0,12%	4.557,43	-3.515,28	-6.578,56	10.078,17
LAMEA6	8.762.254,19	97.813,62	83.101,01	0,08%	3.079,77	-2.375,88	-4.423,69	6.777,71
LCAMA9	1.982.428,78	163,95	9,85	0,00%	-13.258,66	10.950,81	17.344,90	-24.363,44
LCAMC3	3.017.014,35	814,42	459,77	0,00%	-604.351,18	-40.772,41	181.383,93	-242.455,02
LCAMD1	12.609.839,69	144.340,27	122.899,31	0,12%	-214.612,95	5.082,38	73.676,81	-98.122,58
LF0021003C1	2.510.169,59	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0021006S0	1.210.214,14	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002100E1F	1.245.461,78	0,00	0,00	0,00%	-36.525,14	44.033,22	223,82	-340,76
LF002100HDP	1.441.289,10	0,00	0,00	0,00%	-85.822,48	117.324,53	995,77	-1.515,95
LF002100HDQ	2.625.653,06	0,00	0,00	0,00%	-56.237,16	92.245,13	1.786,86	-2.719,78
LF002100ISJ	2.691.824,38	0,00	0,00	0,00%	-239.467,81	523.809,88	21.784,80	-33.143,61
LF00220018H	1.216.518,45	0,00	0,00	0,00%	-12.377,52	27.982,32	1.220,04	-1.855,85
LF002200IO9	2.295.754,27	0,00	0,00	0,00%	-52.318,72	128.652,31	10.121,33	-15.357,63
LFSC1900089	3.437.572,24	0,00	0,00	0,00%	-91,81	84,99	221,82	-332,50
LFSC190054B	839.105,19	0,00	0,00	0,00%	-2.491,94	2.079,75	3.212,16	-4.425,31
LFSC190059S	1.270.963,44	0,00	0,00	0,00%	-299.291,60	43.537,94	114.515,01	-151.736,13
LFSC19005L1	840.786,75	0,00	0,00	0,00%	-488.937,38	238.974,17	283.453,48	-362.759,71
LFSC22002IX	5.050.847,06	1.950,70	1.165,55	0,00%	1.518.290,34	-1.518.290,34	-1.122.906,82	-1.122.016,56
LFNS210029N	4.136.891,75	0,00	0,00	0,00%	-203,11	168,12	351,09	-517,71
LFT20230901 - 210100	85.620.033,84	2.458,90	-374,67	0,00%	-1.248,90	1.525,11	6.367,04	-9.657,02
LFT20240301 - 210100	18.610.168,54	911,38	-309,92	0,00%	-22.658,38	19.309,38	43.473,86	-64.650,41
LFT20240901 - 210100	23.871.418,23	3.787,54	699,98	0,00%	-709.156,42	613.175,94	918.570,74	-1.302.898,17
LFT20250901 - 210100	9.404.885,85	5.623,51	1.724,99	0,00%	-377.768,72	361.974,72	498.182,90	-683.720,69
LFT20260301 - 210100	39.489.855,48	40.570,71	22.285,09	0,02%	192.397,75	-192.397,75	70.513,78	-71.090,97
LFT20260901 - 210100	1.763.276,65	2.079,57	1.146,32	0,00%	2.093.640,00	-2.093.640,00	613.855,25	-618.879,98
LFT20290301 - 210100	3.788.851,58	7.941,16	4.904,40	0,00%	420.119,51	-420.119,51	205.298,40	-206.978,68
LIGHB4	2.223.676,94	7,62	-3,39	0,00%	635.073,75	-635.073,75	186.203,62	-187.727,80
LIGHD3	878.272,60	404,52	281,07	0,00%	233.855,40	-233.855,40	171.416,01	-172.819,14
LIGHD7	5.951.371,37	26.654,45	9.005,14	0,01%	1.990.391,21	-1.722.453,93	561.137,21	-565.730,42
LORTA7	6.231.450,17	74.458,22	63.595,03	0,06%	-5.934,45	4.991,80	7.677,31	-10.459,37
LTREN3	7.591.451,70	2.545.186,36	2.049.107,15	2,08%	-654.698,32	313.094,04	370.758,76	-474.791,90
LREN81	1.405.312,48	22,27	-6,28	0,00%	38.525,28	-28.893,96	14.119,52	-14.235,09
LTN20230701 - 100000	2.215.010,08	100,84	-80,71	0,00%	1.033.107,26	-1.033.141,43	504.845,08	-508.977,51
LTN20240101 - 100000	2.325.407,29	2.208,78	-766,60	0,00%	-749.423,59	303.717,14	392.352,29	-507.128,21
LTN20250701 - 100000	15.896.967,29	108.846,52	49.066,94	0,05%	1.050.396,98	-876.330,82	513.293,99	-817.495,58
LTN20260701 - 100000	5.795.974,38	72.560,52	52.589,91	0,05%	-443.983,37	209.965,94	239.947,55	-312.036,00
LWISA3	490.394,38	218.456,68	192.537,79	0,20%	471.199,98	-471.199,98	138.155,83	-139.285,71
MALL11	4.187.280,00	318.372,49	292.230,95	0,30%	854.997,84	-854.997,84	125.342,68	-126.368,68
MATD3	1.400.398,35	242.844,61	194.053,50	0,20%	217.790,40	-217.790,40	53.213,45	-53.649,04
MAXR11	1.270.147,50	81.198,50	47.059,90	0,05%	1.291.735,28	-1.291.735,28	757.473,57	-763.673,90
MIAU3	1.169.277,00	545.763,76	473.802,51	0,48%	-604.248,35	213.867,36	295.872,68	-385.556,28
MGLU3	3.827.675,40	910.312,21	718.957,80	0,73%	-238.964,54	250.309,70	198.477,11	-265.146,62
MOVIZ7	1.192.264,83	1.011,85	743,09	0,00%	-1.907.955,12	1.998.537,82	1.584.692,96	-2.116.999,72
MOVIZ37	8.522.661,38	95.080,19	80.699,52	0,08%	-273.058,84	245.202,41	210.041,97	-279.173,61
MRFV3	96.313,20	13.299,82	9.554,51	0,01%	-509.315,43	533.655,41	393.355,81	-518.208,19
MIRVE3	3.443.690,88	1.225.127,69	1.009.523,56	1,02%	-1.334.334,37	1.398.101,68	1.	



Data: 31/05/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: EMBRAERPREV - CONSOL. FUNDOS  
CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais		Limite Fundo:		ENQUADRADO		0,00% Dutation DC:		1,826,15	
PL:	4.353.869.830,20	VAR / PL:	2,2655%	Status:		Dutation DU:			1,256,43
VAR:	98.637.389,49	ETL / PL:	2,8410%	Benchmark:					
ETL:	123.695.265,80	VAR / CDI:	0,0255%						

Cenários de STRESS										
Cenário Alta - 09999 (+):	197.141.810,38	Cenário Baixa - 10000 (+):	297.865.066,33	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	385.117.501,77	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	94.703.947,70			
Cenário Alta - 09999 (-):	(216.514.688,49)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(191.035.252,46)	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	(74.821.480,35)	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(432.683.271,19)			
Cenário Alta - 09999:	(19.372.878,11)	Cenário Baixa - 10000:	106.829.813,87	CENÁRIO BRADESCO 1:	310.296.021,42	CENÁRIO BRADESCO 2:	(337.979.323,49)			

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
MULT3	3.501.323,28	145.857,46	54.506,18	0,06%	-473.791,35	563.336,93	411.481,13	-533.217,41
NEWL11	942.399,95	13.569,57	3.542,26	0,00%	-1.449.834,92	1.722.059,24	1.284.314,78	-1.638.096,19
NEUW11	854.997,84	192.206,45	-176.849,44	-0,18%	-17.512.297,67	23.473.014,35	17.622.368,98	-21.631.335,00
NINJ3	362.994,00	115.901,64	99.979,56	0,10%	-2.535.270,22	3.944.380,74	2.864.774,16	-3.378.994,66
NTCO3	5.166.941,10	1.727.109,48	1.031.962,48	1,05%	-19.237.607,36	38.611.574,43	25.543.229,74	-29.190.896,64
NTEN11	10.272.553,63	59.421,95	42.324,03	0,04%	-1.299.437,97	2.283.396,62	1.615.696,34	-1.794.246,45
NTNB20240815 - 760199_NEGOCIACAO	15.181.809,94	151.851,38	-138.495,63	-0,14%	73.267.194,13	128.859.246,39	91.099.028,96	-101.166.354,59
NTNB20250515 - 760199_NEGOCIACAO	12.039.766,20	129.767,44	-115.182,44	-0,12%	-24.460.904,92	43.781.439,36	30.923.953,59	-33.578.277,93
NTNB20260815 - 760199_NEGOCIACAO	16.193.316,08	108.181,54	-77.330,24	-0,08%	-12.034,62	10.449,39	15.981,30	-20.628,72
NTNB20270515 - 760199_NEGOCIACAO	6.697.526,69	31.699,70	-11.830,08	-0,01%	-12.759,86	10.686,10	16.587,81	-22.773,85
NTNB20280815 - 760199_NEGOCIACAO	11.178.418,42	66.467,99	41.852,52	0,04%	-608.183,89	54.331,88	220.961,95	-293.448,58
NTNB20500815 - 760199_NEGOCIACAO	12.879.182,80	356.033,93	337.540,12	0,34%	0,00	0,00	0,00	0,00
NTSD35	1.903.140,22	2.479,65	2.067,01	0,00%	-1.621,46	1.310,52	2.249,67	-3.240,90
OMGE13	4.679.530,78	2.081,18	1.471,44	0,00%	-6.200,07	5.183,57	7.970,98	-10.942,47
OUTRAS DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-587.478,35	183.677,39	277.734,71	-362.530,97
OVSIA10	1.590.693,96	187,52	41,83	0,00%	3.049.311,85	-3.049.311,85	894.056,23	-991.376,58
PALFA1	2.571.792,03	1.023,09	722,86	0,00%	22.936,24	-20.387,77	18.690,29	-18.833,20
PASN12	11.636.300,70	51.278,49	32.075,63	0,03%	2.249.666,57	-2.699.599,88	1.319.204,48	-1.330.002,88
PATC11	6.098.623,70	784.567,87	630.122,76	0,64%	5.933.393,08	-17.120.071,70	3.479.341,70	-3.507.821,99
PCAR3	127.423,56	30.096,05	27.463,07	0,03%	-403.660,91	-56.742,08	113.407,24	-152.380,46
PETR3	8.998.666,28	1.220.546,78	1.057.705,49	1,07%	211.821,44	-211.821,44	124.212,09	-125.228,83
PETRA4	23.733.572,32	3.371.262,04	2.940.095,27	2,98%	9.381.729,16	-9.381.729,16	2.292.269,16	-2.311.032,62
PETZ3	847.285,75	219.897,04	178.398,81	0,18%	-30,37	26,24	62,32	-92,95
PRIO3	15.636.215,27	2.456.767,79	1.904.279,75	1,93%	2.487.143,18	-2.487.143,18	729.230,38	-735.199,52
PRLG14	2.356.068,07	2,94	0,00	0,00%	-187.074,31	13.400,04	66.919,61	-88.985,11
QAGRI11	4.974.295,36	407.893,71	370.403,88	0,38%	1.293.892,94	-1.293.892,94	941.093,52	-948.798,68
QUAT21	3.947.728,65	16.257,10	1.127,80	0,00%	-1.345.022,84	837.331,37	894.448,61	-1.103.750,47
RADL3	6.419.464,68	668.516,97	635.926,33	0,64%	5.267.382,97	-3.862.747,51	1.715.996,32	-1.730.042,67
RAHD11	15.607.175,16	240.197,71	204.737,52	0,21%	75.610,00	-75.610,00	31.669,79	-31.929,02
RAIL3	11.705.295,48	740.321,32	616.744,82	0,63%	0,00	0,00	0,00	0,00
RAIZ4	216.028,56	50.569,23	43.819,81	0,04%	3.051.862,04	-3.051.862,04	447.402,98	-451.065,21
RBCAPMZ	663.992,02	10.850,83	-179,89	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
RBRL11	3.051.862,04	533.298,87	469.279,84	0,48%	-2.571,72	2.088,59	3.517,77	-5.040,36
RRCB11	5.231.155,77	915.647,93	793.496,32	0,80%	1.212.710,40	-1.212.724,34	592.611,15	-597.461,99
RDCO10	2.295.655,19	320,15	107,33	0,00%	-8.259,97	5.389,36	8.231,11	-10.791,35
RDOB13	4.042.368,00	1.438.194,53	1.336.746,72	1,38%	-321.194,99	177.465,00	198.469,36	-248.762,02
RDOB9	1.137.184,33	1.233,77	1.004,83	0,00%	2.258.429,14	-2.258.429,14	551.609,52	-556.326,38
RDOE11	4.013.004,90	51.626,73	44.009,84	0,04%	7.795.539,42	-6.141.940,15	3.463.109,33	-3.491.456,75
RECV3	3.764.048,57	577.135,24	333.538,86	0,34%	0,00	0,00	0,00	0,00
RENT3	23.622.846,72	3.224.886,37	3.075.177,07	3,12%	-523,59	428,01	820,33	-1.199,66
RENT9	58.193,52	7.950,38	7.564,92	0,01%	-1.197.195,05	863.847,75	873.141,40	-1.055.844,07
RLOG11	1.547.721,79	59,57	59,57	0,00%	-20.301,00	-20.301,00	5.952,25	-6.000,98
RMSA12	10.637.144,17	252.592,48	216.339,50	0,22%	211.575,92	-211.575,92	51.695,05	-52.118,20
RNGO11	40.602,00	1.753,92	805,46	0,00%	-402,78	327,74	696,61	-866,25
RRRP3	352.626,54	104.359,72	90.072,31	0,09%	-497.021,46	181.273,71	247.772,87	-321.588,40
RROB13	898.372,26	46,95	1,48	0,00%	108.843,60	-108.843,60	73.916,36	-74.523,42
RSAN44	8.047.446,11	52.477,45	39.738,15	0,04%	-128,36	110,66	267,05	-308,23
SANB11	504.218,00	70.606,52	65.251,28	0,07%	800.796,31	-800.796,31	469.588,96	-473.430,78
SBFC11	1.747.793,84	12,70	-5,34	0,00%	-502.924,10	-6.255,43	171.504,43	-229.734,15
SBSB3	3.203.185,25	479.979,27	325.983,64	0,33%	-5.958,06	4.907,46	7.714,21	-10.804,69
SBSB7	2.520.121,21	876,92	527,60	0,00%	71.516,40	-71.516,40	17.473,84	-17.616,87
SCAR3	119.194,00	22.402,23	15.395,43	0,02%	54.374,39	-54.374,39	26.570,95	-26.788,45
SLCE3	181.247,97	9.079,88	-3.466,67	0,00%	-10.986,58	9.143,86	14.187,27	-19.603,52
SMFT16	3.981.781,41	1.738,62	1.178,11	0,00%	1.025.652,00	-1.025.652,00	375.901,46	-378.978,41
SMFT3	2.564.130,00	642.282,27	530.051,29	0,54%	77.085,50	-77.085,50	37.669,12	-37.977,46
SMTO3	256.951,68	44.336,46	36.423,69	0,04%	676,17	712,72	1.336,93	-1.953,52
SNCO18	2.125.265,81	100,53	5,24	0,00%	-803,76	-603.755,64	295.025,76	-297.440,70
SOMA3	2.012.454,00	647.187,90	572.382,90	0,58%	421.382,50	-421.382,50	176.499,07	-177.943,81
STBP3	1.203.950,00	210.091,81	178.144,52	0,18%	3.718.284,91	-2.974.627,93	2.180.402,27	-2.198.250,04
SUZB3	14.873.139,64	2.785.103,63	2.080.324,08	2,11%	100.007,05	-100.007,05	58.644,13	-59.124,17
TAE111	400.028,20	30.120,61	23.083,21	0,02%	-196.695,39	-8.553,13	64.538,87	-86.650,92
TCI11	13.404.119,29	224.331,61	190.864,35	0,19%	-1.238.050,18	783.558,44	834.101,07	-1.022.184,44
TEPP11	4.896.116,28	606.153,48	564.014,20	0,57%	2.448.058,14	-2.448.058,14	717.770,65	-723.645,99
TIMS3	2.668.830,92	149.236,98	-53.864,52	-0,05%	854.025,89	-613.831,11	391.250,61	-394.453,21
TOTS3	2.808.615,32	489.562,56	343.630,31	0,35%	561.723,06	-561.723,06	411.743,01	-415.113,34
TRFX11	6.973.834,52	139.146,84	74.480,77	0,08%	3.486.917,26	-3.486.917,26	1.022.354,14	-1.030.732,74
TRFX13	51.121,70	1.020,02	545,98	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
UGEL11	1.083.706,83	172,02	71,17	0,00%	-1.336,15	1.091,73	1.813,35	-2.585,78
UGPA3	7.687.692,91	1.002.781,77	919.390,11	0,93%	1.921.923,23	-1.537.538,58	1.127.015,78	-1.136.241,01
UNEG11	6.560.033,89	124.148,16	106.598,10	0,11%	-616.985,57	428.142,24	436.578,41	-535.418,60
USIM5	983.719,62	131.969,29	107.651,05	0,11%	383.650,65	-216.418,32	144.213,30	-145.393,76
UTPS21	6.415.025,46	103.413,62	89.571,29	0,09%	-588.773,75	350.901,57	369.125,23	-461.203,37
UTPS22	2.753.246,21	46.924,85	40.730,78	0,04%	-247.006,97	158.685,82	165.329,83	-206.227,49
VAES3	39.812.781,87	2.812.578,99	-1.410.983,90	-1,43%	9.953.195,47	-9.953.195,47	5.836.553,82	-5.884.329,16
VAMO22	1.101.408,46	95,18	24,64	0,00%	-790,76	644,56	1.122,75	-1.618,02
VAMO3	1.539.252,00	236.138,04	31.574,22	0,03%	538.738,20	-615.700,80	225.654,34	-227.501,45
VAMO33	10.662.663,61	199.111,73	92.193,24	0,09%	-760.308,38	363.753,94	429.329,51	-550.505,92
VAMO34	7.026.673,46	80.123,94	68.157,55	0,07%	-544.581,32	312.262,16	10.172,08	-396.951,25
VBRB3	11.039.944,33	3.132.137,24	2.489.020,20	2,52%	2.759.986,08	-2.760.054,70	1.618.455,84	-1.631.703,77
VCCS11	1.219.302,71	923,15	707,48	0,00%	-5.100,40	4.323,92	6.595,75	-8.878,12
VECS11	1.763.773,01	80,35	-6,99	0,00%	-677,94	546,72	1.015,12	-1.480,13
VERDEC52	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
VERO12	3.328.467,57	23.011,20	17.464,32	0,02%	-206.504,25	87.952,16	107.842,67	-140.129,53
VIAI3	186.058,88	59.553,37	52.150,23	0,05%	83.718,68	-83.726,50	27.276,23	-27.499,50
VIMT13	7.233.078,92	97.567,94	83.789,98	0,08%	-566.692,99	338.948,13	362.719,65	-454.798,91



Data: 31/05/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: EMBRAERPREV - CONSOL. FUNDOS									
CNPJ: 10679245000140									
Dados Gerais									
PL:	4.353.869.830,20	VAR / PL:	2,2655%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	1,826,15		
VAR:	98.637.389,49	ETL / PL:	2,8410%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1,256,43		
ETL:	123.695.265,80	VAR / CDI:	0,0255%	Benchmark:					
Cenários de STRESS									
Cenário Alta - 09999 (+):	197.141.810,38	Cenário Baixa - 10000 (+):	297.865.066,33	CENARIO BRADESCO 1 (+):	385.117.501,77	CENARIO BRADESCO 2 (+):	94.703.947,70		
Cenário Alta - 09999 (-):	(216.514.688,49)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(191.035.252,46)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(74.821.480,35)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(432.683.271,19)		
Cenário Alta - 09999:	(19.372.878,11)	Cenário Baixa - 10000:	106.829.813,87	CENARIO BRADESCO 1:	310.296.021,42	CENARIO BRADESCO 2:	(337.979.323,49)		
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	
VIXL14	2.084.630,31	152,23	17,63	0,00%	-1.300,51	1.060,05	1.912,44	-2.773,57	
VRDN12	4.960.078,84	58.764,08	50.194,32	0,05%	-371.544,79	201.076,84	224.875,85	-285.060,94	
VVED15	1.650.171,83	331,09	178,37	0,00%	-2.365,56	1.939,23	3.107,90	-4.388,72	
VVEO16	1.065.345,98	262,06	152,65	0,00%	-1.809,78	1.489,20	2.355,23	-3.307,77	
WDOM23	-17.967,93	0,00	0,00	0,00%	-213.504,17	213.646,85	-259.975,38	262.174,98	
WDON23	-7.036,18	45.620,65	6.390,97	0,01%	-130.050,77	132.256,76	-168.529,22	169.395,01	
WEGE3	7.348.805,95	480.136,23	-296.511,88	-0,30%	1.837.201,49	-1.837.201,49	1.077.334,95	-1.086.153,52	
WINM23	-2.108,40	41.804,12	40.182,18	0,04%	82.577,39	-82.537,25	66.529,83	-66.997,84	
XPIN11	3.277.547,69	384.887,07	325.465,03	0,33%	1.638.773,85	-1.638.773,85	480.488,49	-484.421,55	
XPML11	13.887,69	669,98	46,99	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
XPML12	45,24	21,06	10,49	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
XPFR11	2.127.361,00	350.286,55	292.329,90	0,30%	1.063.680,50	-1.063.680,50	311.871,12	-314.423,96	
VDUQ3	206.463,18	129.647,62	122.377,98	0,12%	80.520,64	-51.615,80	30.267,50	-30.515,26	
<b>Total Var:</b>	<b>5.140.338.264,41</b>	<b>137.003.167,99</b>	<b>98.637.389,49</b>	<b>99,97%</b>	<b>-19.372.878,11</b>	<b>106.829.813,87</b>	<b>310.296.021,41</b>	<b>-337.979.323,49</b>	



Data: 31/05/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: EMBRAERPREV RENDA FIXA									
CNPJ: 10679245000140									
Dados Gerais									
PL:	3.201.880.534,30	VAR / PL:	1,2870%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	2,371,02		
VAR:	41.206.714,96	ETL / PL:	1,6139%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1,631,16		
ETL:	51.674.882,98	VAR / CDI:	0,0145%	Benchmark:					
Cenários de STRESS									
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (+):	266.467.006,50	CENARIO BRADESCO 1 (+):	221.436.101,08	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-		
Cenário Alta - 09999 (-):	(184.172.511,08)	Cenário Baixa - 10000 (-):	-	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(251.134.139,65)		
Cenário Alta - 09999:	(184.172.511,08)	Cenário Baixa - 10000:	266.467.006,50	CENARIO BRADESCO 1:	221.436.101,08	CENARIO BRADESCO 2:	(251.134.139,65)		
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	
CAIXA	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
FI RF EMB II	2.670.486.121,04	38.887.251,97	38.817.245,76	94,20%	-146.743.777,87	246.820.309,81	175.274.591,52	-198.406.024,24	
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	160.434.154,15	406.737,02	24.933,96	0,06%	-6.139.520,32	1.424.387,80	2.733.409,30	-3.593.272,57	
FIM EMB VI A CRED PRIV	252.144.670,30	1.363.584,30	-873.451,74	-2,12%	-6.146.179,95	5.282.012,13	28.535.862,31	-30.317.801,35	
FIM EMB VII A CRED PRIV	342.109.134,67	3.682.572,44	3.237.986,98	7,86%	-25.143.032,94	12.940.296,75	14.892.237,95	-18.817.041,49	
<b>Total Var:</b>	<b>3.425.174.080,16</b>	<b>44.340.145,73</b>	<b>41.206.714,96</b>	<b>100,00%</b>	<b>-184.172.511,08</b>	<b>266.467.006,50</b>	<b>221.436.101,08</b>	<b>-251.134.139,65</b>	



Data: 31/05/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO:		EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL							
CNPJ:		10679245000140							
<b>Dados Gerais</b>									
PL:	529.065.245,68	VAR / PL:	11,0790%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	1,17		
VAR:	58.614.909,89	ETL / PL:	13,8935%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1,12		
ETL:	73.505.461,74	VAR / CDI:	0,1246%	Benchmark:					
<b>Cenários de STRESS</b>									
Cenário Alta - 09999 (+):	133.892.829,02	Cenário Baixa - 10000 (+):	-	CENARIO BRADESCO 1 (+):	70.166.987,48	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-		
Cenário Alta - 09999 (-):	-	Cenário Baixa - 10000 (-):	(132.341.138,66)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(70.745.753,85)		
Cenário Alta - 09999:	133.892.829,02	Cenário Baixa - 10000:	(132.341.138,66)	CENARIO BRADESCO 1:	70.166.987,48	CENARIO BRADESCO 2:	(70.745.753,85)		
<b>Parâmetros do Cálculo</b>									
Modelo:	VaR paramétrico	Modelo Volatilidade:	EWMA						
Int. Confiança:	95	Lâmbda:	0,94						
Horizonte:	21								
<b>Produto</b>	<b>MM</b>	<b>VAR Tot.</b>	<b>Comp. VAR</b>	<b>Comp. VAR (%)</b>	<b>Cenário Alta - 09999</b>	<b>Cenário Baixa - 10000</b>	<b>CENARIO BRADESCO 1</b>	<b>CENARIO BRADESCO 2</b>	<b></b>
CAIXA	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FIA RVA EMB II	220.636.555,12	23.121.031,96	23.088.706,30	39,39%	56.778.654,63	-57.453.833,23	31.782.706,81	-32.042.998,53	
FIA RVA EMB III	95.198.672,05	12.161.375,28	12.126.357,14	20,69%	25.655.140,62	-25.344.838,75	11.930.275,19	-12.032.163,41	
FIA RVA EMB IV	89.809.698,31	11.860.720,34	11.742.650,33	20,03%	26.000.386,44	-23.756.350,34	12.069.979,14	-12.169.271,91	
FIC FIA EMB VIII ETF	24.352.789,24	2.219.899,22	2.208.053,07	3,77%	0,00	0,00	0,00	0,00	
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA E	99.067.022,61	9.479.426,53	9.449.143,06	16,12%	25.461.647,33	-25.786.116,34	14.384.026,35	-14.501.320,00	
<b>Total Var:</b>	<b>529.064.737,32</b>	<b>58.842.453,32</b>	<b>58.614.909,89</b>	<b>100,00%</b>	<b>133.892.829,02</b>	<b>-132.341.138,66</b>	<b>70.166.987,48</b>	<b>-70.745.753,85</b>	

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO:		FI RF EMB II							
CNPJ:		11005764000196							
<b>Dados Gerais</b>									
PL:	2.530.714.709,96	VAR / PL:	1,5366%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	2,660,84		
VAR:	38.887.254,28	ETL / PL:	1,9270%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1,830,52		
ETL:	48.766.185,71	VAR / CDI:	0,0173%	Benchmark:					
<b>Cenários de STRESS</b>									
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (+):	246.899.390,67	CENARIO BRADESCO 1 (+):	175.274.601,92	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-		
Cenário Alta - 09999 (-):	(146.743.786,57)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(79.066,22)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(198.406.036,01)		
Cenário Alta - 09999:	(146.743.786,57)	Cenário Baixa - 10000:	246.820.324,45	CENARIO BRADESCO 1:	175.274.601,92	CENARIO BRADESCO 2:	(198.406.036,01)		
<b>Parâmetros do Cálculo</b>									
Modelo:	VaR paramétrico	Modelo Volatilidade:	EWMA						
Int. Confiança:	95	Lâmbda:	0,94						
Horizonte:	21								
<b>Produto</b>	<b>MM</b>	<b>VAR Tot.</b>	<b>Comp. VAR</b>	<b>Comp. VAR (%)</b>	<b>Cenário Alta - 09999</b>	<b>Cenário Baixa - 10000</b>	<b>CENARIO BRADESCO 1</b>	<b>CENARIO BRADESCO 2</b>	<b></b>
CAIXA	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
CSMG3	13.368.911,94	39.007,38	-23.896,16	-0,06%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
ELET42	13.938.412,37	96.342,15	72.778,79	0,19%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
ENTV12	13.602.065,84	109.747,96	89.229,36	0,23%	-17.693,91	18.042,95	82.585,08	-125.692,10	
GASP17	49.760.423,75	1.093.275,47	-337.925,09	-0,87%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IGSN15	2.659.039,11	28.229,31	24.091,14	0,06%	-372.993,64	-18.573,25	119.836,02	-160.404,76	
NEOE16	7.262.009,14	50.981,43	38.946,07	0,10%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
NTNB20240815 - 760199_VENCIMENTO	121.215.525,65	1.212.420,95	-975.736,42	-2,51%	-855.495,50	395.512,96	457.106,77	-595.107,96	
NTNB20260815 - 760199_VENCIMENTO	42.424.197,23	283.420,34	-165.036,10	-0,42%	-896.639,49	396.120,87	480.399,93	-621.531,58	
NTNB20300815 - 760199_VENCIMENTO	26.647.463,71	308.437,76	279.636,46	0,72%	-1.572.875,33	1.996.056,42	1.620.020,18	-2.108.727,03	
NTNB20350815 - 760199_VENCIMENTO	237.241.323,92	4.973.107,11	4.765.261,69	12,25%	-190.322,36	95.338,54	111.304,60	-141.506,52	
NTNB20400815 - 760199_VENCIMENTO	29.811.742,73	689.198,80	686.305,64	1,76%	-443.983,37	209.965,94	239.947,55	-312.035,00	
NTNB20450815 - 760199_VENCIMENTO	224.873.133,79	5.783.939,69	5.773.130,70	14,85%	-1.907.955,12	1.998.537,82	1.584.692,96	-2.116.999,72	
NTNB20500815 - 760199_VENCIMENTO	726.176.705,17	20.074.530,10	20.032.803,74	51,52%	-1.334.334,37	1.398.101,68	1.030.536,57	-1.357.632,15	
NTNB20550815 - 760199_VENCIMENTO	225.818.081,63	6.448.349,48	6.432.700,12	16,54%	-1.449.834,92	1.722.059,24	1.284.314,78	-1.638.096,19	
PETRA5	18.629.953,15	60.360,77	-40.635,68	-0,10%	-17.512.297,67	23.473.014,35	17.622.368,98	-21.631.335,00	
SBSPC2	9.411.700,36	30.268,70	-17.198,76	-0,04%	-2.535.270,22	3.944.380,74	2.864.774,16	-3.378.994,66	
BBTOPIND	272.019.228,71	2.329.014,31	2.252.798,77	5,79%	-19.237.607,36	38.611.574,43	25.543.229,74	-29.190.896,64	
CAIXA	5.000,00	0,00	0,00	0,00%	-73.267.194,13	128.859.246,39	91.099.028,96	-101.166.354,59	
COMPROMISSADA_PRE	635.673.324,20	0,00	0,00	0,00%	-24.460.904,92	43.781.439,36	30.923.953,59	-33.578.277,93	
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-51.963,05	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-493.660,91	-56.742,08	113.407,24	-152.380,46	
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-284.723,35	-3.750,89	97.094,80	-130.060,73	
<b>Total Var:</b>	<b>2.670.486.279,37</b>	<b>43.610.631,71</b>	<b>38.887.254,28</b>	<b>100,01%</b>	<b>-146.743.786,57</b>	<b>246.820.324,45</b>	<b>175.274.601,92</b>	<b>-198.406.036,01</b>	





Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/05/2023

FUNDO: FI RF EMB V CREDITO PRIVADO  
CNPJ: 20726178000121

Dados Gerais							
PL:	157.166.158,97	VAR / PL:	0,2588%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	794,73
VAR:	406.737,02	ETL / PL:	0,3245%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	546,80
ETL:	510.064,64	VAR / CDI:	0,0029%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (+):	1.525.768,17	CENARIO BRADESCO 1 (+):	2.733.409,30	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
Cenário Alta - 09999 (-):	(6.139.520,32)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(101.380,36)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(3.593.272,57)
Cenário Alta - 09999:	(6.139.520,32)	Cenário Baixa - 10000:	1.424.387,80	CENARIO BRADESCO 1:	2.733.409,30	CENARIO BRADESCO 2:	(3.593.272,57)

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
17H0164854	8.369.153,50	26.770,17	19.786,94	4,96%	-340.562,36	57.684,94	136.097,20	-180.266,69
AEGP23	15.048.814,42	53.850,94	35.602,49	8,75%	-560.077,63	-18.140,20	179.716,55	-240.130,30
CCRDD1	6.139.202,77	17.718,38	9.055,69	2,23%	0,00	0,00	0,00	0,00
CMDT33	1.354.084,42	4.352,73	2.231,90	0,55%	-155.885,36	-4.225,62	52.316,40	-70.198,24
ENJG21	1.932.940,97	5.973,68	4.524,28	1,11%	-41.025,10	-549,50	13.983,15	-18.730,54
ENMI21	1.204.973,04	3.878,66	2.889,88	0,71%	-293,87	299,66	1.371,60	-2.087,54
ENTV12	17.881.049,06	144.272,84	53.679,08	13,20%	0,00	0,00	0,00	0,00
ERDV17_VENCIMENTO	13.188.170,01	49.452,90	30.842,09	7,58%	0,00	0,00	0,00	0,00
ERDV36	4.210.754,07	12.141,77	6.162,47	1,52%	-76.961,23	10.710,59	29.768,61	-39.484,26
GASP17	10.295.260,09	226.194,92	80.418,76	19,77%	-49.462,47	7.265,19	19.250,99	-25.522,15
GEP24	7.835.602,17	24.166,96	9.896,08	2,43%	-1.178.707,32	520.733,89	631.525,74	-817.055,06
GRRB24_VENCIMENTO	15.854.311,73	108.939,72	48.482,34	11,92%	-453.135,60	-3.573,19	151.976,20	-203.137,34
LF5N16000GM	14.051.222,94	49.078,96	31.438,85	7,73%	-106.183,20	-2.907,91	35.656,54	-47.845,92
LF5N16000C5	4.583.910,69	16.701,40	13.146,10	3,23%	-325.422,48	412.976,98	335.176,59	-436.286,35
OMGE31	12.404.923,44	52.566,38	34.900,33	8,58%	-47.773,31	-19.783,87	10.685,84	-14.491,23
SBSPC2	7.212.756,23	23.196,74	11.871,18	2,92%	-961.986,03	456.682,65	520.902,70	-677.684,43
TAE33	8.330.273,15	24.136,58	11.808,57	2,90%	-604.351,18	-40.772,41	181.383,93	-242.455,02
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	-214.612,95	5.082,38	73.676,81	-98.122,58
COMPROMISSADA_PRE	10.557.489,05	0,00	0,00	0,00%	-608.183,89	54.331,88	220.961,95	-293.448,58
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-21.737,64	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-218.200,75	-2.874,54	74.409,63	-99.673,42
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-196.695,39	-8.553,13	64.538,87	-86.650,92
<b>Total Var:</b>	<b>160.434.154,12</b>	<b>843.393,73</b>	<b>406.737,02</b>	<b>99,99%</b>	<b>-6.139.520,32</b>	<b>1.424.387,80</b>	<b>2.733.409,30</b>	<b>-3.593.272,57</b>



Data: 31/05/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO  
CNPJ: 41837660000109

Dados Gerais		Limite Fundo:		ENQUADRADO		0,00% Dutation DC:		694,53	
PL:	238.009.161,35	VAR / PL:	0,5729%	Status:		Dutation DU:			477,94
VAR:	1.363.584,18	ETL / PL:	0,7185%	Benchmark:					
ETL:	1.709.989,57	VAR / CDI:	0,0064%						

Cenários do STRESS										
Cenário Alta - 09999 (+):	5.994.035,62	Cenário Baixa - 10000 (+):	11.743.755,42	CENARIO BRADESCO 1 (+):	45.792.941,70	CENARIO BRADESCO 2 (+):	14.257.867,54			
Cenário Alta - 09999 (-):	(12.140.215,05)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(6.461.743,74)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(17.257.081,80)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(44.575.666,33)			
Cenário Alta - 09999:	(6.146.179,43)	Cenário Baixa - 10000:	5.282.011,68	CENARIO BRADESCO 1:	28.535.859,90	CENARIO BRADESCO 2:	(30.317.798,79)			

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
ABCPA1	1.934.248,62	1.385,64	-863,25	-0,05%	8.113,50	8.856,42	10.550,25	-14.383,82
AMBP13	2.687.017,74	698,62	-198,10	-0,01%	-5.082,66	4.176,17	6.766,43	-9.547,25
APRB28	1.378.657,47	81,28	-17,34	0,00%	-616,68	503,61	824,26	-1.171,05
BCBF15	3.017.595,97	155,99	32,26	0,00%	-1.334,80	1.081,32	1.986,82	-2.893,60
BKBR18	1.051.151,46	15,05	6,77	0,00%	-137,15	114,46	247,23	-366,09
BRELETR0	2.989.809,89	70.583,94	21.875,45	1,60%	0,00	0,00	0,00	0,00
BRKPA0	3.336.937,72	1.147,43	-355,37	-0,03%	-8.010,80	6.582,17	10.439,73	-14.709,32
CAIXA	10.000,21	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CART13	970.739,92	11.694,31	-7.040,80	-0,52%	-73.355,73	39.909,57	44.560,83	-56.418,63
CBAN22	1.818.267,10	9.140,33	-5.870,90	-0,43%	-24.102,17	22.509,29	30.837,31	-36.110,37
CCPRA3	41.674,85	0,07	0,04	0,00%	-1,15	1,13	3,18	-4,78
CEAB22	538.323,34	159,77	-51,35	0,00%	-1.125,62	927,92	1.479,88	-2.075,76
CELG12	3.339.858,38	282,91	12,03	0,00%	-2.297,04	1.854,44	3.212,40	-4.538,03
COMPROMISSADA_PRE	98.510.595,24	0,00	0,00	0,00%	-2.742,03	2.796,12	12.798,25	-19.478,56
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-67.341,24	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CSAN23	1.147.707,99	1.298,06	-740,32	-0,05%	-6.590,25	5.672,62	8.663,59	-11.360,95
CSMG47	2.150.901,82	686,43	-311,13	-0,02%	-4.207,63	3.523,68	5.462,77	-7.486,15
DAPK25	-34.069,08	449.174,42	434.948,91	31,90%	-584.558,56	751.521,47	6.827.380,66	-6.865.698,17
DAPK27	-1.013,39	37.281,41	24.264,39	1,78%	-251.447,35	264.886,58	1.312.113,95	-1.313.895,12
DAPK35	681,10	16.755,31	12.383,70	0,91%	57.691,86	-57.929,71	-138.855,98	133.706,04
DAPQ24	-3.993,21	780.387,83	740.620,23	54,31%	-624.610,18	1.003.818,58	12.295.414,71	-12.378.231,59
DAPQ26	-20.834,14	336.115,87	316.523,90	23,21%	-1.313.493,82	1.442.986,61	8.371.107,22	-8.398.045,00
DAPQ28	1.692,31	94.924,11	27.299,43	2,00%	962.620,36	-569.795,27	-2.344.154,45	2.337.021,79
DAPQ30	3.605,60	69.939,33	44.919,37	3,23%	284.221,70	-286.391,77	-927.393,12	916.933,41
DAPQ32	75,89	2.614,70	-1.898,22	-0,14%	-8.574,77	8.527,27	29.952,55	-23.435,33
DASAA2	2.604.829,33	21,27	9,22	0,00%	-192,22	156,45	320,19	-472,55
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DHF25	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DHF26	-463,08	86.749,88	-35.543,33	-2,61%	-524.287,77	430.815,26	640.427,74	-894.400,70
DHN24	-7.588,34	53.930,86	21.131,06	1,55%	-444.697,19	351.292,59	654.439,73	-957.043,21
DHN25	2.313,19	52.616,27	11.218,99	0,82%	358.433,70	-289.375,59	-447.660,32	635.248,96
ERDVA0	2.132.210,51	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
GBSP11	2.630.015,86	55.617,63	-34.761,68	-2,55%	-273.900,70	194.955,77	198.767,58	-238.728,76
GGSH12	2.413.881,34	205,05	24,77	0,00%	-1.748,91	1.420,72	2.557,90	-3.711,48
GUAR15	2.638.726,64	521,77	-93,87	-0,01%	-4.022,29	3.282,29	5.399,47	-7.885,74
HABR11	2.508.336,67	49.956,64	-1.037,36	-2,23%	-284.559,89	174.362,61	185.636,35	-231.753,04
HZTC14	2.404.727,33	28.760,83	-17.313,41	-1,27%	-182.031,37	98.726,52	110.480,50	-139.802,54
IDIF24P380200	-4.296.988,00	304.490,73	-139.340,64	-10,22%	2.275.848,98	-2.945.804,96	-7.912.683,00	3.986.571,77
IDIF24P380300	4.819.568,00	312.347,00	142.935,82	10,48%	-2.389.247,00	2.974.371,92	7.885.936,34	-4.362.666,32
IDIF24P381200	-14.284.534,00	271.179,47	-124.096,78	-9,10%	2.439.918,53	-2.300.586,71	-5.464.562,09	6.215.371,63
IDIF24P381300	16.455.736,00	273.509,72	125.163,15	9,18%	-2.479.835,85	2.306.643,36	5.442.917,75	-6.418.940,72
IGTAS7	2.130.348,13	596,43	-188,43	-0,01%	4.667,41	-3.657,77	-6.441,65	9.526,41
INSSSN1	1.743.010,74	44.302,62	20.105,99	1,47%	0,00	0,00	0,00	0,00
JMLB5	3.223.262,38	35.625,21	-20.625,30	-1,51%	-246.424,94	117.467,92	139.331,09	-178.456,62
LCAMA9	1.982.428,78	163,95	21,89	0,00%	-1.395,09	1.128,25	2.041,89	-2.965,14
LCAMD1	4.984.495,94	57.511,81	-33.598,25	-2,46%	-389.623,65	188.484,89	221.900,51	-283.994,67
LF0021003Q1	2.310.189,89	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002100E1F	1.245.461,76	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002200IO9	2.295.754,27	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFSC190054B	839.105,19	0,00	0,00	0,00%	2.995,89	-2.310,80	-4.328,94	6.631,66
LFSC190059S	1.270.963,44	0,00	0,00	0,00%	4.557,43	-3.515,28	-6.578,56	10.078,17
LFSC19005L1	840.786,75	0,00	0,00	0,00%	3.079,77	-2.375,88	-4.423,69	6.777,71
LFSC22002IX	5.050.847,06	1.950,70	-664,38	-0,05%	-13.258,66	10.950,81	17.344,90	-24.363,44
LFNS210029N	4.136.891,75	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20240301 - 210100	10.395.108,43	509,07	127,66	0,01%	-20.401,90	24.595,70	125,02	-190,34
LFT20240901 - 210100	1.116.480,59	177,15	-59,76	0,00%	-4.004,62	5.487,34	46,57	-70,90
LIGHB4	2.223.676,94	7,62	3,56	0,00%	-91,81	84,99	221,82	-332,50
LIGHD3	878.272,60	404,52	-177,51	-0,01%	-2.491,94	2.079,75	3.212,16	-4.425,31
LIREN1	1.405.312,48	22,27	6,90	0,00%	-203,11	168,12	351,09	-577,71
MOV17	1.192.284,83	1.014,95	-485,28	-0,04%	-5.334,45	4.991,80	7.677,31	-10.493,37
MTRJ19	3.557.317,61	24.854,91	-12.225,77	-0,90%	-217.443,09	88.122,65	113.839,89	-147.141,79
NTEN11	3.499.754,69	20.244,46	-8.067,33	-0,59%	-205.861,27	72.862,44	100.800,81	-131.355,11
NTNB20240815 - 760199_NEGOCIACAO	102.997,35	1.030,20	977,21	0,07%	-1.621,20	1.698,17	1.346,52	-1.798,82
NTNB20250515 - 760199_NEGOCIACAO	575.671,88	6.204,73	5.973,80	0,44%	-13.056,09	11.724,16	10.042,99	-13.348,47
NTNB20260815 - 760199_NEGOCIACAO	1.531.513,52	10.231,47	9.804,54	0,72%	-48.169,47	50.471,47	37.202,37	-49.010,52
NTNB20270515 - 760199_NEGOCIACAO	691.248,82	3.271,71	2.533,10	0,19%	-25.127,32	27.840,54	20.041,31	-26.255,55
NTNB20280815 - 760199_NEGOCIACAO	2.587.920,45	34.177,71	-6.553,89	-0,48%	-243.622,57	289.666,73	211.582,77	-274.179,33
NTNB20500815 - 760199_NEGOCIACAO	431.485,31	11.928,04	-8.255,45	-0,61%	-43.534,47	76.566,59	54.129,93	-60.111,81
NTSD35	1.903.140,22	2.479,85	-1.471,88	-0,11%	-12.034,62	10.449,39	15.981,30	-20.628,72
OMG13	3.694.520,24	1.643,11	-741,45	-0,05%	-10.073,99	8.436,75	13.096,19	-17.980,10
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
OVS410	1.590.693,96	197,52	1,65	0,00%	-1.521,45	1.310,52	2.249,67	-3.240,90
PASN12	4.096.717,98	18.053,64	-5.776,52	-0,42%	-206.829,75	64.666,12	97.780,28	-127.633,96
RAHD11	3.441.378,52	52.963,54	-32.774,34	-2,40%	-296.577,23	184.631,37	197.225,71	-243.376,73
RBCAPMZ	663.992,02	10.850,83	640,90	0,05%	0,00	0,00	0,00	0,00
RDCO10	2.295.655,19	320,15	-31,98	0,00%	-2.571,72	2.088,59	3.517,77	-5.040,36
RDR089	1.137.184,33	1.233,77	-704,18	-0,05%	-6.259,97	5.389,36	8.231,11	-10.791,35
RLOG11	1.547.721,79	59,57	15,57	0,00%	-523,59	428,01	820,33	-1.199,66
RSAN24	808.372,26	46,86	4,93	0,00%	-402,78	327,74	596,61	-866,25
RSAN44	857.504,99	5.591,80	-2.551,73	-0,19%	-52.960,70	19.315,83	26.401,73	-34.267,23
SBFC11	1.747.793,84	12,70	5,80	0,00%	-128,36	110,66	267,05	-398,23
SNGO10	2.125.268,81	100,53	22,50	0,00%	-876,17	712,72	1.338,93	-1.953,52
UGEL11	1.063.706,83	172,02	-29,01	0,00%	-1.336,15	1.091,73	1.815,38	-2.995,78
UNEG11	4.825.059,87	87.528,92	-55.737,49	-4,09%	-434.997,02	301.855,68	307.803,49	-377.489,37
VAMO33	1.511.448,96	16.388,99	-9.325,65	-0,68%	-114.201,11	54.637,18	64.486,87	-82.688,16



bradesco

Data: 31/05/2023

Relatório de Risco de Mercado

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

Dados Gerais									
PL:	238.009.161,35	VAR / PL:	0,5729%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	694,53		
VAR:	1.363.584,18	ETL / PL:	0,7185%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	477,94		
ETL:	1.709.989,57	VAR / CDI:	0,0064%	Benchmark:					

Cenários de STRESS									
Cenário Alta - 09999 (+):	5.994.035,62	Cenário Baixa - 10000 (+):	11.743.755,42	CENARIO BRADESCO 1 (+):	45.792.941,70	CENARIO BRADESCO 2 (+):	14.257.867,54		
Cenário Alta - 09999 (-):	(12.140.215,05)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(6.461.743,74)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(17.257.081,80)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(44.575.666,33)		
Cenário Alta - 09999:	(6.146.179,43)	Cenário Baixa - 10000:	5.282.011,68	CENARIO BRADESCO 1:	28.535.859,90	CENARIO BRADESCO 2:	(30.317.798,79)		

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
VCCS11	1.224.943,44	981,98	-507,11	-0,04%	-5.425,45	4.599,48	7.016,09	-9.443,93
VECS11	1.763.773,01	80,35	20,43	0,00%	-677,94	546,72	1.015,12	-1.480,13
VERDECS2	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
VIXL14	2.084.630,31	152,23	13,49	0,00%	-1.300,51	1.060,05	1.912,44	-2.773,57
VVEO15	1.650.171,83	331,09	-94,24	-0,01%	-2.365,56	1.939,23	3.107,90	-4.388,72
VVEO16	1.065.345,98	262,06	-85,53	-0,01%	-1.809,78	1.489,20	2.355,23	-3.307,77
<b>Total Var:</b>	<b>252.144.648,98</b>	<b>3.828.117,66</b>	<b>1.363.584,18</b>	<b>99,98%</b>	<b>-6.146.179,43</b>	<b>5.282.011,69</b>	<b>28.535.859,90</b>	<b>-30.317.798,79</b>



Data: 31/05/2023

Relatório de Risco de Mercado

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

Dados Gerais					
PL:	275.990.504,02	VAR / PL:	1,3343%	Limite Fundo:	0,00%
VAR:	3.682.572,44	ETL / PL:	1,6733%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	4.618.094,41	VAR / Cdt:	0,015%	Benchmark:	
				Dutacion DC:	2.068,81
				Dutacion DU:	1.423,32

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (+):	12.941.330,60	CENARIO BRADESCO 1 (+):	14.892.237,95
Cenário Alta - 09999 (-):	(25.143.032,94)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(1.033,84)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-
Cenário Alta - 09999:	(25.143.032,94)	Cenário Baixa - 10000:	12.940.296,75	CENARIO BRADESCO 1:	14.892.237,95
				CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	(18.817.041,48)
				CENARIO BRADESCO 2:	(18.817.041,48)

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	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
ANEM11	12.791.490,53	176.289,38	174.941,60	4,75%	-985.475,47	611.480,83	652.589,46	-908.005,48
ANET11	2.369.174,00	8.523,65	6.571,84	0,18%	-110.025,65	29.786,57	49.382,11	-64.891,52
BRKP28	8.940.139,78	152.625,84	151.379,03	4,11%	-796.975,58	484.702,81	520.050,58	-652.882,37
BRST11	6.703.816,03	29.149,40	21.815,42	0,59%	-345.693,39	82.973,81	147.695,05	-194.681,73
BTOW15	8.427.540,76	99.808,23	99.372,25	2,70%	-665.526,00	313.724,99	375.827,79	-480.595,23
CAEC21	8.738.727,04	54.207,13	50.036,86	1,36%	-512.987,20	211.830,55	260.647,63	-340.417,13
CAIXA	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CART13	10.463.819,89	126.055,58	125.880,53	3,42%	-790.171,63	430.194,05	480.331,05	-608.148,85
CBAN32	9.874.627,56	123.733,22	123.341,76	3,35%	-770.352,86	420.690,94	468.345,23	-594.269,30
CBAN72	2.407.263,96	32.208,25	32.092,04	0,87%	-193.470,93	108.386,75	119.419,40	-151.207,19
CJENY13	4.739.818,36	55.742,43	55.691,59	1,51%	-351.951,01	192.008,53	214.307,58	-270.917,32
CNRD11	10.188.297,90	146.350,67	145.833,32	3,96%	-825.488,71	497.549,17	530.745,98	-666.560,63
COMPROMISSADA_PRE	866.015,26	0,00	0,00	0,00%	-24,11	24,58	112,51	-171,24
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-131.423,26	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CONX12	9.958.889,82	61.784,13	57.904,38	1,57%	-587.912,94	229.425,76	294.626,72	-384.233,46
CREDZM24	1.058.045,85	117.236,87	-52.892,50	-1,44%	0,00	0,00	0,00	0,00
CRMG15	8.533.702,99	53.586,80	52.248,86	1,42%	-496.618,42	183.801,21	250.693,85	-324.853,97
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ERDV17	3.815.777,19	14.308,37	-6.359,04	-0,17%	-131.107,24	-1.033,84	43.971,78	-58.774,40
ERDV38	5.624.826,36	21.518,04	7.675,36	0,21%	-267.392,29	16.129,25	94.335,84	-125.431,38
GBSP11	1.616.403,91	34.182,51	33.331,27	0,91%	-168.338,97	119.819,53	122.162,26	-146.722,35
GRRB24	8.353.208,22	57.397,40	53.400,00	1,45%	-506.844,43	240.613,74	274.449,55	-357.053,60
HARG11	10.398.938,11	148.104,38	147.394,60	4,00%	-843.483,74	516.822,16	550.238,27	-686.931,14
HBSA21	7.522.174,67	90.121,98	89.649,10	2,43%	-598.090,22	293.986,86	343.505,66	-439.211,69
HVRD15	10.495.406,49	160.726,47	160.090,69	4,35%	-908.861,32	553.947,51	581.943,23	-733.430,14
IPIL11	9.151.042,58	85.521,67	85.416,03	2,32%	-616.018,53	301.315,98	354.956,44	-451.506,22
IRBR12	11.457.194,86	52.780,23	34.831,98	0,95%	-573.011,67	102.358,33	226.841,29	-300.207,68
ITPO14	13.578.534,12	238.584,16	236.880,55	6,43%	-1.257.991,30	814.893,47	842.476,31	-1.051.027,55
LAMEA6	8.762.254,19	97.813,62	97.359,85	2,64%	-675.908,70	309.940,64	376.238,51	-482.026,46
LCAMD1	7.525.342,75	86.828,46	86.355,60	2,34%	-588.234,31	284.565,07	335.014,30	-428.760,96
LIGHD7	5.951.371,37	26.654,45	26.283,08	0,44%	-299.281,60	43.537,84	114.515,01	-151.736,13
LORTA7	6.231.450,17	74.458,22	74.029,30	2,01%	-498.937,38	239.974,17	283.453,48	-362.759,71
MOVIS7	8.522.861,38	95.080,19	94.586,02	2,57%	-654.698,32	313.094,04	370.788,76	-474.791,90
MTRJ19	8.703.075,30	60.808,21	59.743,30	1,62%	-531.980,50	215.594,49	275.512,41	-359.986,42
NTEN11	6.772.799,13	39.177,50	36.838,56	1,00%	-398.337,08	141.004,92	195.071,86	-254.201,17
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PASN12	7.539.582,72	33.225,85	30.011,94	0,81%	-380.648,61	119.011,26	179.954,43	-234.897,01
QUAT12	3.947.228,65	15.257,00	5.674,32	0,15%	-187.074,31	13.408,04	66.919,61	-88.985,11
RAHD11	12.761.946,39	196.409,04	194.668,56	5,29%	-1.099.821,66	684.683,68	731.388,29	-902.533,88
RDVE11	4.013.004,90	51.626,73	51.516,85	1,40%	-321.194,99	177.455,00	198.459,36	-248.762,02
RMSA12	10.637.144,17	252.592,48	246.973,50	6,71%	-1.197.195,05	863.847,75	873.141,40	-1.055.844,07
RSAN44	7.189.941,12	46.885,66	45.316,26	1,23%	-444.060,76	161.957,88	221.371,15	-287.321,17
TCII11	13.404.119,29	224.331,61	221.656,29	6,02%	-1.238.050,18	783.558,44	834.101,07	-1.022.184,44
UNEG11	1.934.974,03	36.619,24	36.064,88	0,98%	-181.988,55	126.286,56	128.774,93	-157.929,23
UTPS21	6.415.025,46	103.413,62	102.726,18	2,79%	-558.773,75	350.901,57	369.125,23	-461.203,37
UTPS22	2.753.246,21	46.924,85	46.552,95	1,26%	-247.006,97	158.685,82	165.329,83	-206.227,49
VAMO33	8.551.214,65	92.722,90	91.982,55	2,50%	-646.107,27	309.116,77	364.842,64	-467.818,76
VAMO34	7.026.673,46	80.123,94	79.738,38	2,17%	-544.591,32	263.262,16	310.172,08	-396.951,25
VERDECS2	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
VERO12	3.328.467,57	23.011,20	22.077,77	0,60%	-206.504,25	87.952,16	107.842,67	-140.129,53
VIMT13	7.233.078,92	97.567,94	97.204,83	2,64%	-566.692,99	335.948,13	362.719,65	-454.798,91
VRDN12	4.960.078,84	58.764,08	58.685,89	1,59%	-371.544,79	201.076,84	224.875,85	-285.060,94
Total Var:	342.109.134,62	3.980.843,47	3.682.572,44	99,99%	-25.143.032,94	12.940.296,75	14.892.237,95	-18.817.041,48



Data: 31/05/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIM EMB I A  
CNPJ: 20725946000122

Dados Gerais					
PL:	398.175.073,96	VAR / PL:	0,2296%	Limite Fundo:	0,00%
VAR:	914.090,52	ETL / PL:	0,2879%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	1.146.306,38	VAR / CDI:	0,0026%	Benchmark:	
				Dutacion DC:	349,24
				Dutacion DU:	240,82

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	24.343.202,03	Cenário Baixa - 10000 (+):	25.765.513,52	CENARIO BRADESCO 1 (+):	76.653.838,38
Cenário Alta - 09999 (-):	(26.442.741,84)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(20.429.974,45)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(68.891.728,90)
Cenário Alta - 09999:	(2.099.539,81)	Cenário Baixa - 10000:	5.335.539,07	CENARIO BRADESCO 1:	7.762.109,49
				CENARIO BRADESCO 2 (+):	84.653.258,13
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	(89.093.095,09)
				CENARIO BRADESCO 2:	(4.439.836,96)

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
ANHB10	639.773,03	29,01	12,37	0,00%	-239,75	195,08	337,73	-486,49
BCBF14	265.358,06	11,55	1,01	0,00%	-100,02	81,60	154,11	-225,03
CAIXA	9.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CBAN22	4.729.378,67	23.774,33	22.969,49	2,51%	-62.690,62	58.547,47	80.208,97	-93.924,38
CEEB3	1.894.091,85	269,72	170,89	0,02%	-2.011,18	1.640,07	2.666,18	-3.794,11
CGBP13	2.163.792,33	884,61	779,92	0,09%	-5.451,80	4.568,08	7.108,08	-9.748,42
COMPROMISSADA_PRE	266.272.062,39	0,00	0,00	0,00%	-7.411,66	7.557,86	34.593,40	-52.650,15
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	86.714,75	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPMM23C099500	-17,86	24,90	14,36	0,00%	0,01	-0,01	-0,04	0,05
CPMM23C099750	-35,73	34,73	17,79	0,00%	0,02	-0,02	-0,07	0,11
CPMM23C100000	12.668,22	4.831,29	1.972,89	0,22%	-5,36	5,45	24,69	-37,49
CPMU23C100000	-1.556,74	446,84	201,72	0,02%	5,92	-5,73	-15,95	23,37
CPT12	2.118.794,82	1.077,98	1.009,43	0,11%	-5.978,43	5.088,35	7.848,67	-10.490,19
DAPM23	0,00	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
D1F27	2.364,89	383.565,60	359.870,66	39,37%	-1.958.479,55	1.654.031,20	2.420.540,70	-3.270.154,03
D1F31	-26,32	141.207,41	138.140,64	15,11%	-521.876,10	476.673,97	741.048,55	-867.061,67
D1N23	-0,24	1,71	0,71	0,00%	122,75	-124,93	-665,64	857,93
DOLM23	17.967,93	0,00	0,00	0,00%	213.504,17	-213.646,85	259.975,38	-262.174,98
DOLN23	-10.707,23	69.422,74	22.317,33	2,44%	-197.903,34	201.260,28	-256.457,51	257.775,01
ELET13	2.097.876,19	261,55	119,34	0,01%	-2.078,71	1.684,37	2.844,07	-4.087,16
ECOT13	1.449.843,33	18,13	-5,52	0,00%	-166,44	140,22	309,02	-455,10
ETEB13	1.324.795,40	1,56	-0,70	0,00%	-31,82	32,05	93,57	-140,87
GRRB14	1.101.552,93	51,14	21,93	0,00%	-416,74	337,59	579,32	-833,88
IDIF24C382500	-7.569.936,00	630.354,75	-223.428,13	-24,44%	-7.602.608,35	4.003.857,19	6.471.637,53	-28.495.242,12
IDIF24C382600	7.413.630,00	765.116,07	271.194,04	29,67%	9.729.556,45	-4.557.569,33	-6.809.338,37	37.357.425,89
IDIF24C382700	-1.192.347,00	151.186,72	-53.587,87	-5,86%	-2.045.942,04	833.382,35	1.145.478,94	-8.014.485,77
IDIF24P380200	3.776.207,00	267.587,44	-94.845,90	-10,38%	-2.000.023,47	2.588.782,96	6.953.691,50	-3.803.412,21
IDIF24P380300	-4.235.452,00	274.491,56	97.293,05	10,64%	2.099.678,54	-2.613.887,70	-6.930.186,45	3.833.925,32
IDIF24P381200	-16.794.503,00	318.829,05	113.008,40	12,36%	2.868.642,35	-2.704.828,20	-6.424.753,12	7.307.489,17
IDIF24P381300	19.347.212,00	321.868,75	-113.979,48	-12,47%	-2.915.573,63	2.711.949,07	6.399.305,60	-7.546.827,75
IDIF24P381800	25.064.571,00	177.179,49	-62.800,96	-8,87%	-1.655.728,30	1.458.741,40	3.347.579,21	-4.556.728,80
IDIF24P381900	-29.972.376,01	179.627,39	63.739,50	6,97%	1.686.049,75	-1.476.532,86	-3.377.405,79	4.670.449,82
IDIF24P382400	-8.265.014,01	172.768,47	61.237,48	6,70%	1.513.735,22	-1.494.461,53	-3.621.547,41	3.638.024,25
IDIF24P382500	70.469.283,88	200.885,98	-71.203,68	-7,79%	-1.901.829,83	1.636.263,19	3.706.457,14	-5.367.698,36
IDIN23C359100	-648,00	93,10	-38,66	0,00%	-86.291,78	648,00	648,00	-941.610,08
IDIN23C359200	648,00	53,94	22,40	0,00%	37.306,71	-647,86	-648,00	877.807,33
IDIN23P358900	30.065,00	3.609,55	-1.498,71	-1,16%	-30.064,97	3.387.292,55	27.135.337,46	-30.065,00
IDIN23P359000	-9.650.016,02	47.692,25	18.902,17	2,17%	3.045.600,84	-3.895.587,10	-23.147.900,99	9.434.020,56
IDIN23P359100	-23.874.032,34	43.872,03	18.215,99	1,99%	3.027.241,91	-3.348.556,38	-17.242.835,79	15.908.700,57
IDIN23P359200	539.551.065,46	47.076,42	-19.546,47	-2,14%	-3.382.294,90	3.454.915,88	15.743.136,33	-23.384.015,81
IDIN23P359300	14.118.776,00	824,35	-342,28	-0,04%	-59.266,53	60.458,41	274.847,01	-411.395,62
IDIN23P359400	-38.105.515,00	1.693,02	702,95	0,08%	121.757,40	-124.125,98	-563.640,90	846.808,16
IDIN23P359500	23.948.442,00	866,96	-359,97	-0,04%	-62.351,44	63.550,41	288.390,72	-434.210,00
IIVAS3	1.290.851,64	27,38	-2,48	0,00%	-236,95	193,15	376,68	-552,70
LCAMC3	3.017.014,35	814,42	606,98	0,07%	-5.685,87	4.671,87	7.409,86	-10.440,32
LF0021006S0	1.210.214,14	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002100HDP	1.441.289,10	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002100HDQ	2.625.653,06	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002100ISJ	2.691.824,38	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF00220018H	1.216.518,45	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFSC1900089	3.437.572,24	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20230901 - 210100	42.537.510,99	1.221,62	-439,51	-0,05%	-24.682,37	26.561,30	515,97	-785,54
LFT20260301 - 210100	26.224.872,11	26.942,66	11.015,06	1,21%	-159.028,50	347.857,62	14.467,10	-22.010,39
LFT20290301 - 210100	3.788.851,58	7.941,16	4.129,06	0,48%	-52.318,72	128.652,31	10.121,33	-15.367,63
NTNB20500815 - 760199_NEGOCIACAO	12.447.897,49	344.105,89	321.763,14	35,20%	-1.255.903,50	2.208.830,04	1.561.556,42	-1.734.134,64
OMGS13	98.010,54	438,07	386,26	0,04%	-2.665,87	2.249,36	3.491,63	-4.793,75
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PALFA1	2.571.792,03	1.023,09	902,19	0,10%	-6.200,07	5.183,57	7.970,98	-10.942,47
PRLG14	2.356.068,07	2,94	-1,06	0,00%	-30,37	26,24	62,32	-92,95
SBSPC7	2.520.121,21	876,92	686,72	0,08%	-5.958,06	4.907,46	7.714,21	-10.804,69
SMFT16	3.481.781,41	1.738,62	1.486,86	0,16%	-10.986,58	9.143,86	14.187,27	-19.603,52
VAMO22	1.101.408,46	95,18	41,85	0,00%	-790,76	644,56	1.122,75	-1.818,02
WDOM23	-17.967,93	0,00	0,00	0,00%	-213.504,17	213.646,85	-259.975,38	262.174,98
WDOM23	-10.707,23	69.422,74	22.317,33	2,44%	-197.903,34	201.260,28	-256.457,51	257.775,01
Total Var:	965.100.829,76	4.686.142,80	914.090,52	99,99%	-2.099.539,81	5.335.539,07	7.762.109,49	-4.439.836,96



Data: 31/05/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIM EMB II A  
CNPJ: 20725957000102

Dados Gerais							
PL:	186.961.011,71	VAR / PL:	0,1897%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	568,39
VAR:	354.663,65	ETL / PL:	0,2379%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	391,70
ETL:	444.762,53	VAR / CDI:	0,0021%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	2.274.240,96	Cenário Baixa - 10000 (+):	3.382.798,59	CENARIO BRADESCO 1 (+):	4.299.332,14	CENARIO BRADESCO 2 (+):	1.979.027,18
Cenário Alta - 09999 (-):	(3.347.499,66)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(2.069.945,29)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(1.407.398,56)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(5.567.639,72)
Cenário Alta - 09999:	(1.073.258,70)	Cenário Baixa - 10000:	1.312.853,30	CENARIO BRADESCO 1:	2.891.933,58	CENARIO BRADESCO 2:	(3.588.612,54)

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
AEGP13	675.209,10	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CAIXA	9.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	8.109.857,74	0,00	0,00	0,00%	-225,74	230,19	1.053,61	-1.603,57
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-13.264,74	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPGT14	149.582,18	1,02	0,15	0,00%	49,02	-49,93	-186,53	284,33
CPGT16	300.645,39	33,71	-8,66	0,00%	289,67	-229,93	-452,55	675,32
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DHF24	221,52	1.904,67	-183,60	-0,05%	18.132,46	-15.441,75	-34.777,69	51.718,31
DHF25	-5.958,70	49.377,14	20.533,26	5,79%	-371.044,48	295.455,42	490.774,85	-706.629,19
DHF26	-109,88	20.584,72	13.404,39	3,78%	-124.407,27	102.227,35	151.965,90	-212.230,67
DHF27	20,16	3.269,03	2.007,31	0,57%	-16.691,59	14.096,86	20.629,61	-27.870,63
DHF29	7,23	3.294,84	1.877,44	0,53%	-13.684,86	12.102,42	18.121,88	-22.804,88
DHF33	-46,92	4.189,85	2.310,52	0,65%	-14.355,32	13.575,30	21.574,57	-23.478,56
DHJ24	-97,20	832,35	126,77	0,04%	-7.032,11	5.715,83	11.639,40	-17.160,35
DHJ25	-35,48	456,20	249,21	0,07%	-3.302,24	2.645,68	4.219,03	-6.030,61
DHN23	-2,39	17,05	-0,67	0,00%	1.227,49	-1.249,30	-5.656,35	8.579,26
DHN24	99,41	706,52	-173,10	-0,05%	5.825,73	-4.602,09	-8.573,45	12.537,68
DHN25	4.531,00	103.062,80	-62.992,18	-17,76%	702.086,63	-666.818,16	-876.860,42	1.244.302,08
DHN26	-705,85	71.832,20	-46.320,99	-13,06%	393.474,50	-327.775,35	-480.891,57	660.930,19
DHV23	-0,97	31,56	1,96	0,00%	-413,28	392,31	1.067,08	-1.601,80
DHV24	-131,33	940,13	297,83	0,08%	-7.254,25	5.741,85	10.069,64	-14.608,10
ERDV18	1.355.806,45	3,36	0,23	0,00%	-40,43	37,43	97,69	-146,43
INDM23	-25.602,00	507.621,43	384.617,20	108,45%	1.002.725,50	-1.002.238,00	807.862,17	-813.545,24
LFT20230901 - 210100	42.098.842,91	1.209,03	7,76	0,00%	-24.427,83	26.287,38	510,65	-777,44
LFT20240301 - 210100	8.215.060,11	402,31	-71,69	-0,02%	-16.123,24	19.437,52	98,90	-150,42
LFT20240901 - 210100	22.754.937,65	3.610,39	586,10	0,17%	-81.617,86	111.837,19	949,20	-1.445,05
LFT20250901 - 210100	9.404.885,85	5.623,51	1.471,04	0,41%	-56.237,16	92.245,13	1.786,86	-2.719,78
LFT20260301 - 210100	13.264.983,36	13.628,05	5.540,04	1,56%	-80.439,30	175.952,26	7.317,70	-11.133,23
LFT20260901 - 210100	1.763.276,65	2.079,57	869,35	0,25%	-12.377,52	27.982,32	1.220,04	-1.855,85
LTN20230701 - 100000	2.215.010,08	100,84	-33,17	-0,01%	-1.248,90	1.525,11	6.367,04	-9.657,02
LTN20240101 - 100000	2.325.407,98	2.208,78	387,19	0,11%	-22.658,38	19.309,38	43.473,86	-64.650,41
LTN20250701 - 100000	15.896.967,29	108.846,52	65.093,20	18,35%	-709.156,42	613.175,94	918.570,74	-1.302.898,17
LTN20260701 - 100000	5.795.974,38	72.560,52	46.107,59	13,00%	-377.768,72	361.974,72	498.182,90	-683.720,69
NTNB20240815 - 760199_NEGOCIACAO	15.078.812,59	150.821,18	-72.126,60	-20,34%	-237.343,34	248.611,53	197.130,59	-263.347,80
NTNB20250515 - 760199_NEGOCIACAO	11.464.094,32	123.562,71	-51.225,74	-14,44%	-260.002,74	233.478,25	199.998,98	-265.825,14
NTNB20260815 - 760199_NEGOCIACAO	14.661.802,56	97.950,07	-14.315,67	-4,04%	-481.145,96	483.183,94	356.153,44	-469.197,67
NTNB20270515 - 760199_NEGOCIACAO	6.006.277,87	28.427,98	5.271,45	1,49%	-218.331,93	241.907,09	174.139,45	-228.135,07
NTNB20280815 - 760199_NEGOCIACAO	5.430.497,97	32.290,28	22.787,02	6,42%	-230.168,78	273.670,20	199.898,35	-259.038,08
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
WDON23	3.671,05	23.802,08	-3.105,67	-0,88%	67.852,57	-69.003,53	87.928,29	-88.380,01
WINM23	-2.108,40	41.804,12	31.674,36	8,93%	82.577,39	-82.537,25	66.529,83	-66.997,84
<b>Total Var:</b>	<b>186.937.418,92</b>	<b>1.477.086,52</b>	<b>354.663,65</b>	<b>100,00%</b>	<b>-1.073.258,70</b>	<b>1.312.853,30</b>	<b>2.891.933,59</b>	<b>-3.588.612,54</b>



Data: 31/05/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIM EMB III A IMOBILIÁRIO  
CNPJ: 3271199000162

Dados Gerais							
PL:	62.140.754,55	VAR / PL:	7,5372%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	1,00
VAR:	4.683.661,41	ETL / PL:	9,4520%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1,00
ETL:	5.873.525,45	VAR / CDI:	0,0848%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	33.848.547,66	Cenário Baixa - 10000 (+):	18,15	CENARIO BRADESCO 1 (+):	8.162.094,91	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
Cenário Alta - 09999 (-):	(17,80)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(33.848.551,91)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(8.228.948,73)
Cenário Alta - 09999:	33.848.529,86	Cenário Baixa - 10000:	(33.848.533,76)	CENARIO BRADESCO 1:	8.162.094,91	CENARIO BRADESCO 2:	(8.228.948,73)

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

Produto	MtM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
AIEC11	2.332.809,30	217.089,77	190.907,37	4,08%	1.166.401,03	-1.166.404,65	341.989,84	-344.789,22
BMLC11	3.030.144,00	106.574,23	-7.425,85	-0,16%	3.030.144,00	-3.030.144,00	444.219,11	-447.855,28
BPML11	919.959,01	82.540,86	-28.134,55	-0,60%	919.959,01	-919.959,01	134.865,99	-135.969,94
BTLG11	1.901.766,03	82.359,15	75.992,69	1,62%	950.883,02	-950.883,02	278.798,90	-281.081,02
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CEOC11	789.131,00	52.318,14	41.922,95	0,90%	394.565,50	-394.565,50	115.686,61	-116.633,56
CNES11	425.816,82	35.393,86	-8.798,55	-0,19%	212.908,41	-212.908,41	62.424,75	-62.938,73
COMPROMISSADA_PRE	639.311,28	0,00	0,00	0,00%	-17,80	18,15	83,06	-126,41
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-184.430,33	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
FVPQ11	1.074.570,00	136.310,84	115.942,70	2,48%	537.285,00	-537.285,00	157.531,96	-158.821,45
GALG11	1.790.562,24	167.947,70	161.682,72	3,45%	895.281,12	-895.281,12	262.496,42	-264.645,10
GTLG11	1.393.906,50	54.289,40	25.345,39	0,54%	1.393.906,50	-1.393.906,50	204.346,69	-206.019,38
HBRH11	2.770.846,62	103.432,51	73.584,48	1,57%	2.770.846,62	-2.770.846,62	406.206,11	-409.531,13
HSLG11	931.443,87	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
HSM11	550.817,40	24.046,87	16.314,04	0,35%	275.408,07	-275.408,70	80.749,83	-81.410,81
MALL11	4.187.280,00	318.372,49	313.228,67	6,69%	2.093.640,00	-2.093.640,00	613.855,25	-618.879,98
MAXR11	1.270.147,50	81.198,50	54.354,97	1,16%	635.073,75	-635.073,75	186.203,62	-187.727,80
NEWL11	942.399,95	13.569,57	4.663,32	0,10%	471.199,98	-471.199,98	138.155,83	-139.286,71
NEWU11	854.997,84	192.206,45	-167.343,66	-3,57%	854.997,84	-854.997,84	125.342,68	-126.368,68
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PATC11	6.098.623,70	784.557,87	729.855,47	15,58%	3.049.311,85	-3.049.311,85	894.058,23	-901.376,58
QAGR11	4.974.286,36	407.893,71	398.900,48	8,52%	2.487.143,18	-2.487.143,18	729.230,38	-735.199,52
RBRL11	3.051.862,04	533.298,87	518.572,24	11,07%	3.051.862,04	-3.051.862,04	447.402,98	-451.065,21
RCRB11	5.231.155,77	915.647,93	886.830,46	18,93%	0,00	0,00	0,00	0,00
RNGO11	40.602,00	1.753,92	1.027,30	0,02%	20.301,00	-20.301,00	5.952,25	-6.000,98
TEPP11	4.896.116,28	606.153,48	581.981,28	12,43%	2.448.058,14	-2.448.058,14	717.770,65	-723.645,99
TRXF11	6.973.834,52	139.146,84	73.655,22	1,57%	3.486.917,26	-3.486.917,26	1.022.364,14	-1.030.732,74
TRXF13	51.121,70	1.020,02	539,93	0,01%	0,00	0,00	0,00	0,00
XPIN11	3.277.547,69	384.887,07	369.323,05	7,89%	1.638.773,85	-1.638.773,85	480.488,49	-484.421,55
XPML11	13.887,69	669,98	166,35	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
XPML12	45,24	21,06	9,20	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
XPPR11	2.127.361,00	350.286,55	260.583,75	5,56%	1.063.680,50	-1.063.680,50	311.871,12	-314.423,96
<b>Total Var:</b>	<b>62.358.923,01</b>	<b>6.792.997,62</b>	<b>4.653.681,41</b>	<b>100,00%</b>	<b>33.848.529,86</b>	<b>-33.848.533,76</b>	<b>8.162.094,91</b>	<b>-8.228.948,73</b>



Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/05/2023

FUNDO: FIA RVA EMB II  
CNPJ: 13294268000125

Dados Gerais		Limite Fundo:		ENQUADRADO		0,00% Dutation DC:		1,00	
PL:	220.636.555,72	VAR / PL:	10,4792%	Status:		Dutation DU:			1,00
VAR:	23.121.031,95	ETL / PL:	13,1414%	Benchmark:					
ETL:	28.994.706,85	VAR / CDI:	0,1178%						

Cenários de STRESS										
Cenário Alta - 09999 (+):	56.775.710,13	Cenário Baixa - 10000 (-):	56,61	CENARIO BRADESCO 1 (+):	31.782.706,79	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-			
Cenário Alta - 09999 (-):	(55,52)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(57.453.889,82)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(32.042.998,51)			
Cenário Alta - 09999:	56.775.654,61	Cenário Baixa - 10000:	(57.453.833,21)	CENARIO BRADESCO 1:	31.782.706,79	CENARIO BRADESCO 2:	(32.042.998,51)			

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
ABEV3	5.948.520,05	275.391,15	-67.665,99	-0,29%	832.792,81	-1.784.556,02	872.053,04	-879.191,26
ARZZ3	1.652.448,00	366.476,56	354.076,62	1,53%	495.734,40	-495.736,64	242.248,88	-244.231,81
B3SA3	10.095.614,28	1.977.448,87	1.878.027,39	8,12%	2.523.903,57	-2.523.903,57	1.480.017,05	-1.492.131,79
BBAS3	8.036.062,00	752.350,26	315.114,08	1,36%	2.009.015,50	-2.009.033,51	1.178.086,69	-1.187.729,96
BBDC4	9.366.178,80	1.662.945,87	1.576.852,82	6,82%	2.341.544,70	-2.341.544,70	1.373.081,81	-1.384.321,23
BBSE3	2.097.054,00	219.415,01	-81.221,34	-0,35%	419.410,80	-419.410,80	307.428,12	-309.944,58
BEEF3	2.537.626,00	835.714,99	624.184,95	2,70%	634.406,50	-634.406,50	372.015,97	-375.061,12
BPA11	4.697.180,00	821.447,81	765.109,74	3,31%	1.409.154,00	-1.644.013,00	688.606,69	-694.243,20
BRFS3	691.050,00	225.118,20	202.557,57	0,88%	172.762,50	-172.762,50	101.307,93	-102.137,19
BRKM5	406.526,00	105.844,07	99.705,84	0,43%	223.589,30	-121.957,80	59.596,71	-60.084,54
CAIXA	10.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CIEL3	1.794.681,00	289.279,03	5.522,17	0,02%	538.404,30	-448.670,25	263.100,24	-265.253,85
COMPROMISSADA_PRE	1.994.579,31	0,00	0,00	0,00%	-55,52	56,61	259,13	-394,39
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	1.834.924,80	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPFE3	2.071.152,00	203.706,78	-58.869,86	-0,25%	414.230,40	-414.230,40	303.630,88	-306.116,27
CPLE6	1.390.508,00	181.148,51	23.868,27	0,10%	305.911,76	-305.911,76	203.848,47	-205.517,08
CSMG3	1.449.838,00	189.935,58	156.004,03	0,67%	318.920,36	-391.402,26	212.516,93	-214.296,50
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ECOR3	2.202.240,00	294.250,07	39.601,89	0,07%	550.560,00	-550.560,00	322.848,38	-325.491,07
EGE3	1.500.471,00	111.389,11	80.454,62	0,35%	270.084,78	-270.084,78	219.969,05	-221.769,61
ELET3	4.522.706,60	646.793,18	582.491,89	2,52%	1.356.811,98	-1.356.811,98	663.028,79	-668.456,04
ELET6	4.207.920,00	646.093,01	573.668,81	2,48%	1.262.376,00	-1.262.376,00	616.881,07	-621.930,58
ENEV3	2.140.005,00	236.033,40	202.887,26	0,88%	791.801,85	-1.091.402,55	313.724,73	-316.292,74
ENGH1	2.822.964,00	269.714,16	215.254,27	0,93%	479.897,47	-621.052,08	413.846,52	-417.234,08
EQTL3	4.914.990,00	335.329,02	223.407,12	0,97%	982.998,00	-982.998,00	720.537,53	-726.435,52
GGBR4	5.300.725,80	630.018,20	574.488,25	2,48%	1.325.181,45	-1.325.181,45	777.086,40	-783.447,27
GMAT3	2.249.694,00	732.160,01	647.934,17	2,80%	404.944,92	-359.951,04	328.805,14	-332.504,77
HAPV3	3.067.464,12	1.977.990,32	1.886.768,46	8,16%	1.042.937,80	-1.042.937,80	449.690,24	-453.371,20
ITS44	3.899.666,76	311.754,34	258.999,43	1,12%	740.873,27	-740.917,68	571.676,49	-576.355,97
ITUB4	17.426.168,21	1.525.910,84	1.266.350,46	5,48%	3.485.233,64	-3.310.971,96	2.554.676,26	-2.575.587,66
IREN3	4.462.802,50	1.496.244,00	1.305.433,19	5,65%	892.560,50	-892.560,50	654.246,85	-659.602,21
MDAI3	1.169.277,00	545.763,76	487.984,62	2,11%	233.855,40	-233.855,40	171.416,01	-172.819,14
MGLU3	3.286.240,00	781.546,00	642.051,71	2,78%	1.708.844,80	-1.478.808,00	481.762,78	-485.706,27
MRVE3	3.291.120,00	1.170.849,06	991.621,25	4,29%	987.336,00	-987.368,65	482.478,19	-486.427,54
MULT3	2.273.621,00	94.714,07	45.171,90	0,20%	682.086,30	-668.405,25	333.312,84	-336.041,18
NTCO3	1.661.244,00	555.289,91	365.354,20	1,58%	415.311,00	-415.311,00	243.538,37	-245.531,86
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PETR3	4.667.758,00	633.117,93	563.425,54	2,44%	1.166.939,50	-1.400.327,40	684.293,32	-689.894,63
PETR4	17.820.605,08	2.531.347,94	2.237.914,77	9,68%	4.455.161,27	-5.346.181,52	2.612.500,71	-2.633.885,43
PRIO3	4.434.443,00	696.741,29	539.630,85	2,33%	2.660.665,00	-2.660.665,00	650.089,34	-655.410,68
RADL3	4.784.823,68	498.287,00	471.369,21	2,04%	956.964,74	-956.964,74	701.455,15	-707.195,94
RAIL3	2.338.086,00	147.876,23	118.575,96	0,51%	1.052.138,70	-771.568,38	342.763,41	-345.569,11
RDOR3	2.467.900,00	878.029,98	836.858,27	3,62%	740.370,00	-740.378,51	361.794,14	-364.755,62
RENT3	8.083.812,00	1.103.566,20	1.071.196,96	4,63%	2.667.657,96	-2.101.791,12	1.185.086,84	-1.194.787,41
SBSB3	2.317.455,00	347.257,58	246.382,75	1,07%	579.363,75	-579.363,75	339.738,90	-342.519,85
STBP3	1.203.950,00	210.091,81	180.762,66	0,78%	421.382,50	-421.382,50	176.499,07	-177.943,81
SUZB3	4.827.284,00	903.944,06	737.081,09	3,19%	1.206.821,00	-965.456,80	707.679,83	-713.472,58
TIMS3	2.109.356,00	117.951,99	-46.370,45	-0,20%	674.993,32	-485.151,88	309.231,59	-311.762,82
TOTS3	2.075.983,08	347.076,34	269.102,53	1,16%	415.196,62	-415.196,62	304.339,12	-306.830,30
UGPA3	1.088.599,00	141.996,73	132.241,85	0,57%	272.149,75	-217.719,80	159.588,61	-160.894,93
USIM5	904.492,00	107.925,30	88.997,33	0,38%	313.751,88	-176.988,24	117.939,63	-118.903,92
VALE3	27.048.739,95	1.910.861,64	-742.426,54	-3,21%	6.762.184,99	-6.762.184,99	3.965.345,20	-3.997.603,77
WAM03	1.539.252,00	236.138,04	56.221,38	0,24%	538.738,20	-615.700,80	226.654,34	-227.501,45
VBR3	1.552.685,00	440.511,51	372.672,57	1,61%	388.171,25	-388.180,90	227.623,62	-229.486,84
WEGE3	4.998.369,00	326.569,79	-195.795,58	-0,85%	1.249.592,25	-1.249.592,25	732.760,90	-738.758,94
<b>Total Var:</b>	<b>220.636.555,02</b>	<b>32.047.363,63</b>	<b>23.121.031,95</b>	<b>99,99%</b>	<b>56.775.654,61</b>	<b>-57.453.833,21</b>	<b>31.782.706,80</b>	<b>-32.042.998,51</b>





Data: 31/05/2023

**Relatório de Risco de Mercado**

**FUNDO:** FIA RVA EMB III  
**CNPJ:** 38452593000108

Dados Gerais							
PL:	95.198.677,86	VAR / PL:	12,7747%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	1,00
VAR:	12.161.375,28	ETL / PL:	16,0200%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1,00
ETL:	15.250.855,24	VAR / CDI:	0,1436%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	26.616.566,99	Cenário Baixa - 10000 (-):	977.735,11	CENARIO BRADESCO 1 (+):	13.175.925,97	CENARIO BRADESCO 2 (+):	1.252.050,07
Cenário Alta - 09999 (-):	(961.426,38)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(26.322.573,85)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(1.245.650,78)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(13.284.213,48)
Cenário Alta - 09999:	25.655.140,61	Cenário Baixa - 10000:	(25.344.838,75)	CENARIO BRADESCO 1:	11.930.275,19	CENARIO BRADESCO 2:	(12.032.163,41)

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

Produto	MIM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
ALSO3	4.437.019,18	632.805,22	605.218,13	4,98%	1.552.956,71	-1.109.254,90	650.467,01	-655.791,44
ASAJ3	369.746,25	43.354,78	16.475,13	0,14%	103.528,95	-96.134,03	54.204,80	-54.648,50
AURE3	2.962.333,44	157.737,34	49.469,83	0,41%	740.583,36	-918.323,37	434.278,08	-437.832,88
BBAS3	2.698.796,08	252.666,04	91.204,71	0,75%	674.699,02	-674.705,07	395.643,51	-398.882,06
BPAC11	4.269.068,60	746.579,24	679.246,56	5,59%	1.280.720,58	-1.494.174,01	625.845,46	-630.968,34
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	6.523.624,13	0,00	0,00	0,00%	-181,59	185,17	847,53	-1.289,92
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-1.315.741,37	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
DOLN23	-52.006,54	337.196,18	16.035,94	0,13%	-961.244,79	977.549,94	-1.245.650,78	1.252.050,07
ELET3	7.722.051,50	1.104.332,13	964.479,74	7,93%	2.316.615,45	-2.316.615,45	1.132.052,75	-1.141.319,21
ENEV3	5.446.329,90	600.706,90	517.645,19	4,26%	2.015.142,06	-2.777.628,25	798.431,96	-804.967,56
ENJUS	232.840,00	73.051,09	32.090,89	0,51%	127.278,00	-76.365,80	41.464,34	-41.903,75
EQTL3	9.896.723,65	675.211,68	426.645,52	3,51%	1.979.344,73	-1.979.344,73	1.450.859,69	-1.462.735,76
EQTL9	138.976,55	9.481,78	5.991,25	0,05%	0,00	0,00	0,00	0,00
EUCA4	44.075,00	9.198,39	6.849,62	0,06%	35.260,00	-35.260,43	6.461,40	-6.514,29
HAPV3	1.580.961,69	1.019.454,33	984.756,74	8,10%	537.526,98	-537.526,98	231.768,98	-233.666,14
IGT11	4.891.800,32	457.109,21	415.372,87	3,42%	978.360,06	-978.360,06	717.137,93	-723.008,09
ITUB4	9.042.406,58	791.792,33	630.125,34	5,18%	1.808.481,32	-1.718.057,25	1.325.616,81	-1.336.467,69
LREN3	2.211.970,70	741.607,52	666.050,14	5,48%	442.394,14	-442.394,14	324.274,91	-326.929,27
LWSA3	317.422,74	144.826,10	132.421,58	1,09%	126.969,10	-126.969,10	46.534,17	-46.915,08
NINJ3	362.984,00	115.901,64	102.998,67	0,85%	217.790,40	-217.790,40	53.213,45	-53.649,04
NTCO3	2.928.053,67	978.735,61	893.574,52	5,70%	732.013,42	-732.013,42	429.252,67	-432.766,33
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PETZ3	726.573,25	188.568,39	164.614,17	1,35%	181.643,31	-181.643,31	106.516,64	-107.387,53
PRIO3	2.748.876,00	431.904,39	322.975,37	2,66%	1.649.325,60	-1.649.325,60	402.985,22	-406.283,87
RECV3	3.764.048,57	577.135,24	371.049,34	3,05%	2.258.429,14	-2.258.429,14	551.809,52	-556.326,38
RENT3	6.195.252,36	845.748,40	820.224,07	6,74%	2.044.433,28	-1.610.765,61	908.224,00	-915.658,30
RENT9	31.888,56	4.356,61	4.213,50	0,03%	0,00	0,00	0,00	0,00
SCAR3	119.194,00	22.402,23	14.943,08	0,12%	71.516,40	-71.516,40	17.473,84	-17.616,87
SMFT3	2.564.130,00	642.282,27	565.911,59	4,65%	1.025.652,00	-1.025.652,00	375.901,46	-378.978,41
SOMA3	1.760.669,55	566.216,18	525.088,89	4,35%	528.200,87	-528.217,88	258.114,16	-260.226,96
SUZB3	8.432.387,46	1.579.025,92	1.346.108,35	11,07%	2.108.096,87	-1.686.477,49	1.236.188,00	-1.246.306,87
VBBR3	2.979.192,22	845.225,18	744.768,45	6,12%	744.798,06	-744.816,57	436.749,58	-440.324,61
VIVA3	1.116.024,00	247.834,18	210.826,12	1,73%	334.807,20	-334.811,58	163.609,12	-164.948,35
<b>Total Var:</b>	<b>95.198.672,05</b>	<b>14.848.446,49</b>	<b>12.161.375,28</b>	<b>100,01%</b>	<b>25.655.140,62</b>	<b>-25.344.838,75</b>	<b>11.930.275,19</b>	<b>-12.032.163,41</b>



Data: 31/05/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIA RVA EMB IV  
CNPJ: 38452613000132

Dados Gerais							
PL:	89.809.700,89	VAR / PL:	13,2065%	Limite Fundo:	0,00% Dutation DC:	1,00	
VAR:	11.860.720,34	ETL / PL:	16,5615%	Status:	ENQUADRADO	Dutation DU:	1,00
ETL:	14.873.821,81	VAR / CDI:	0,1485%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	26.000.592,22	Cenário Baixa - 10000 (+):	209,84	CENARIO BRADESCO 1 (+):	12.069.979,14	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
Cenário Alta - 09999 (-):	(205,78)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(23.756.560,19)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(12.169.271,91)
Cenário Alta - 09999:	26.000.386,44	Cenário Baixa - 10000:	(23.756.350,35)	CENARIO BRADESCO 1:	12.069.979,14	CENARIO BRADESCO 2:	(12.169.271,91)

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

Produto	M/M	VAR Tot	Comp VAR	Comp VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
ALSO3	4.916.684,63	701.214,85	678.780,02	5,72%	1.720.839,62	-1.229.171,16	720.785,97	-726.685,99
AURE3	4.023.794,66	214.577,16	54.884,36	0,46%	1.007.448,64	-1.249.236,31	590.767,88	-595.603,64
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	7.393.040,45	0,00	0,00	0,00%	-205,79	209,84	960,49	-1.461,83
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-125.380,34	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
EQTL3	13.903.144,25	948.552,84	642.401,08	5,42%	2.780.628,85	-2.780.628,85	2.038.200,95	-2.054.884,72
EQTL9	188.548,70	12.863,88	8.711,98	0,07%	0,00	0,00	0,00	0,00
GGPS3	6.719.287,20	1.137.488,89	1.045.110,50	8,81%	3.023.679,24	-3.023.679,24	985.047,50	-993.110,65
GMAT3	7.155.113,13	2.328.622,33	2.176.082,02	18,35%	1.287.920,36	-1.144.818,10	1.048.939,59	-1.057.525,72
HAFV3	3.720.675,00	2.399.209,45	2.338.511,67	19,72%	1.265.029,50	-1.265.029,50	545.450,96	-549.915,77
ITUB4	6.191.394,18	542.145,32	414.852,24	3,50%	1.236.278,64	-1.176.364,89	907.653,39	-915.080,06
MATD3	1.400.398,35	242.844,61	213.280,85	1,80%	420.119,51	-420.119,51	205.298,40	-206.978,88
MULT3	876.630,79	36.518,52	15.047,82	0,13%	262.989,24	-219.157,70	128.514,07	-129.566,03
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PRI03	7.030.592,27	1.104.649,20	828.489,68	6,99%	4.218.355,36	-4.218.355,36	1.030.684,83	-1.039.121,54
RAIL3	8.112.533,82	513.091,00	396.645,12	3,34%	3.650.640,22	-2.677.136,16	1.189.297,46	-1.199.032,50
RENT3	6.964.734,48	950.794,69	902.209,37	7,61%	2.298.362,38	-1.810.830,97	1.021.030,08	-1.029.387,76
RENT9	26.304,96	3.593,78	3.398,88	0,03%	0,00	0,00	0,00	0,00
UGPA3	5.686.059,01	741.688,87	701.289,17	5,91%	1.421.514,75	-1.137.211,80	833.576,25	-840.399,52
VBRB3	5.619.142,88	1.594.204,30	1.441.025,60	12,16%	1.404.785,72	-1.404.820,64	823.766,35	-830.509,32
<b>Total Var:</b>	<b>89.809.698,32</b>	<b>13.472.059,68</b>	<b>11.860.720,34</b>	<b>100,01%</b>	<b>26.000.386,44</b>	<b>-23.756.350,35</b>	<b>12.069.979,14</b>	<b>-12.169.271,91</b>



Data: 31/05/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI  
CNPJ: 4190187/1000163

Dados Gerais		Limite Fundo:		ENQUADRADO		0,00% Dutation DC:		1,91	
PL:	99.067.521,21	VAR / PL:	9,5687%	Status:		Dutation DC:			
VAR:	9.479.426,53	ETL / PL:	11,9995%	Benchmark:		Dutation DU:			
ETL:	11.887.583,30	VAR / CDI:	0,1076%						

Cenários de STRESS										
Cenário Alta - 09999 (+):	25.462.295,08	Cenário Baixa - 10000 (-):	692,71	CENARIO BRADESCO 1 (+):	14.384.026,35	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-			
Cenário Alta - 09999 (-):	(647,74)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(25.786.809,05)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(14.501.320,01)			
Cenário Alta - 09999:	25.461.647,34	Cenário Baixa - 10000:	(25.786.116,34)	CENARIO BRADESCO 1:	14.384.026,35	CENARIO BRADESCO 2:	(14.501.320,01)			

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

Produto	Mtm	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
ABEVA	3.133.613,01	145.072,84	-35.513,23	-0,37%	438.705,82	-340.083,90	459.387,67	-463.148,00
ALPA	104.942,88	57.492,11	51.892,45	0,55%	26.234,72	-26.235,72	15.384,63	-15.510,56
ALSO3	571.892,97	81.563,06	76.441,07	0,81%	200.162,54	-142.973,24	83.839,51	-84.525,78
ARZZ3	222.195,24	49.278,01	47.510,49	0,50%	66.658,57	-66.658,57	32.573,82	-32.840,46
ASAJ3	634.604,75	74.410,89	25.256,74	0,27%	177.689,33	-164.997,24	93.033,06	-93.794,58
AZUL4	273.694,55	123.833,09	79.295,09	0,84%	123.162,55	-123.162,55	40.123,62	-40.452,05
B3SA3	3.785.863,68	741.544,96	702.240,42	7,41%	946.465,92	-946.465,92	555.007,62	-559.550,65
BBAS3	3.142.586,60	294.214,49	127.669,16	1,35%	785.646,65	-785.653,69	460.703,20	-464.474,30
BBDC3	987.168,57	130.296,68	125.874,20	1,33%	246.792,14	-246.792,14	144.718,91	-145.903,52
BBDC4	3.957.143,85	702.582,79	662.780,97	6,99%	989.285,96	-989.285,96	580.117,29	-584.865,86
BBSE3	1.029.907,14	107.769,31	-37.746,24	-0,40%	205.981,43	-205.981,43	160.984,39	-162.220,28
DEEFS	43.438,28	43.438,28	31.633,59	0,33%	32.974,83	-32.974,83	19.336,44	-19.494,72
BPAFC11	1.597.761,30	278.416,44	261.988,53	2,78%	478.325,39	-458.212,96	234.230,34	-236.147,64
BRAP4	264.911,47	16.387,75	1.973,59	0,02%	66.227,87	-66.227,87	38.836,02	-39.153,92
BRFS3	433.865,58	141.337,15	125.946,40	1,33%	108.466,40	-108.466,40	63.604,69	-64.125,33
BRKM5	295.281,62	76.880,22	72.231,81	0,76%	162.404,89	-88.584,49	43.288,29	-43.642,62
CAIXA	9.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CASH3	30.511,87	4.991,25	1.510,67	0,02%	12.204,75	-12.204,75	4.473,04	-4.509,65
CCRO3	671.674,29	48.313,25	1.095,63	0,01%	167.918,57	-167.918,57	98.467,45	-99.273,46
CIEL3	253.595,01	40.876,19	1.166,74	0,01%	76.078,50	-63.398,75	37.177,03	-37.481,34
CMIG4	836.433,00	96.350,98	-15.039,71	-0,16%	209.108,25	-250.929,90	122.621,08	-123.624,80
CMIN3	242.237,60	29.279,72	23.874,03	0,25%	84.783,16	-84.783,16	35.512,03	-35.802,72
COGN3	268.106,78	98.931,36	86.927,55	0,92%	65.026,45	-81.037,02	38.131,51	-38.443,63
COMPROMISSADA_PRE	2.764.911,67	0,00	0,00	0,00%	-78,98	78,48	359,21	-548,71
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	972.389,34	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPFE3	281.815,96	27.717,82	-7.351,85	-0,08%	56.363,19	-56.363,19	41.314,22	-41.652,40
CPLE6	575.057,42	74.915,64	11.524,57	0,12%	126.512,63	-126.512,63	84.303,42	-84.993,49
CRFB3	248.227,64	28.618,60	12.129,10	0,13%	62.056,91	-62.056,91	36.390,17	-36.688,05
CSAN3	870.810,00	102.438,79	93.614,38	0,99%	217.702,50	-217.702,50	127.660,75	-128.705,72
CSNA3	355.180,95	40.673,98	-1.618,86	-0,02%	142.069,46	-106.557,21	52.069,53	-52.495,74
CVCB3	46.775,82	13.605,26	11.528,11	0,12%	23.387,91	-23.387,91	6.857,34	-6.913,47
CYRE3	253.861,20	55.280,39	50.230,50	0,53%	81.235,58	-73.619,75	37.216,05	-37.520,69
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DXCO3	120.590,10	53.848,78	49.547,53	0,52%	30.147,53	-36.178,39	17.678,51	-17.823,22
EGIE3	531.765,56	39.476,05	28.109,11	0,30%	95.717,44	-96.717,44	77.956,54	-78.594,65
ELT3	3.533.141,70	505.275,30	458.027,16	4,83%	1.050.942,51	-1.050.942,51	517.958,67	-522.198,34
ELTE6	538.164,60	82.630,94	73.801,56	0,78%	161.449,38	-161.449,38	78.894,93	-79.540,73
EMBR3	692.670,36	154.712,37	-117.078,92	-1,24%	173.167,59	-173.167,59	101.545,48	-102.376,68
ENBR3	280.508,00	11.695,29	-7.006,60	-0,07%	53.296,52	-42.076,20	41.122,47	-41.459,08
ENEV3	895.630,45	98.784,21	85.346,38	0,90%	331.383,27	-456.771,53	131.299,42	-132.374,18
ENGH1	542.484,72	51.830,56	41.677,30	0,44%	92.221,17	-119.346,64	79.528,26	-80.179,24
EQLT3	1.535.751,40	104.777,84	70.723,00	0,75%	307.150,28	-307.150,28	225.141,16	-226.984,06
EQTL9	21.450,30	1.463,46	987,81	0,01%	0,00	0,00	0,00	0,00
EZTC3	82.437,88	17.438,54	16.033,34	0,17%	16.487,58	-24.731,36	12.085,39	-12.184,32
FLRY3	311.207,58	50.571,74	44.002,89	0,46%	62.239,52	-62.241,52	45.623,03	-45.996,48
GGBR4	1.298.910,33	154.382,09	141.751,04	1,50%	324.727,58	-324.727,58	190.420,25	-191.978,95
GOAU4	370.770,75	39.732,82	34.614,37	0,37%	111.231,23	-92.692,69	54.354,99	-54.799,92
GOLL4	90.005,75	25.123,04	22.114,18	0,23%	54.003,45	-31.502,02	13.194,84	-13.302,35
HAPV3	856.280,44	551.512,00	523.246,43	5,52%	290.795,35	-290.795,35	125.384,11	-126.410,45
HYPE3	811.134,22	134.390,10	112.566,17	1,19%	186.558,88	-170.338,19	118.912,28	-119.885,64
IGTI1	232.723,20	21.746,58	19.004,34	0,20%	46.544,64	-46.544,64	34.117,22	-34.396,49
INDM23	-17.570,00	348.367,65	348.218,31	3,67%	688.144,95	-687.810,39	554.415,21	-558.315,36
IRBR3	153.444,00	176.937,84	136.195,64	1,44%	99.738,60	-84.394,60	22.494,89	-22.679,02
ITSA4	2.182.470,94	174.479,59	147.232,12	1,55%	414.644,62	-414.669,48	319.950,24	-322.569,21
ITUB4	6.267.408,89	548.801,50	462.107,94	4,87%	1.253.481,78	-1.190.807,69	118.802,14	-926.323,03
JBS33	945.252,00	79.080,85	34.854,08	0,37%	330.838,20	-330.838,20	138.573,94	-139.708,25
KLBN11	730.020,08	129.928,39	118.101,32	1,25%	182.500,02	-146.004,02	107.020,94	-107.896,97
LFT20230901 - 210100	983.679,94	28,25	-2,81	0,00%	-570,78	614,23	11,93	-18,17
LRNS	916.678,50	307.334,84	263.941,75	2,78%	163.335,70	-163.335,70	134.385,07	-135.488,08
LWSA3	153.571,64	74.830,58	65.760,08	0,69%	65.428,65	-65.428,65	23.979,60	-24.175,89
MGLL3	541.435,40	128.766,21	103.897,95	1,10%	281.546,41	-243.645,83	79.374,43	-80.024,15
MRF33	96.313,20	13.299,82	9.797,63	0,10%	38.525,28	-28.893,96	14.119,52	-14.235,09
MRVE3	162.570,88	54.278,63	44.932,83	0,47%	45.771,26	-45.772,78	22.366,89	-22.549,98
MULT3	351.071,49	14.624,67	6.897,08	0,07%	105.321,45	-87.767,87	51.467,08	-51.888,37
NTCO3	577.643,43	193.083,96	123.754,76	1,31%	144.410,86	-144.410,86	84.682,53	-85.375,70
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PCAR3	127.423,56	30.096,05	26.963,90	0,28%	22.936,24	-20.387,77	18.680,29	-18.833,20
PETR3	4.330.908,28	587.428,85	527.769,92	5,57%	1.082.727,07	-1.299.272,48	634.911,15	-640.108,24
PETR4	5.912.967,24	839.914,10	748.988,26	7,90%	1.478.241,81	-1.773.890,17	866.841,00	-873.936,56
PETZ3	120.712,50	31.328,65	26.443,37	0,28%	30.178,13	-30.178,13	17.696,45	-17.841,31
PRIO3	1.422.304,00	223.472,92	175.475,92	1,85%	853.382,40	-853.382,40	208.609,77	-210.216,53
RADL3	1.534.641,00	170.229,37	160.631,69	1,69%	326.928,20	-326.928,20	233.638,37	-241.599,94
RAIL3	1.254.675,66	79.354,10	63.988,99	0,68%	564.604,05	-414.042,97	183.935,45	-185.441,06
RAZ4	216.028,56	50.569,23	44.430,85	0,47%	75.610,00	-75.610,00	31.669,79	-31.923,02
RDR3	1.574.468,00	560.164,55	531.327,67	5,61%	472.340,40	-472.345,83	230.817,01	-232.706,37
RENT3	2.379.047,88	324.777,08	315.234,77	3,33%	785.085,80	-618.552,45	348.768,42	-351.623,28
RRRP3	352.626,54	104.359,72	90.611,68	0,96%	211.575,92	-211.575,92	51.695,05	-52.118,20
SANB11	504.218,00	70.606,52	65.738,98	0,69%	100.843,60	-100.843,60	73.918,36	-74.523,42
SBS3	885.730,25	132.721,69	92.640,86	0,98%	221.432,56	-221.432,56	129.848,06	-130.910,93
SLECE3	181.247,97	9.078,81	-2.598,84	-0,03%	54.374,39	-54.374,39	26.570,95	-26.788,45
SMT03	256.951,68	44.336,46	38.055,17	0,40%	77.085,50	-77.085,50	37.669,12	-37.977,46
SOMA3	251.784,45	80.971,71	73.284,40	0,77%	75.535,34	-75.537,77	36.911,60	-37.213,74
SUZB3	1.615.468,18	302.133,66	243.069,69	2,56%	403.367,05	-322.693,64	236.534,44	-238.470,60
TAEF11	400.025,20	30.120,61	23.055,78	0,34%	100.007,05	-100.007,05	56.644,13	-59.124,17
TIMS3	559.474,92	31.284,99	-11.965,72	-0,13%	179.031,97	-128.679,23	82.019,02	-82.680,39



bradesco

Data: 31/05/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI  
CNPJ: 4190187/1000163

Dados Gerais							
PL:	99.067.521,21	VAR / PL:	9,5687%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	1,91
VAR:	9.479.426,53	ETL / PL:	11,9995%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1,65
ETL:	11.887.583,30	VAR / CDI:	0,1076%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	25.462.295,08	Cenário Baixa - 10000 (+):	692,71	CENARIO BRADESCO 1 (+):	14.384.026,35	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
Cenário Alta - 09999 (-):	(647,74)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(25.786.809,05)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(14.501.320,01)
Cenário Alta - 09999:	25.461.647,34	Cenário Baixa - 10000:	(25.786.116,34)	CENARIO BRADESCO 1:	14.384.026,35	CENARIO BRADESCO 2:	(14.501.320,01)

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

Produto	MtM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
TOTS3	732.632,24	122.486,22	93.157,21	0,98%	146.526,45	-146.526,45	107.403,99	-108.283,05
UGPA3	913.034,90	119.096,17	110.001,05	1,16%	238.258,73	-182.606,98	133.850,92	-134.946,56
USIM5	179.227,62	24.043,99	20.092,19	0,21%	69.898,77	-39.430,08	26.274,77	-26.489,84
VALE3	12.764.041,92	901.717,35	-343.390,75	-3,62%	3.191.010,48	-3.191.010,48	1.871.208,55	-1.886.525,40
VBBR3	888.924,23	252.196,26	210.681,63	2,22%	222.231,06	-222.236,58	130.316,29	-131.383,00
VIIA3	186.058,88	59.553,37	53.455,85	0,56%	83.718,68	-83.726,50	27.276,23	-27.499,50
VIVT3	838.960,00	38.154,53	18.577,88	0,20%	125.844,00	-125.844,00	122.991,54	-123.998,29
WEGE3	2.350.436,95	153.566,44	-89.965,94	-0,95%	587.609,24	-587.609,24	344.574,06	-347.394,58
YDUQ3	206.463,18	129.647,62	121.439,42	1,28%	80.520,64	-51.615,80	30.267,50	-30.515,26
<b>Total Var:</b>	<b>99.067.022,62</b>	<b>13.574.944,72</b>	<b>9.479.426,53</b>	<b>99,99%</b>	<b>25.461.647,33</b>	<b>-25.786.116,34</b>	<b>14.384.026,34</b>	<b>-14.501.320,00</b>



### 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

31/05/2023

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	1.568.424,24	-	Aaa.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	18/05/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	1.275.893,98	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	471.668,50	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	283.001,10	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	20/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	942.631,21	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	25/08/17	25/08/17	15/08/24	PETR	18.684.723,58	AAA	Aaa.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	18/12/17	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	3.518.774,77	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	21/12/17	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	1.027.056,30	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/01/18	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	3.654.716,46	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB II	19/02/18	19/02/18	15/02/25	SABESP	9.419.762,98	brAAA	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/02/18	19/02/18	15/02/25	SABESP	5.845.991,95	brAAA	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	13/03/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	12.694.073,03	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB II	23/05/18	23/05/18	15/05/28	COMGAS	26.312.373,90	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	624.764,74	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	624.764,74	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	624.764,74	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	623.429,97	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	624.764,74	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	04/07/18	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	12.789.931,84	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/07/18	26/07/18	15/07/25	AEGEA SA	14.715.217,52	brA	Aa1.br	AA(bra)
FI RF EMB II	26/07/18	26/07/18	15/07/25	CSMG	13.274.153,40	-	Aa3.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/02/13	15/02/25	CEMIG	1.318.654,04	brA+	A1.br	AA-(bra)
FIM EMB I A	12/02/19	09/01/19	15/01/25	ITAUUBB	2.589.612,28	-	AAA.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	549.952,76	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	3.482.152,84	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	1.983.002,75	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	5.995.278,33	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	723.598,00	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	5.854.565,68	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	8.683.176,06	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	894.630,26	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	601.510,83	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	30/09/20	28/09/20	22/09/25	HAPVIDA	258.853,55	-	-	AAA(bra)
FIM EMB II A	08/01/21	22/05/19	15/04/24	ECORODOV	1.333.653,46	-	-	AA(bra)
FIM EMB II A	20/01/21	26/07/18	15/07/23	AEGEA SA	373.790,32	-	Aa1.br	AA(bra)
FIM EMB II A	20/01/21	31/07/18	23/07/23	COPEL GT	91.730,30	-	-	AA+(bra)
FIM EMB II A	04/02/21	26/07/18	15/07/23	AEGEA SA	126.351,66	-	Aa1.br	AA(bra)
FIM EMB II A	05/02/21	31/07/18	23/07/23	COPEL GT	57.650,66	-	-	AA+(bra)
FIM EMB II A	05/02/21	26/07/18	15/07/23	AEGEA SA	173.733,53	-	Aa1.br	AA(bra)
FIM EMB II A	05/02/21	07/08/19	15/07/24	COPEL GT	298.398,59	-	-	AA+(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	6.181.772,98	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	6.195.268,82	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	4.187.951,05	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/07/19	15/06/29	NEOENERG	619.303,50	brAA+	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/07/19	15/06/29	NEOENERG	6.156.185,85	brAA+	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	1.734.212,40	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	3.323.851,15	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	3.556.188,82	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	31/07/20	15/07/34	IGUA SAN	2.671.613,74	brAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	23/05/18	15/05/28	COMGAS	22.917.228,88	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	16/07/13	16/07/23	DUKE GEP	6.282.254,48	-	Aaa.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	477.936,06	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	841.167,46	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	955.872,11	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	477.936,06	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	584.993,73	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	492.186,90	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	1.428.008,41	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	26/10/16	27/01/25	BRDESCO	13.695.793,38	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	12/12/17	15/11/24	CCR	6.144.941,05	brAAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	14/12/17	15/11/24	ECORODOV	4.213.688,85	brAA	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	19/02/18	15/02/25	SABESP	1.372.943,15	brAAA	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	23/05/18	15/05/28	COMGAS	10.185.435,06	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	28/06/18	15/06/27	JAGUARA	1.877.686,75	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	28/06/18	15/06/27	ENERGMIR	1.168.388,83	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	31/07/18	01/08/25	BRDESCO	4.433.780,21	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB I A	28/05/21	28/05/21	28/11/23	B.ALFA	1.206.957,58	-	Aa1.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	177.451,56	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	326.800,00	-	-	D



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/05/2023

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	22/12/20	15/12/26	IRB	2.648.000,81	brAA+	-	-
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	3.264.473,50	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	999.218,98	-	-	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	1.368.157,87	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	07/04/21	15/03/31	LOCALIZA	5.244.827,25	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	284.661,90	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	1.604.684,67	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/06/21	06/01/21	15/11/25	QUATA	1.123.406,75	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	707.623,31	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	29.258,53	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	419.983,11	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	789.980,36	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	491.599,47	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	491.599,47	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	413.899,99	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	841.260,15	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	828.641,24	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	1.705.747,01	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	425.940,32	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	197.495,09	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	494.260,20	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	1.473.786,88	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	14/06/21	19/06/19	19/06/24	BNBBM	569.904,70	brAAA	AAbr	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	14/06/21	12/06/19	12/06/24	BNBBM	864.085,61	brAAA	AAbr	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/06/21	06/07/20	29/06/24	SBF COME	505.242,14	brA+	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/06/21	06/07/20	29/06/24	SBF COME	1.209.734,69	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	2.124.442,58	brAAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	16/06/21	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	1.777.069,13	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	17/06/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	780.266,38	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	17/06/21	18/03/21	15/02/26	CORSAN	785.159,19	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	18/06/21	18/06/21	15/12/30	MG050	546.846,49	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	1.544.473,86	-	-	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	84.414,56	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	25/06/21	25/06/21	20/06/26	OURO VER	1.500.946,19	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	3.126.465,31	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	01/07/21	06/12/19	15/10/26	LIGHT	2.067.771,49	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	01/07/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	2.734.614,99	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/07/21	01/03/21	18/02/25	RENNER	1.141.065,71	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/07/21	01/03/21	18/02/25	RENNER	241.319,27	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/07/21	07/04/21	15/03/29	CAGECE	1.210.026,55	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	08/07/21	08/07/21	15/06/31	VAMOS	258.983,75	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/07/21	07/04/21	15/03/29	CAGECE	2.757.709,18	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/07/21	08/07/21	15/06/31	VAMOS	5.138.566,52	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	12/07/21	12/07/21	12/07/26	BRADESCO	3.915.056,53	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	2.079.892,91	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	220.997,96	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	1.010.233,70	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	525.321,52	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	1.859.431,09	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	290.672,19	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	4.159.785,83	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	377.132,37	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	377.132,37	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	1.344.558,88	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	902.056,11	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/07/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	2.876.148,58	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	19/07/21	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	633.356,86	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/21	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	1.817.091,79	-	-	AA(bra)



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/05/2023

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	19/07/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	323.600,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/07/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	1.930.421,81	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/07/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	707.367,89	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	11/06/18	15/05/25	INTERVIA	1.260.810,95	-	Aa2.br	-
FIM EMB I A	21/07/21	17/03/21	05/03/24	ENERG TR	1.308.769,55	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.150.939,46	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	898.308,45	-	-	AA-(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	20/09/19	20/08/26	VAMOS	1.054.697,72	brAA+	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	23/07/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.640.539,46	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/07/21	07/11/19	15/10/24	BKBR	1.014.589,64	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/07/21	23/12/20	15/12/26	RD COLIN	2.197.029,35	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/07/21	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	1.008.177,56	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	04/08/21	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	351.788,47	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	06/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	1.174.165,33	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	11/08/21	11/08/21	15/08/31	CSAN	1.026.718,33	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	11/08/21	19/11/19	15/06/27	AUTOPIST	1.325.078,73	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	17/08/21	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	3.057.743,24	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	18/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	1.190.756,80	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	18/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	924.017,07	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	27/08/21	27/08/21	20/08/31	S LUIZ A	1.017.537,66	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/09/21	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	496.972,23	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	675.405,68	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	60.484,09	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	302.420,45	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/06/19	15/06/24	PROLAGOS	2.333.708,99	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	12/05/21	15/04/26	ELETROB	1.964.968,05	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/09/21	22/10/19	21/10/26	AUTOBAN	620.864,79	brAAA	-	-
FIM EMB I A	17/09/21	04/10/18	01/10/24	EQUATENE	1.419.567,78	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	17/09/21	28/04/21	15/03/28	BRISANET	1.454.522,53	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/09/21	20/09/21	15/09/29	MOV_PART	1.026.490,15	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.093.692,97	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.093.692,97	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	1.081.966,26	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	801.940,45	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	801.940,45	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	266.591,01	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	266.591,01	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	740.359,40	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	740.359,40	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	951.367,93	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	369.569,85	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	369.569,85	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	23/09/21	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	4.118.231,08	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	23/09/21	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	4.173.530,35	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	24/09/21	05/04/21	15/03/24	CCPR	41.099,27	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	24/09/21	09/09/21	11/09/23	PANAMERI	1.238.418,05	brAAA	AAAb	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	27/09/21	28/12/20	15/01/26	LOCAMERI	1.902.493,91	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	27/09/21	29/03/21	01/04/24	CNH	2.294.899,66	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	30/09/21	30/09/21	15/09/31	SIMPAR	859.396,02	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	04/10/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	630.475,73	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/10/21	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	5.471.601,12	-	-	AA-(bra)
FIM EMB I A	20/10/21	20/10/21	20/10/25	DAYCOVAL	2.535.674,08	brAA+	AA.br	AA(bra)
FIM EMB I A	20/10/21	20/10/21	20/10/24	DAYCOVAL	1.415.385,62	brAA+	AA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/10/21	22/10/21	15/12/35	CART	2.753.450,28	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	22/10/21	22/10/21	15/12/35	CART	848.062,69	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	25/10/21	22/04/21	15/03/26	VIX LOGI	1.009.466,25	-	-	A+(bra)
FIM EMB I A	27/10/21	27/10/21	15/10/29	CONT GLO	2.003.147,18	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/10/21	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	806.499,98	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/10/21	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	1.168.623,82	brAAA	-	-
FIM EMB I A	28/10/21	28/10/21	07/11/23	TOYOTA	2.680.341,74	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	04/11/21	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	3.182.848,05	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/11/21	10/11/21	15/10/28	LIGHT	292.231,32	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	12/11/21	12/11/21	15/10/31	VAMOS	2.097.778,68	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	18/11/21	18/11/21	15/10/31	HIDRO BR	4.015.626,12	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/11/21	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	1.760.851,58	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/11/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	2.107.645,87	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/11/21	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	2.290.519,50	-	-	AA(bra)





RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/05/2023

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	30/11/21	28/04/21	15/03/28	BRISANET	828.968,48	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	03/12/21	11/06/19	11/06/24	BNBBM	570.353,54	brAAA	Aabr	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/12/21	06/12/21	15/12/35	TESC	2.653.769,41	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/12/21	06/01/21	15/11/25	QUATA	2.400.960,79	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/12/21	20/12/21	15/11/35	ORIZON	2.074.904,92	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/01/22	22/04/21	15/03/26	VIX LOGI	990.906,10	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/01/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.282.524,40	brAA	-	-
FIM EMB I A	19/01/22	19/01/22	19/01/24	BES INV	1.208.566,14	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/01/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	352.571,89	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/01/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	2.100.807,35	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	352.441,64	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	341.427,83	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	4.096.207,60	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/02/22	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	2.136.423,80	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	815.021,28	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	726.910,87	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	25/03/22	25/03/22	15/03/44	GBS PART	2.180.527,89	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/03/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	1.051.096,56	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	12/04/22	12/04/22	08/04/27	UNIGEL P	627.350,68	-	-	BB+
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	19/04/22	19/04/22	16/04/29	VERT-10	1.131.090,49	-	-	AAAsf(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/04/22	26/04/22	15/04/24	LIGHT	779.504,22	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	2.656.192,66	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.310.425,58	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	12/05/22	12/05/22	15/04/27	BRKA	1.860.834,96	-	A+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	12/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.570.836,62	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	19/05/22	19/05/22	13/05/28	CEA MODA	481.107,14	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/05/22	26/05/22	10/05/27	GUAR	2.294.818,76	-	-	A
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	2.326.565,51	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	577.255,86	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.208.121,24	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	03/03/22	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	2.916.363,40	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/03/22	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	2.560.113,44	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/03/22	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	1.055.144,37	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/03/22	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	3.255.618,95	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/03/22	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	2.605.890,28	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/06/22	06/12/21	15/12/35	TESC	825.894,85	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/06/22	28/04/21	15/03/28	BRISANET	494.318,94	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	461.804,69	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	06/12/21	15/12/35	TESC	518.030,33	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	268.365,08	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	30/09/21	15/09/31	SIMPAR	1.849.963,00	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	08/07/21	15/06/31	VAMOS	881.778,01	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	08/07/21	15/06/31	VAMOS	71.939,93	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	747.257,57	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	844.996,37	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/06/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	1.286.887,39	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	27/06/22	27/06/22	07/07/24	LAGE	2.273.802,13	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	3.155.518,39	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	12/11/21	15/10/31	VAMOS	2.028.551,99	brAA+	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	12/11/21	15/10/31	VAMOS	1.520.889,55	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	25/07/22	25/07/22	22/07/27	CM HOSPI	1.516.398,53	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/07/22	10/01/22	10/01/28	AMBIPAR	2.435.376,37	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/07/22	03/05/21	26/04/26	GGSH PAR	2.296.307,41	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	27/07/22	25/03/22	15/03/44	GBS PART	1.340.149,26	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/07/22	28/07/22	18/07/25	1V11	1.696.459,49	brAAA(sf)	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	29/07/22	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	1.608.650,73	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/08/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	1.167,78	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	519.751,15	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	07/04/21	15/03/29	CAGECE	1.495.650,38	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	07/04/21	15/03/29	CAGECE	2.492.012,59	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	1.550.221,26	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	760.284,49	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/08/22	30/08/22	15/08/29	TRBR	9.245.536,18	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/09/22	02/09/22	02/09/29	AEGEA SA	1.697.698,56	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	27/09/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	50.214,65	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/09/22	28/09/22	28/09/27	B.BRASIL	4.635.673,46	-	AAA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	06/10/22	06/10/22	13/09/32	NTRASSUD	1.719.084,84	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/10/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	35.033,47	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	03/11/22	06/04/21	15/03/29	ANET	2.083.962,06	brA	-	-



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/05/2023

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	03/11/22	15/12/21	15/11/36	ITAPOA T	4.681.762,96	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	08/11/22	08/11/22	27/10/27	CM HOSPI	970.726,34	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/11/22	08/11/22	15/06/42	BRK AMBI	4.914.054,80	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/11/22	02/05/22	15/04/38	RDVE	1.596.192,84	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/11/22	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	1.502.429,92	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	11/11/22	11/11/22	15/10/40	RAHOLD	2.871.533,59	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	11/11/22	11/11/22	15/10/40	RAHOLD	10.648.743,67	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	3.823.058,47	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	1.720.953,81	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	1.409.103,12	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.321.858,31	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.609.084,53	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.317.740,37	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	01/12/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	1.664.334,31	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	2.097.400,32	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	2.225.011,26	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	1.622.949,39	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	16/11/20	15/10/36	PAMPASUL	2.332.024,26	brAAA	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/12/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	3.187.606,87	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/12/22	20/12/22	16/12/29	CSMG	2.020.360,30	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	15/12/21	15/11/36	ITAPOA T	3.182.311,73	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	02/05/22	15/04/38	RDVE	1.847.193,90	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	3.127.394,81	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/01/23	26/01/23	20/01/26	CELG	3.175.799,84	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/03/23	26/01/23	20/01/26	HAPVIDA	459.230,78	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	26/01/23	20/01/26	AESTUCAN	1.073.528,14	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	26/01/23	20/01/26	ITAPOA T	3.331.398,80	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	26/01/23	20/01/26	BRV_VDR	8.298.767,26	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/03/23	26/01/23	20/01/26	PARANAGU	1.023.973,43	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	14/04/23	26/01/23	20/01/26	PARANAGU	725.430,77	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	17/04/23	26/01/23	20/01/26	VERO	2.800.914,50	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/04/23	26/01/23	20/01/26	BRKA	1.105.086,02	-	A+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/04/23	26/01/23	20/01/26	BRKA	30.505,49	-	A+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/04/23	26/01/23	20/01/26	HOLDARAG	2.079.808,56	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	26/01/23	20/01/26	PAMPASUL	1.774.603,01	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	26/01/23	20/01/26	LOCAMERI	2.182.756,37	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	26/01/23	20/01/26	MG050	3.317.170,79	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	26/01/23	20/01/26	BRK AMBI	1.222.438,49	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	26/01/23	20/01/26	VAMOS	1.722.447,50	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	26/01/23	20/01/26	HOLDARAG	722.111,24	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	26/01/23	20/01/26	CART	1.453.821,75	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	26/01/23	20/01/26	HOLDARAG	2.220.812,54	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	26/01/23	20/01/26	BRKA	273.842,92	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	26/01/23	20/01/26	BRKA	2.613.861,57	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	26/01/23	20/01/26	CORSAN	1.529.105,37	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	26/01/23	20/01/26	CART	627.786,66	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	26/01/23	20/01/26	METRORIO	5.036.148,27	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	26/01/23	20/01/26	HIDRO BR	2.548.378,11	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/05/23	26/01/23	20/01/26	HOLDARAG	205.096,68	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/05/23	26/01/23	20/01/26	BRK AMBI	2.138.474,93	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/05/23	26/01/23	20/01/26	CART	2.070.594,61	brAA+	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	26/01/23	20/01/26	RT BANDE	1.195.341,18	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	16/05/23	26/01/23	20/01/26	SABESP	2.401.684,04	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	26/01/23	20/01/26	CPFL	2.404.295,99	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	16/05/23	26/01/23	20/01/26	CACHOEIR	1.986.031,25	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	26/01/23	20/01/26	COELBA	1.791.246,24	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	26/01/23	20/01/26	LOCAMERI	2.798.729,02	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	26/01/23	20/01/26	SMARTIFI	3.218.127,16	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	18/05/23	26/01/23	20/01/26	UNIGEL P	157.809,40	-	-	BB+
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/05/23	26/01/23	20/01/26	UTE GNA	56.537,43	brA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	-	FIDC VERDECARD SN3	1.764.242,27	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	-	FIDC CREDZ SN4	5.801,77	-	-	AAAsf(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	-	FIDC CREDZ SN6	2.519.623,88	brAA (sf)	-	A+sf(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	FIDC VERDECARD SN5	350.406,58	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	FIDC VERDECARD SN6	1.401.680,80	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	FIDC VERDECARD SN8	1.501.736,64	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	RB CAP CREDIT AL SN3	757.774,24	brAA-(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	BR ELETRO FIDC S1	2.989.809,86	-	-	Aasf(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	INSS CONS PDL I FIDC	1.741.989,11	-	-	AAAsf(bra)



Observação: Em maio de 2023, quatro 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 Fitch de C- para Fitch D e o rating de UGEL11 (Unigel) foi revisado pela Fitch de AA- para Fitch BB+, 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** **4.403.881.569,03**

Tópico do Enquadramento	Limite	Aplicação Atual	Valor Limite	% Aplicado	Status
% do Segmento RF/PL PLANO	100,00%	3.796.080.547,88	4.403.881.569,03	86,20%	Enquadrado
% do PL em Títulos de Emissão do Tesouro Nacional e/ou do BACEN	100,00%	3.092.972.184,78	4.403.881.569,03	70,23%	Enquadrado
% do PL em Títulos RF1, exceto títulos do Tesouro Nacional	80,00%	703.108.363,10	3.523.105.307,72	15,97%	Enquadrado
% do PL em FIDC	20,00%	Verificar Rel. de Diversificação de FIDC's	880.776.326,93	0,00%	Enquadrado
% do PL em uma mesma pessoa jurídica não-financeira	10,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Não Financ.	440.388.163,47	0,00%	Enquadrado
% do PL em Instituições Financeiras	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Financ.	1.100.970.392,26	0,00%	Enquadrado
% de uma mesma Série de Debêntures	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Debêntures	1.100.970.392,26	0,00%	Enquadrado
% do PL em RV	70,00%	508.083.596,60	3.082.717.045,82	11,54%	Enquadrado
% do capital votante de uma empresa	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação RV	1.100.970.392,26	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Imobiliários	20,00%	70.740.017,31	880.776.326,93	1,61%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Empréstimos	15,00%	24.826.062,38	660.582.261,60	0,56%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Estruturados	20,00%	0,00	880.776.326,93	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos no Exterior	10,00%	0,00	440.388.163,47	0,00%	Enquadrado

(\*) O Relatório Completo de Enquadramentos Legais está disponível no portal da EMBRAER PREV ([www.embraerprev.com.br](http://www.embraerprev.com.br))



## 6.2. Relatório de Túnel de Preços

### RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV  
Período: 02 DE MAIO DE 2023 À 31 DE MAIO DE 2023



FIM EMB I A												
DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	FONTE ANBIMA				FORA DO TÚNEL
								TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	
04/05/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/03/2026	Compra	0,1191%	0,1202%	0,0596%	0,1417%	-0,0011%	NÃO
04/05/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/03/2026	Compra	0,1206%	0,1202%	0,0596%	0,1417%	0,0004%	NÃO
04/05/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/03/2026	Compra	0,1196%	0,1202%	0,0596%	0,1417%	-0,0006%	NÃO
04/05/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/03/2026	Compra	0,1191%	0,1202%	0,0596%	0,1417%	-0,0011%	NÃO
04/05/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/03/2026	Compra	0,1206%	0,1202%	0,0596%	0,1417%	0,0004%	NÃO
05/05/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,9569%	5,9294%	5,7669%	6,0970%	0,0275%	NÃO
05/05/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,9569%	5,9294%	5,7669%	6,0970%	0,0275%	NÃO
05/05/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,9569%	5,9294%	5,7669%	6,0970%	0,0275%	NÃO
12/05/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/03/2029	Compra	0,1826%	0,1744%	0,1588%	0,2058%	0,0082%	NÃO
12/05/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/03/2029	Compra	0,1826%	0,1744%	0,1588%	0,2058%	0,0082%	NÃO
12/05/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/03/2029	Compra	0,1826%	0,1744%	0,1588%	0,2058%	0,0082%	NÃO
12/05/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/03/2029	Compra	0,1826%	0,1744%	0,1588%	0,2058%	0,0082%	NÃO
12/05/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/03/2029	Compra	0,1826%	0,1744%	0,1588%	0,2058%	0,0082%	NÃO
12/05/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/03/2029	Compra	0,1816%	0,1744%	0,1588%	0,2058%	0,0072%	NÃO
12/05/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/03/2029	Compra	0,1826%	0,1744%	0,1588%	0,2058%	0,0082%	NÃO
12/05/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	5,9031%	5,8400%	5,7434%	6,0475%	0,0631%	NÃO
12/05/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	5,9031%	5,8400%	5,7434%	6,0475%	0,0631%	NÃO
12/05/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	5,9031%	5,8400%	5,7434%	6,0475%	0,0631%	NÃO
16/05/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,7995%	5,8326%	5,6362%	5,9402%	-0,0331%	NÃO
17/05/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/03/2029	Venda	0,1780%	0,1787%	0,1555%	0,1974%	-0,0007%	NÃO
17/05/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/03/2029	Venda	0,1783%	0,1787%	0,1555%	0,1974%	-0,0004%	NÃO
17/05/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/03/2029	Venda	0,1780%	0,1787%	0,1555%	0,1974%	-0,0007%	NÃO
17/05/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/03/2029	Venda	0,1783%	0,1787%	0,1555%	0,1974%	-0,0004%	NÃO
17/05/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/03/2029	Venda	0,1780%	0,1787%	0,1555%	0,1974%	-0,0007%	NÃO
17/05/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/03/2029	Venda	0,1783%	0,1787%	0,1555%	0,1974%	-0,0004%	NÃO
17/05/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/03/2029	Venda	0,1780%	0,1787%	0,1555%	0,1974%	-0,0007%	NÃO
17/05/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/03/2029	Venda	0,1783%	0,1787%	0,1555%	0,1974%	-0,0004%	NÃO
17/05/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/03/2029	Venda	0,1780%	0,1787%	0,1555%	0,1974%	-0,0007%	NÃO
17/05/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/03/2029	Venda	0,1783%	0,1787%	0,1555%	0,1974%	-0,0004%	NÃO
17/05/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/03/2029	Venda	0,1780%	0,1787%	0,1555%	0,1974%	-0,0007%	NÃO
25/05/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	5,8205%	5,7617%	5,6404%	5,9452%	0,0588%	NÃO
25/05/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	5,8205%	5,7617%	5,6404%	5,9452%	0,0588%	NÃO
25/05/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	5,8105%	5,7617%	5,6404%	5,9452%	0,0488%	NÃO
25/05/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	5,8105%	5,7617%	5,6404%	5,9452%	0,0488%	NÃO
26/05/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,7695%	5,7300%	5,5976%	5,9023%	0,0395%	NÃO

### RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV  
Período: 02 DE MAIO DE 2023 À 31 DE MAIO DE 2023



FIM EMB II A												
DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	FONTE ANBIMA				FORA DO TÚNEL
								TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	
03/05/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2024	Venda	6,6965%	6,7700%	6,3971%	7,1371%	-0,0735%	NÃO
12/05/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	LTN	01/07/2023	Compra	13,6985%	13,7014%	13,6049%	13,8586%	-0,0029%	NÃO
12/05/2023	FIM EMB II A	BNP	LIQUIDEZ	NTN-B	15/05/2025	Compra	5,8490%	5,9071%	5,5918%	6,1273%	-0,0581%	NÃO
12/05/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2026	Compra	5,4390%	5,4500%	5,1707%	5,6757%	-0,0110%	NÃO
12/05/2023	FIM EMB II A	BNP	PACTUAL	NTN-B	15/08/2028	Compra	5,4990%	5,4656%	5,2457%	5,7097%	0,0334%	NÃO
15/05/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2024	Compra	7,0066%	7,0451%	6,7145%	7,3897%	-0,0385%	NÃO
15/05/2023	FIM EMB II A	BNP	LIQUIDEZ	NTN-B	15/05/2027	Compra	5,3790%	5,3282%	5,1102%	5,5915%	0,0508%	NÃO
16/05/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2024	Compra	7,0446%	7,1233%	6,7536%	7,4311%	-0,0787%	NÃO
16/05/2023	FIM EMB II A	BNP	LIQUIDEZ	NTN-B	15/05/2025	Compra	5,9024%	5,9635%	5,6465%	6,1822%	-0,0611%	NÃO
16/05/2023	FIM EMB II A	BNP	LIQUIDEZ	NTN-B	15/08/2026	Compra	5,4487%	5,5000%	5,1551%	5,6604%	-0,0513%	NÃO
16/05/2023	FIM EMB II A	BNP	LIQUIDEZ	NTN-B	15/08/2028	Compra	5,4090%	5,4792%	5,1422%	5,6065%	-0,0702%	NÃO
25/05/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2024	Compra	7,4535%	7,5314%	7,1651%	7,8589%	-0,0779%	NÃO
25/05/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2025	Compra	6,2505%	6,2843%	5,9907%	6,5266%	-0,0338%	NÃO
25/05/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2026	Compra	5,6425%	5,5961%	5,3638%	5,8701%	0,0464%	NÃO
25/05/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2026	Compra	5,6425%	5,5961%	5,3638%	5,8701%	0,0464%	NÃO
25/05/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2028	Venda	5,5505%	5,4972%	5,2852%	5,7501%	0,0533%	NÃO
26/05/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2024	Venda	7,5316%	7,6459%	7,2436%	7,9397%	-0,1143%	NÃO
26/05/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2027	Compra	5,4495%	5,4527%	5,1736%	5,6563%	-0,0032%	NÃO
29/05/2023	FIM EMB II A	BNP	TERRA	LFT	01/03/2026	Compra	0,0802%	0,0836%	0,0560%	0,1020%	-0,0034%	NÃO



RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV  
Período: 02 DE MAIO DE 2023 À 31 DE MAIO DE 2023



FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI

FUNTE ANBIMA												
DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
02/05/2023	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	BNP	RENASCEN	LFT	01/09/2023	Compra	0,0125%	0,0130%	-0,0385%	0,0415%	-0,0005%	NÃO

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV  
Período: 02 DE MAIO DE 2023 À 31 DE MAIO DE 2023



FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO

FUNTE ANBIMA												
DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
24/05/2023	FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	ICATU VA	MERRIL	NTN-B	15/05/2025	Compra	6,3400%	6,2508%	6,0297%	6,5655%	0,0892%	NÃO
25/05/2023	FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	ICATU VA	TULL PRE	NTN-B	15/05/2025	Venda	6,2610%	6,2843%	5,9907%	6,5266%	-0,0233%	NÃO
25/05/2023	FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	ICATU VA	TULL PRE	NTN-B	15/05/2025	Venda	6,2610%	6,2843%	5,9907%	6,5266%	-0,0233%	NÃO
25/05/2023	FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	ICATU VA	MERRIL	NTN-B	15/08/2028	Compra	5,5400%	5,4972%	5,2852%	5,7501%	0,0428%	NÃO
25/05/2023	FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	ICATU VA	ATIVA	NTN-B	15/08/2028	Compra	5,5490%	5,4972%	5,2852%	5,7501%	0,0518%	NÃO

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 02 DE MAIO DE 2023 À 31 DE MAIO DE 2023



							DADOS BM&FBOVESPA			
DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
02-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	CIEL3	5,45	33.900,00	184.617,93	5,38	5,49	5,66	56.614,00
02-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	42,18	4.300,00	181.366,65	41,32	41,94	42,30	10.538,00
02-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	HAPV3	2,80	102.300,00	286.848,67	2,67	2,76	2,83	38.638,00
02-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	JBSS3	17,33	45.100,00	781.377,69	17,16	17,40	18,00	22.423,00
02-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	NTCO3	10,82	52.300,00	565.741,69	10,56	10,77	11,02	20.561,00
02-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	PETRA	22,92	57.800,00	1.324.958,85	22,64	22,93	23,74	128.187,00
02-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	40,50	9.200,00	372.599,27	40,10	40,66	41,50	43.887,00
02-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	VALE3	69,65	36.300,00	2.528.128,28	69,32	69,83	71,60	74.839,00
02-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	18,11	2.500,00	45.286,44	17,84	18,11	18,30	20.308,00
02-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,77	1.600,00	25.225,00	15,64	15,82	16,15	14.643,00
02-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,76	5.800,00	91.435,37	15,64	15,82	16,15	14.643,00
02-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	26,60	1.800,00	47.871,91	26,37	26,68	26,99	18.619,00
02-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	20,20	1.800,00	36.364,33	19,87	20,18	20,37	15.255,00
02-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	20,32	500,00	10.160,40	19,87	20,18	20,37	15.255,00
02-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	PETZ3	5,77	1.000,00	5.770,00	5,76	5,83	6,13	13.249,00
02-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	PETZ3	5,79	15.400,00	89.216,64	5,76	5,83	6,13	13.249,00
02-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	PETZ3	5,80	10.000,00	58.000,00	5,76	5,83	6,13	13.249,00
02-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	33,32	5.000,00	166.575,40	32,86	33,49	34,61	28.292,00
02-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	18,53	7.700,00	142.688,40	18,42	18,67	19,73	13.276,00
02-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	18,44	1.000,00	18.440,79	18,42	18,67	19,73	13.276,00
02-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	7,97	1.600,00	12.748,38	7,89	8,07	8,32	14.223,00
02-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	8,00	2.600,00	20.795,75	7,89	8,07	8,32	14.223,00
02-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	40,68	800,00	32.544,00	40,10	40,66	41,50	43.887,00
02-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	2,80	55.845,00	156.143,06	2,67	2,76	2,83	38.638,00
02-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	2,79	43.404,00	121.098,99	2,67	2,76	2,83	38.638,00
02-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	2,77	25.532,00	70.688,55	2,67	2,76	2,83	38.638,00
02-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	SUZB3	40,75	1.016,00	41.397,07	40,10	40,66	41,50	43.887,00
02-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	SUZB3	40,83	630,00	25.722,66	40,10	40,66	41,50	43.887,00
02-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	SUZB3	40,61	17,00	690,43	40,10	40,66	41,50	43.887,00
02-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	SUZB3	40,57	1.051,00	42.636,98	40,10	40,66	41,50	43.887,00
02-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	SUZB3	40,57	840,00	34.082,92	40,10	40,66	41,50	43.887,00
02-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	SUZB3	40,35	420,00	16.947,24	40,10	40,66	41,50	43.887,00
02-05-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CASH1	0,00	1,00	0,00	0,50	0,56	0,61	561,00
03-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	EQTL1	1,69	2.444,00	4.140,51	1,52	2,02	2,20	163,00
03-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	18,38	500,00	9.189,97	18,00	18,44	18,63	15.326,00
03-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	18,44	700,00	12.905,07	18,00	18,44	18,63	15.326,00
03-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,78	1.900,00	29.988,68	15,68	15,77	15,94	13.894,00
03-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,80	2.200,00	34.760,00	15,68	15,77	15,94	13.894,00
03-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	26,41	6.800,00	179.599,70	25,88	26,32	26,75	20.808,00
03-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	20,59	4.900,00	100.878,85	19,88	20,50	20,85	24.749,00
03-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	20,59	1.500,00	30.892,41	19,88	20,50	20,85	24.749,00
03-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	20,80	900,00	18.720,00	19,88	20,50	20,85	24.749,00
03-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	33,89	1.000,00	33.893,66	33,01	33,88	34,38	30.334,00
03-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	18,39	3.600,00	66.189,73	18,11	18,44	18,66	12.045,00
03-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	40,72	2.800,00	114.004,74	40,05	40,68	41,63	39.412,00
04-05-23	FIA EMB VIII ETF	Venda	BOVA11	98,90	100,00	9.890,00	97,76	98,93	100,15	83.204,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	BBSE3	32,79	2.433,00	79.778,07	32,35	32,90	33,66	33.388,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	BBSE3	32,72	99,00	3.239,28	32,35	32,90	33,66	33.388,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	BBSE3	32,69	50,00	1.634,50	32,35	32,90	33,66	33.388,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	BBSE3	32,89	40,00	1.315,60	32,35	32,90	33,66	33.388,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	BBSE3	32,84	1.050,00	34.482,00	32,35	32,90	33,66	33.388,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	BBSE3	32,81	1.934,00	63.454,54	32,35	32,90	33,66	33.388,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	BBSE3	32,87	569,00	18.703,03	32,35	32,90	33,66	33.388,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	BBSE3	32,75	349,00	11.429,75	32,35	32,90	33,66	33.388,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	BBSE3	32,70	150,00	4.905,00	32,35	32,90	33,66	33.388,00



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO  
E CONTROLE DE RISCO - MAIO DE 2023



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 02 DE MAIO DE 2023 À 31 DE MAIO DE 2023

DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FROVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
04-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	BBSE3	32,88	48,00	1.578,24	32,35	32,90	33,66	33.388,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	BBSE3	32,85	1.200,00	39.420,00	32,35	32,90	33,66	33.388,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	BBSE3	32,86	1.400,00	46.004,00	32,35	32,90	33,66	33.388,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	BBSE3	32,78	450,00	14.751,00	32,35	32,90	33,66	33.388,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	BBSE3	32,82	1.050,00	34.461,00	32,35	32,90	33,66	33.388,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	BBSE3	32,83	400,00	13.132,00	32,35	32,90	33,66	33.388,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	BBSE3	32,67	143,00	4.671,81	32,35	32,90	33,66	33.388,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	BBSE3	32,68	50,00	1.634,00	32,35	32,90	33,66	33.388,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	BBSE3	32,76	3.851,00	126.158,76	32,35	32,90	33,66	33.388,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	BBSE3	32,66	1,00	32,66	32,35	32,90	33,66	33.388,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	BBSE3	32,71	450,00	14.719,50	32,35	32,90	33,66	33.388,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	BBSE3	32,77	750,00	24.577,50	32,35	32,90	33,66	33.388,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	BBSE3	32,80	633,00	20.762,40	32,35	32,90	33,66	33.388,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	CSMG3	17,63	373,00	6.575,99	17,05	17,77	18,07	9.773,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	CSMG3	17,72	2.500,00	44.300,00	17,05	17,77	18,07	9.773,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	CSMG3	17,68	4.500,00	79.560,00	17,05	17,77	18,07	9.773,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	CSMG3	17,65	1.451,00	25.610,15	17,05	17,77	18,07	9.773,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	CSMG3	17,78	1.850,00	32.893,00	17,05	17,77	18,07	9.773,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	CSMG3	17,69	1.800,00	31.842,00	17,05	17,77	18,07	9.773,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	CSMG3	17,73	1.300,00	23.049,00	17,05	17,77	18,07	9.773,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	CSMG3	17,66	5.944,00	104.971,04	17,05	17,77	18,07	9.773,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	CSMG3	17,67	5.004,00	88.420,68	17,05	17,77	18,07	9.773,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	CSMG3	17,61	1,00	17,61	17,05	17,77	18,07	9.773,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	CSMG3	17,79	292,00	5.194,68	17,05	17,77	18,07	9.773,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	CSMG3	17,64	685,00	12.083,40	17,05	17,77	18,07	9.773,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	CSMG3	17,70	3.300,00	58.410,00	17,05	17,77	18,07	9.773,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	LREN3	15,07	18,00	271,26	14,97	15,33	15,76	54.259,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	LREN3	15,10	1.667,00	25.171,70	14,97	15,33	15,76	54.259,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	LREN3	15,12	1.433,00	21.666,96	14,97	15,33	15,76	54.259,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	LREN3	15,11	1.833,00	27.696,63	14,97	15,33	15,76	54.259,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	LREN3	15,13	4.430,00	67.025,90	14,97	15,33	15,76	54.259,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	LREN3	15,09	633,00	9.551,97	14,97	15,33	15,76	54.259,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	LREN3	15,08	3.585,00	54.061,80	14,97	15,33	15,76	54.259,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	LREN3	15,14	1,00	15,14	14,97	15,33	15,76	54.259,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	MGLU3	3,58	19.400,00	69.452,00	3,36	3,51	3,64	38.373,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	MGLU3	3,62	474,00	1.715,88	3,36	3,51	3,64	38.373,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	MGLU3	3,61	23.118,00	83.455,98	3,36	3,51	3,64	38.373,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	MGLU3	3,59	14.288,00	51.293,92	3,36	3,51	3,64	38.373,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	MGLU3	3,55	1,00	3,55	3,36	3,51	3,64	38.373,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	MGLU3	3,57	1.150,00	4.105,50	3,36	3,51	3,64	38.373,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	MGLU3	3,60	29.313,00	105.526,80	3,36	3,51	3,64	38.373,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	MGLU3	3,56	656,00	2.335,36	3,36	3,51	3,64	38.373,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	SBSP3	46,35	1,00	46,35	44,54	45,73	46,42	18.937,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	SBSP3	46,10	401,00	18.486,10	44,54	45,73	46,42	18.937,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	SBSP3	46,25	400,00	18.500,00	44,54	45,73	46,42	18.937,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	SBSP3	46,26	100,00	4.626,00	44,54	45,73	46,42	18.937,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	SBSP3	46,16	50,00	2.308,00	44,54	45,73	46,42	18.937,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	SBSP3	46,32	338,00	15.656,16	44,54	45,73	46,42	18.937,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	SBSP3	46,12	549,00	25.319,88	44,54	45,73	46,42	18.937,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	SBSP3	46,18	250,00	11.545,00	44,54	45,73	46,42	18.937,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	SBSP3	46,33	84,00	3.891,72	44,54	45,73	46,42	18.937,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	SBSP3	46,21	200,00	9.242,00	44,54	45,73	46,42	18.937,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	SBSP3	46,36	12,00	556,32	44,54	45,73	46,42	18.937,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	SBSP3	46,03	50,00	2.301,50	44,54	45,73	46,42	18.937,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	SBSP3	46,27	300,00	13.881,00	44,54	45,73	46,42	18.937,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	SBSP3	46,22	167,00	7.718,74	44,54	45,73	46,42	18.937,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	SBSP3	46,09	150,00	6.913,50	44,54	45,73	46,42	18.937,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	SBSP3	46,37	6,00	278,22	44,54	45,73	46,42	18.937,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	SBSP3	46,11	550,00	25.360,50	44,54	45,73	46,42	18.937,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	SBSP3	46,15	150,00	6.922,50	44,54	45,73	46,42	18.937,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	SBSP3	46,07	250,00	11.517,50	44,54	45,73	46,42	18.937,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	SBSP3	46,30	1.096,00	50.744,80	44,54	45,73	46,42	18.937,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	SBSP3	46,19	484,00	22.355,96	44,54	45,73	46,42	18.937,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	SBSP3	45,92	1,00	45,92	44,54	45,73	46,42	18.937,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	SBSP3	46,29	952,00	44.068,08	44,54	45,73	46,42	18.937,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	SBSP3	46,06	300,00	13.818,00	44,54	45,73	46,42	18.937,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	SBSP3	46,01	92,00	4.232,92	44,54	45,73	46,42	18.937,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	SBSP3	46,28	300,00	13.884,00	44,54	45,73	46,42	18.937,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	SBSP3	46,20	565,00	26.103,00	44,54	45,73	46,42	18.937,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	SBSP3	46,17	250,00	11.542,50	44,54	45,73	46,42	18.937,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	SBSP3	46,23	200,00	9.246,00	44,54	45,73	46,42	18.937,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	SBSP3	46,13	300,00	13.839,00	44,54	45,73	46,42	18.937,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	SBSP3	46,24	235,00	10.866,40	44,54	45,73	46,42	18.937,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	SBSP3	46,04	50,00	2.302,00	44,54	45,73	46,42	18.937,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	SBSP3	46,34	16,00	741,44	44,54	45,73	46,42	18.937,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	SBSP3	46,31	751,00	34.778,81	44,54	45,73	46,42	18.937,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	STBP3	8,60	2.100,00	18.060,00	8,39	8,57	8,67	10.242,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	STBP3	8,55	12.960,00	110.808,00	8,39	8,57	8,67	10.242,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	STBP3	8,57	21.614,00	185.231,98	8,39	8,57	8,67	10.242,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	STBP3	8,56	16.550,00	141.668,00	8,39	8,57	8,67	10.242,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	STBP3	8,61	2.432,00	20.939,52	8,39	8,57	8,67	10.242,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	STBP3	8,54	359,00	3.065,86	8,39	8,57	8,67	10.242,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	STBP3	8,58	12.535,00	107.550,30	8,39	8,57	8,67	10.242,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	STBP3	8,59	17.850,00	153.331,50	8,39	8,57	8,67	10.242,00



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO  
E CONTROLE DE RISCO - MAIO DE 2023



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 02 DE MAIO DE 2023 À 31 DE MAIO DE 2023

DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FROVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
04-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	STBP3	8,62	500,00	4.310,00	8,39	8,57	8,67	10.242,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	UGPA3	15,50	11.138,00	172.639,00	15,31	15,88	16,35	55.058,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	UGPA3	15,53	167,00	2.593,51	15,31	15,88	16,35	55.058,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	UGPA3	15,56	300,00	4.668,00	15,31	15,88	16,35	55.058,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	UGPA3	15,58	600,00	9.348,00	15,31	15,88	16,35	55.058,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	UGPA3	15,59	1.200,00	18.708,00	15,31	15,88	16,35	55.058,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	UGPA3	15,43	3.541,00	54.637,63	15,31	15,88	16,35	55.058,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	UGPA3	15,54	300,00	4.662,00	15,31	15,88	16,35	55.058,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	UGPA3	15,48	5.365,00	83.050,20	15,31	15,88	16,35	55.058,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	UGPA3	15,61	650,00	10.146,50	15,31	15,88	16,35	55.058,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	UGPA3	15,41	107,00	1.648,87	15,31	15,88	16,35	55.058,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	UGPA3	15,55	100,00	1.555,00	15,31	15,88	16,35	55.058,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	UGPA3	15,45	3.798,00	58.679,10	15,31	15,88	16,35	55.058,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	UGPA3	15,60	4.491,00	70.059,60	15,31	15,88	16,35	55.058,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	UGPA3	15,62	10.000,00	156.200,00	15,31	15,88	16,35	55.058,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	UGPA3	15,40	67,00	1.031,80	15,31	15,88	16,35	55.058,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	UGPA3	15,42	774,00	11.935,08	15,31	15,88	16,35	55.058,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	UGPA3	15,44	6.895,00	106.458,80	15,31	15,88	16,35	55.058,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	UGPA3	15,47	5.604,00	86.693,88	15,31	15,88	16,35	55.058,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	UGPA3	15,46	3.646,00	56.367,16	15,31	15,88	16,35	55.058,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	UGPA3	15,49	6.174,00	95.635,26	15,31	15,88	16,35	55.058,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	UGPA3	15,63	1.800,00	28.134,00	15,31	15,88	16,35	55.058,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	UGPA3	15,66	400,00	6.264,00	15,31	15,88	16,35	55.058,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	UGPA3	15,67	2.418,00	37.890,06	15,31	15,88	16,35	55.058,00
04-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	UGPA3	15,57	1.865,00	29.038,05	15,31	15,88	16,35	55.058,00
04-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	18,92	2.600,00	49.179,99	18,45	18,87	19,15	24.003,00
04-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ARZZ3	59,38	1.100,00	65.316,33	58,10	59,27	61,84	14.781,00
04-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ARZZ3	59,29	300,00	17.787,73	58,10	59,27	61,84	14.781,00
04-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ARZZ3	59,21	800,00	47.367,10	58,10	59,27	61,84	14.781,00
04-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	23,18	7.000,00	162.268,07	22,62	23,11	23,53	28.874,00
04-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	20,57	3.900,00	80.236,02	20,24	20,61	20,95	24.378,00
04-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	20,59	3.300,00	67.945,23	20,24	20,61	20,95	24.378,00
04-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	24,95	10.200,00	254.448,36	24,52	24,93	25,28	58.362,00
04-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	LREN3	15,28	7.400,00	113.086,60	14,97	15,33	15,76	54.259,00
04-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	32,82	5.100,00	167.377,35	32,35	32,98	34,63	59.213,00
04-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	8,26	2.300,00	19.002,41	8,09	8,31	8,50	41.770,00
04-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	TEND3	6,58	7.400,00	48.655,43	6,07	6,54	6,79	21.069,00
05-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	BPAC11	23,91	12.200,00	291.725,37	23,19	23,79	24,10	24.798,00
05-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	FLET3	33,98	31.800,00	1.080.646,37	33,61	33,93	34,43	44.578,00
05-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	GGBR4	24,76	11.100,00	274.844,20	23,70	24,36	24,85	26.215,00
05-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	LREN3	16,26	33.700,00	547.822,80	15,41	16,56	17,07	43.930,00
05-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	MGLU3	3,80	87.200,00	331.467,39	3,53	3,71	3,84	39.035,00
05-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	PETR3	26,71	12.900,00	344.555,07	25,89	26,37	26,85	15.645,00
05-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	STBP3	8,63	61.400,00	529.987,48	8,40	8,75	8,94	11.972,00
05-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	14,42	700,00	10.091,24	14,04	14,38	14,55	15.468,00
05-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	42,82	300,00	12.845,00	42,19	42,93	43,31	23.827,00
05-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	23,68	700,00	16.572,91	23,19	23,79	24,10	24.798,00
05-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	33,88	1.900,00	64.364,78	33,61	33,93	34,43	44.578,00
05-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	11,44	1.600,00	18.309,71	11,30	11,58	11,84	17.846,00
05-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	27,34	5.600,00	153.114,05	27,00	27,36	27,57	19.124,00
05-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	2,88	4.500,00	12.949,32	2,73	2,86	2,99	33.912,00
05-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	21,05	1.000,00	21.053,33	20,57	21,08	21,44	19.450,00
05-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	21,09	4.800,00	101.219,36	20,57	21,08	21,44	19.450,00
05-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	21,01	800,00	16.807,24	20,57	21,08	21,44	19.450,00
05-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	25,78	2.500,00	64.449,91	25,02	25,63	25,99	56.467,00
05-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	16,65	1.600,00	26.640,00	15,41	16,56	17,07	43.930,00
05-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	16,81	5.400,00	90.787,26	15,41	16,56	17,07	43.930,00
05-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	6,76	39.500,00	267.147,89	6,10	6,55	7,00	28.303,00
05-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	6,58	5.100,00	33.575,25	6,10	6,55	7,00	28.303,00
05-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	33,98	400,00	13.592,81	33,42	33,99	34,36	34.151,00
05-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	23,91	700,00	16.735,62	22,50	23,34	24,26	19.240,00
05-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	23,58	4.300,00	101.409,59	22,50	23,34	24,26	19.240,00
05-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	19,31	2.000,00	38.612,44	18,71	19,30	19,66	13.498,00
05-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	58,26	400,00	23.305,62	57,44	58,29	59,25	24.173,00
05-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	9,15	8.400,00	76.860,00	8,53	9,04	9,38	26.496,00
05-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	9,21	9.700,00	89.317,69	8,53	9,04	9,38	26.496,00
05-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	9,00	2.100,00	18.904,01	8,53	9,04	9,38	26.496,00
05-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	41,64	2.100,00	87.433,86	39,76	41,15	41,98	31.446,00
05-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	41,13	2.900,00	119.268,21	39,76	41,15	41,98	31.446,00
05-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	TEND3	6,74	1.700,00	11.463,51	6,46	6,70	6,90	11.568,00
05-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	13,58	900,00	12.224,79	13,24	13,63	13,86	17.912,00
05-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	9,26	4.800,00	44.443,39	8,58	9,11	9,37	13.797,00
05-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	SUZB3	41,37	1.905,00	78.802,56	39,76	41,15	41,98	31.446,00
05-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	SUZB3	41,20	1.705,00	70.246,00	39,76	41,15	41,98	31.446,00
05-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	SUZB3	41,14	25,00	1.028,44	39,76	41,15	41,98	31.446,00
05-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	SUZB3	41,70	2.555,00	106.534,43	39,76	41,15	41,98	31.446,00
05-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	SUZB3	41,69	556,00	23.180,86	39,76	41,15	41,98	31.446,00
05-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	13,78	11.077,00	152.684,19	13,24	13,63	13,86	17.912,00
05-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	13,70	1.199,00	16.426,30	13,24	13,63	13,86	17.912,00
08-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	BBAS3	43,27	23.600,00	1.021.172,77	42,96	43,24	43,78	21.392,00
08-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	BBD4	15,27	70.000,00	1.068.996,96	14,82	15,23	15,42	135.345,00
08-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	BRKM5	25,20	18.100,00	456.090,09	24,26	25,78	29,15	80.554,00
08-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	LREN3	17,31	14.700,00	254.464,99	16,78	17,07	17,64	53.060,00
08-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	MDIA3	31,23	20.900,00	652.732,21	30,67	31,10	31,44	7.048,00





RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 02 DE MAIO DE 2023 À 31 DE MAIO DE 2023



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FROVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
08-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	RADL3	26,85	25.400,00	681.917,65	26,59	26,88	27,10	23.237,00
08-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	VALE3	70,80	12.300,00	870.847,87	69,85	70,45	71,16	60.629,00
08-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ALSO3	18,86	1.900,00	35.842,16	18,77	18,94	19,22	12.020,00
08-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	43,29	300,00	12.986,38	42,96	43,24	43,78	21.392,00
08-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	24,31	400,00	9.724,09	23,76	24,25	24,55	36.640,00
08-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	33,25	2.000,00	66.506,83	32,55	33,15	33,83	41.370,00
08-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	33,38	2.100,00	70.096,53	32,55	33,15	33,83	41.370,00
08-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	11,29	700,00	7.905,68	11,22	11,41	11,68	20.266,00
08-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	11,41	4.700,00	53.636,37	11,22	11,41	11,68	20.266,00
08-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	11,36	6.400,00	72.672,04	11,22	11,41	11,68	20.266,00
08-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	27,38	1.900,00	52.016,53	27,08	27,56	27,98	13.957,00
08-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	27,46	3.500,00	96.098,87	27,08	27,56	27,98	13.957,00
08-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	2,94	4.800,00	14.106,00	2,90	2,95	3,07	38.139,00
08-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGT11	20,86	3.600,00	75.109,48	20,54	20,82	21,35	18.756,00
08-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	26,27	2.600,00	68.312,84	25,81	26,24	26,57	62.264,00
08-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	26,30	4.700,00	123.616,67	25,81	26,24	26,57	62.264,00
08-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	17,10	2.200,00	37.629,72	16,78	17,07	17,64	53.060,00
08-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	NINJ3	2,82	3.300,00	9.301,00	2,75	2,82	2,93	432,00
08-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	7,05	1.900,00	13.400,70	6,86	7,09	7,26	20.458,00
08-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	7,11	14.500,00	103.113,78	6,86	7,09	7,26	20.458,00
08-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRIO3	34,70	3.400,00	117.963,47	34,42	34,72	35,17	28.177,00
08-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRIO3	34,67	500,00	17.334,35	34,42	34,72	35,17	28.177,00
08-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	24,47	5.700,00	139.505,73	23,57	24,25	25,07	19.883,00
08-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	24,68	2.700,00	66.634,21	23,57	24,25	25,07	19.883,00
08-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	19,85	1.800,00	35.722,95	19,52	19,81	20,06	12.827,00
08-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	58,15	1.000,00	58.149,81	57,96	58,37	59,39	21.160,00
08-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	15,65	4.300,00	67.295,00	15,57	15,83	16,63	5.860,00
08-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	9,19	2.700,00	24.822,84	9,05	9,20	9,45	13.526,00
08-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	42,14	1.400,00	58.999,21	41,65	41,99	42,45	21.924,00
08-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	14,11	2.200,00	31.043,71	13,93	14,15	14,39	17.262,00
09-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	CPFE3	31,25	9.000,00	281.278,77	30,85	31,34	31,77	6.266,00
09-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	CSMG3	17,76	23.100,00	410.239,83	17,58	17,76	17,89	7.961,00
09-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	ELET3	34,74	23.700,00	823.267,28	32,86	34,10	35,23	47.435,00
09-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	ELET6	36,40	5.500,00	200.220,90	36,15	37,43	38,53	17.685,00
09-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	JBSS3	17,76	35.300,00	626.972,36	17,55	17,76	17,94	16.257,00
09-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	MDIA3	31,05	17.600,00	546.418,06	30,25	31,05	31,34	4.213,00
09-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	MGLU3	4,11	85.400,00	351.236,68	3,82	4,13	4,27	40.609,00
09-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	NTCO3	12,50	17.200,00	214.983,36	12,00	12,68	13,19	81.741,00
09-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	PETRA	24,59	17.500,00	430.237,50	24,24	24,56	24,80	61.235,00
09-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	14,00	9.400,00	131.600,00	13,77	13,99	14,18	8.864,00
09-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	14,03	500,00	7.013,48	13,77	13,99	14,18	8.864,00
09-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	24,64	3.300,00	81.295,77	23,88	24,64	25,07	22.048,00
09-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	11,42	3.100,00	35.393,81	11,22	11,43	11,62	24.479,00
09-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	11,44	1.400,00	16.021,94	11,22	11,43	11,62	24.479,00
09-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	27,90	4.600,00	128.358,65	27,36	28,04	28,49	23.676,00
09-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGT11	20,97	4.800,00	100.650,25	20,35	20,90	21,15	22.875,00
09-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	26,55	1.500,00	39.829,29	26,23	26,56	26,79	67.167,00
09-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	26,56	1.200,00	31.875,25	26,23	26,56	26,79	67.167,00
09-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	17,45	7.900,00	137.860,06	16,86	17,43	17,79	40.391,00
09-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	12,75	48.900,00	623.643,19	12,00	12,68	13,19	81.741,00
09-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	7,24	11.400,00	82.581,54	6,85	7,16	7,35	19.089,00
09-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRIO3	34,66	2.500,00	86.642,71	33,73	34,51	34,95	25.113,00
09-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	24,54	700,00	17.177,40	23,40	24,40	24,83	14.033,00
09-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	24,67	1.400,00	34.538,00	23,40	24,40	24,83	14.033,00
09-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	19,68	3.000,00	59.033,99	19,42	19,68	20,03	8.734,00
09-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	15,42	2.900,00	44.717,29	15,28	15,64	16,01	8.794,00
09-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	15,71	2.200,00	34.569,64	15,28	15,64	16,01	8.794,00
09-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	15,65	5.900,00	92.344,79	15,28	15,64	16,01	8.794,00
09-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	TEND3	7,33	2.000,00	14.663,62	6,90	7,21	7,47	7.220,00
09-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	TEND3	7,28	6.600,00	48.056,80	6,90	7,21	7,47	7.220,00
09-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	VIVA3	21,50	1.000,00	21.503,06	21,12	21,57	21,89	7.246,00
09-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	VIVA3	21,64	4.200,00	90.871,01	21,12	21,57	21,89	7.246,00
09-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	VIVA3	21,35	2.600,00	55.510,00	21,12	21,57	21,89	7.246,00
10-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	ARRZ3	66,00	8.200,00	541.221,16	64,21	66,11	67,34	8.615,00
10-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	BPAC11	25,00	16.100,00	402.500,00	24,46	24,94	25,20	26.118,00
10-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	COGN3	2,30	151.800,00	349.620,91	2,16	2,26	2,32	24.491,00
10-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	EGIE3	42,61	16.000,00	681.814,69	42,19	42,59	42,86	8.520,00
10-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	ELET3	35,76	27.800,00	994.261,82	34,60	35,69	36,57	39.910,00
10-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	GMAT3	5,84	62.100,00	362.840,85	5,69	5,90	6,03	12.260,00
10-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	JBSS3	17,34	24.600,00	426.609,36	17,17	17,35	17,74	23.735,00
10-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	69,29	10.300,00	713.674,00	68,69	69,51	71,06	50.930,00
10-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ALSO3	19,30	800,00	15.441,21	18,89	19,26	19,45	11.129,00
10-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ARRZ3	65,61	100,00	6.561,00	64,21	66,11	67,34	8.615,00
10-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	13,72	1.900,00	26.069,41	13,51	13,66	13,92	14.543,00
10-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	13,67	900,00	12.303,97	13,51	13,66	13,92	14.543,00
10-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	13,68	4.600,00	62.907,41	13,51	13,66	13,92	14.543,00
10-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	13,63	1.800,00	24.530,33	13,51	13,66	13,92	14.543,00
10-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	25,01	1.900,00	47.512,53	24,46	24,94	25,20	26.118,00
10-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	35,87	700,00	25.111,98	34,60	35,69	36,57	39.910,00
10-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	11,56	1.700,00	19.646,02	11,25	11,52	11,65	11.065,00
10-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	27,95	1.700,00	47.509,12	27,43	27,81	28,15	17.274,00
10-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	26,88	700,00	18.818,80	26,29	26,74	27,04	50.621,00
10-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	LREN3	17,54	3.800,00	66.664,51	17,42	17,59	17,81	26.761,00
10-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	LWSA3	6,27	1.700,00	10.664,00	5,97	6,22	6,46	10.329,00



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 02 DE MAIO DE 2023 À 31 DE MAIO DE 2023

DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FROVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
10-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	13,15	21.200,00	278.719,28	12,71	13,06	13,60	50.807,00
10-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	7,47	31.900,00	238.134,92	7,15	7,37	7,65	19.981,00
10-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	RDOR3	24,53	800,00	19.622,25	24,24	24,56	24,86	9.260,00
10-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	19,48	1.700,00	33.122,99	19,15	19,44	19,65	6.389,00
10-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	19,53	700,00	13.671,49	19,15	19,44	19,65	6.389,00
10-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	60,07	400,00	24.027,41	58,94	59,88	60,36	24.219,00
10-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT9	41,15	489,00	20.122,35	58,94	59,88	60,36	24.219,00
10-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	41,82	2.900,00	121.280,79	41,21	41,73	41,97	18.733,00
10-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	14,46	1.000,00	14.460,07	14,30	14,44	14,55	9.744,00
10-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	RENT9	41,15	403,00	16.583,45	58,94	59,88	60,36	24.219,00
11-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	ABEV3	14,51	44.200,00	641.327,22	14,41	14,52	14,66	28.380,00
11-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	BEEF3	9,84	41.200,00	405.339,44	9,59	9,80	9,92	23.519,00
11-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	ITUB4	27,20	28.400,00	772.491,80	26,61	27,01	27,34	32.880,00
11-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	LEN3	17,25	11.500,00	198.351,86	16,80	16,99	17,36	28.682,00
11-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	67,99	4.500,00	305.934,46	67,36	67,84	68,29	57.129,00
11-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	13,90	6.400,00	88.957,00	13,56	13,85	13,99	9.146,00
11-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	25,50	10.200,00	260.104,03	24,79	25,47	25,74	24.667,00
11-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	36,10	2.700,00	97.460,66	35,23	35,89	36,68	36.505,00
11-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	21,09	2.700,00	56.933,36	20,85	21,15	21,48	14.776,00
11-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	27,08	9.600,00	259.996,96	26,61	27,01	27,34	32.880,00
11-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	7,45	9.200,00	68.537,42	7,04	7,33	7,50	10.853,00
11-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	34,58	1.000,00	34.575,03	33,94	34,47	35,06	24.462,00
11-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	19,36	1.800,00	34.851,24	19,01	19,38	19,91	13.912,00
11-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	61,57	2.800,00	172.404,97	59,70	61,63	62,38	40.435,00
11-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	16,55	2.600,00	43.024,02	15,64	16,31	16,71	17.439,00
11-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	16,50	900,00	14.845,50	15,64	16,31	16,71	17.439,00
11-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	9,87	12.300,00	121.374,74	9,51	9,84	10,03	14.733,00
11-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	TEND3	7,47	5.500,00	41.069,14	7,10	7,44	7,60	6.809,00
11-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	VIVA3	22,57	2.700,00	60.941,84	21,69	22,40	22,66	6.561,00
11-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	VIVA3	22,21	1.900,00	42.199,00	21,69	22,40	22,66	6.561,00
11-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	VIVA3	22,54	1.900,00	42.834,52	21,69	22,40	22,66	6.561,00
11-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	12,18	5.600,00	68.208,00	11,28	11,95	12,38	23.078,00
11-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	CXSE3	10,03	6.112,00	61.303,65	9,84	10,02	10,17	9.129,00
11-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	CXSE3	10,06	862,00	8.668,38	9,84	10,02	10,17	9.129,00
11-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	GMAT3	6,70	83.193,00	557.769,65	6,07	6,51	6,83	17.658,00
11-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	GMAT3	6,49	31.926,00	207.322,40	6,07	6,51	6,83	17.658,00
11-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	14,52	2.768,00	40.194,28	14,24	14,57	14,91	21.401,00
11-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	14,54	291,00	4.231,30	14,24	14,57	14,91	21.401,00
11-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	14,49	874,00	12.667,67	14,24	14,57	14,91	21.401,00
11-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	14,59	1.457,00	21.264,13	14,24	14,57	14,91	21.401,00
11-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	14,64	9.026,00	132.178,70	14,24	14,57	14,91	21.401,00
11-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	14,67	874,00	12.824,78	14,24	14,57	14,91	21.401,00
11-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	14,61	2.039,00	29.787,25	14,24	14,57	14,91	21.401,00
11-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	14,55	583,00	8.481,20	14,24	14,57	14,91	21.401,00
11-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	TRXF13	102,05	490,00	50.004,50	103,11	103,34	103,70	3.736,00
12-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	BEEF3	9,67	17.100,00	165.357,00	9,49	9,66	9,79	17.855,00
12-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	COGN3	2,44	151.800,00	369.785,07	2,41	2,50	2,66	30.275,00
12-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	ECOR3	6,41	42.700,00	273.707,00	6,31	6,41	6,67	12.107,00
12-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	JBSS3	16,14	61.100,00	986.154,00	15,12	15,76	16,42	62.045,00
12-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	MRVE3	8,87	27.800,00	246.586,00	8,83	8,97	9,30	25.395,00
12-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ALSO3	19,40	2.100,00	40.735,63	18,99	19,35	19,49	10.874,00
12-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	ARZZ3	68,07	2.100,00	142.948,52	66,80	68,18	69,17	11.436,00
12-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	ARZZ3	68,47	1.100,00	75.319,68	66,80	68,18	69,17	11.436,00
12-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	ARZZ3	68,56	500,00	34.279,70	66,80	68,18	69,17	11.436,00
12-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	14,04	1.300,00	18.255,55	13,86	14,02	14,15	8.474,00
12-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBA53	44,13	600,00	26.480,43	43,90	44,21	44,69	27.740,00
12-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	25,49	1.800,00	45.884,68	25,08	25,47	25,69	18.275,00
12-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	35,35	2.400,00	84.835,47	34,96	35,44	36,02	34.087,00
12-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	11,57	4.000,00	46.298,52	11,26	11,58	11,73	17.993,00
12-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQT13	28,81	3.900,00	112.352,73	27,87	28,71	29,04	24.174,00
12-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQT13	28,83	5.600,00	161.429,93	27,87	28,71	29,04	24.174,00
12-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,11	6.600,00	20.521,43	2,95	3,04	3,19	47.972,00
12-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	21,30	1.400,00	29.822,95	20,87	21,18	21,50	13.287,00
12-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	21,13	1.200,00	25.351,66	20,87	21,18	21,50	13.287,00
12-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	26,83	2.500,00	67.085,20	26,67	26,85	27,05	34.840,00
12-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	LEN3	16,83	1.200,00	20.191,60	16,57	16,81	17,02	26.671,00
12-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	LWSA3	6,76	4.300,00	29.076,00	6,33	6,71	7,07	21.755,00
12-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	LWSA3	6,74	6.500,00	43.806,58	6,33	6,71	7,07	21.755,00
12-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	13,17	10.500,00	138.253,50	12,45	13,03	13,26	30.109,00
12-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	PETZ3	7,23	11.000,00	79.548,99	7,16	7,28	7,49	11.393,00
12-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	34,50	800,00	27.598,00	34,30	34,64	35,14	19.768,00
12-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	18,98	1.300,00	24.674,50	18,80	19,05	19,46	16.591,00
12-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	61,67	900,00	55.499,34	61,08	61,84	62,49	25.784,00
12-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	SCAR3	18,29	500,00	9.146,00	17,60	17,91	18,30	14,00
12-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	16,85	3.800,00	64.030,00	16,45	16,78	17,14	6.723,00
12-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	16,74	3.700,00	61.941,48	16,45	16,78	17,14	6.723,00
12-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	16,84	100,00	1.683,91	16,45	16,78	17,14	6.723,00
12-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	16,80	900,00	15.119,93	16,45	16,78	17,14	6.723,00
12-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	9,91	1.200,00	11.895,40	9,72	9,96	10,07	18.851,00
12-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	9,95	4.100,00	40.788,00	9,72	9,96	10,07	18.851,00
12-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	9,97	17.000,00	169.427,08	9,72	9,96	10,07	18.851,00
12-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	42,52	1.700,00	72.284,83	41,09	42,17	42,81	26.613,00
12-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	TEND3	7,51	5.000,00	37.553,19	7,25	7,47	7,58	2.608,00
12-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	14,36	2.100,00	30.158,86	14,24	14,41	14,66	17.461,00



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO  
E CONTROLE DE RISCO - MAIO DE 2023



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 02 DE MAIO DE 2023 À 31 DE MAIO DE 2023

DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FROVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
12-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	VIVA3	22,74	1.300,00	29.560,99	22,35	22,81	23,10	10.090,00
12-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	VIVA3	22,60	3.500,00	79.084,96	22,35	22,81	23,10	10.090,00
12-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	VIVA3	22,63	500,00	11.313,36	22,35	22,81	23,10	10.090,00
12-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	VIVA3	22,81	18.100,00	412.861,00	22,35	22,81	23,10	10.090,00
12-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	12,42	8.900,00	110.554,09	12,12	12,44	12,96	17.438,00
12-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	CXSE3	9,92	1.641,00	16.279,09	9,79	9,92	10,03	7.455,00
12-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	CXSE3	9,91	213,00	2.110,08	9,79	9,92	10,03	7.455,00
12-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	GMAT3	6,73	29.875,00	201.200,66	6,52	6,68	6,82	16.526,00
12-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	GMAT3	6,72	2.601,00	17.480,73	6,52	6,68	6,82	16.526,00
12-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	GMAT3	6,68	4.755,00	31.781,88	6,52	6,68	6,82	16.526,00
12-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	14,41	725,00	10.450,48	14,24	14,41	14,66	17.461,00
12-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	14,38	2.840,00	40.845,34	14,24	14,41	14,66	17.461,00
12-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	14,32	8.517,00	121.986,98	14,24	14,41	14,66	17.461,00
15-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	CCRO3	13,65	38.400,00	524.160,00	13,36	13,56	13,70	12.578,00
15-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	ECOR3	6,61	55.300,00	365.356,90	6,37	6,55	6,65	6.180,00
15-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	ELET3	35,66	24.900,00	887.929,83	34,98	35,45	35,95	20.378,00
15-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	MDIA3	36,59	8.200,00	300.068,75	34,05	36,48	37,59	20.553,00
15-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ALSO3	19,62	3.200,00	62.788,90	19,18	19,56	19,74	13.887,00
15-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	ARZZ3	69,28	500,00	34.639,68	67,17	69,34	70,58	7.687,00
15-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	14,03	800,00	11.225,40	13,87	14,01	14,12	7.492,00
15-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	13,98	3.700,00	51.728,50	13,87	14,01	14,12	7.492,00
15-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	14,08	1.900,00	26.744,38	13,87	14,01	14,12	7.492,00
15-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	14,05	7.800,00	109.569,52	13,87	14,01	14,12	7.492,00
15-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	44,28	700,00	30.996,00	44,03	44,37	44,85	20.121,00
15-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	25,88	1.600,00	41.407,89	25,39	25,77	26,02	18.191,00
15-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	35,59	3.400,00	121.017,96	34,98	35,45	35,95	20.378,00
15-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,02	6.100,00	73.313,45	11,52	11,94	12,12	20.565,00
15-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	29,05	500,00	14.525,23	28,75	28,99	29,16	18.222,00
15-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	29,09	400,00	11.635,99	28,75	28,99	29,16	18.222,00
15-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	28,90	1.800,00	52.021,79	28,75	28,99	29,16	18.222,00
15-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	29,05	3.100,00	90.063,22	28,75	28,99	29,16	18.222,00
15-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,22	8.900,00	28.666,22	3,08	3,18	3,27	41.714,00
15-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	21,11	1.800,00	38.000,44	20,85	21,10	21,27	8.524,00
15-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	26,90	6.500,00	174.857,16	26,71	26,89	27,10	29.100,00
15-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	26,89	3.700,00	99.505,92	26,71	26,89	27,10	29.100,00
15-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	LTRE3	17,11	600,00	10.263,82	16,51	17,13	17,48	21.907,00
15-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	LTRE3	17,24	1.700,00	29.308,13	16,51	17,13	17,48	21.907,00
15-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	LTRE3	17,17	4.500,00	77.265,79	16,51	17,13	17,48	21.907,00
15-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	13,38	6.700,00	89.638,65	13,15	13,37	13,54	23.583,00
15-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	13,25	2.600,00	34.457,45	13,15	13,37	13,54	23.583,00
15-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	13,41	6.100,00	81.818,44	13,15	13,37	13,54	23.583,00
15-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	7,35	7.400,00	54.422,64	7,21	7,37	7,51	12.031,00
15-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	34,65	1.100,00	38.110,80	34,41	34,64	34,97	12.812,00
15-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	25,75	1.100,00	28.324,22	24,98	25,94	26,37	18.224,00
15-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	26,13	2.100,00	54.874,49	24,98	25,94	26,37	18.224,00
15-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	26,19	200,00	5.237,44	24,98	25,94	26,37	18.224,00
15-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	17,58	3.400,00	59.768,18	17,10	17,60	19,06	33.000,00
15-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	17,44	6.400,00	111.594,02	17,10	17,60	19,06	33.000,00
15-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	17,48	2.200,00	38.464,75	17,10	17,60	19,06	33.000,00
15-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	61,28	1.300,00	79.659,71	60,90	61,32	62,24	19.958,00
15-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	17,07	2.400,00	40.956,48	16,62	17,14	17,48	9.854,00
15-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	16,64	100,00	1.664,00	16,62	17,14	17,48	9.854,00
15-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	17,00	1.900,00	32.300,00	16,62	17,14	17,48	9.854,00
15-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	17,26	600,00	10.356,00	16,62	17,14	17,48	9.854,00
15-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	9,98	3.000,00	29.954,00	9,78	9,96	10,13	15.564,00
15-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	43,03	2.600,00	111.885,02	42,60	43,02	43,82	16.115,00
15-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	TEND3	7,51	1.800,00	13.521,30	7,22	7,40	7,68	5.134,00
15-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	TEND3	7,43	200,00	1.485,43	7,22	7,40	7,68	5.134,00
15-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	14,54	3.100,00	45.083,09	13,80	14,34	14,64	19.520,00
15-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	12,30	1.300,00	15.994,39	12,19	12,40	12,68	13.448,00
15-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	CXSE3	9,80	3.236,00	31.706,34	9,69	9,78	9,94	6.546,00
15-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	GMAT3	6,46	1.301,00	8.405,62	6,41	6,47	6,59	14.102,00
15-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	GMAT3	6,46	2.081,00	13.450,08	6,41	6,47	6,59	14.102,00
15-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	GMAT3	6,50	146,00	948,46	6,41	6,47	6,59	14.102,00
15-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	GMAT3	6,50	2.601,00	16.906,50	6,41	6,47	6,59	14.102,00
15-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	XPML11	104,79	137,00	14.355,80	103,01	103,87	104,98	9.804,00
16-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	BBAS3	43,78	12.100,00	529.726,69	42,93	43,43	44,74	58.856,00
16-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	CCRO3	13,23	49.000,00	648.270,00	13,23	13,41	13,86	21.549,00
16-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	HAPV3	3,46	73.900,00	255.509,25	3,36	3,47	3,65	77.281,00
16-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	LTRE3	17,37	20.200,00	350.896,82	16,91	17,27	17,58	28.115,00
16-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	NTCO3	12,79	45.500,00	582.030,65	12,78	12,97	13,35	29.079,00
16-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	PETRA	26,28	33.000,00	867.264,23	26,08	26,51	27,03	163.249,00
16-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	RDOR3	28,07	15.500,00	435.060,41	27,28	27,89	28,37	37.988,00
16-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	RENT3	61,78	11.100,00	685.793,91	59,92	61,73	62,64	32.362,00
16-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	19,98	2.400,00	47.962,10	19,43	19,81	20,32	21.293,00
16-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	ARZZ3	69,84	700,00	48.890,51	68,57	69,42	70,22	7.516,00
16-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	ARZZ3	69,18	400,00	27.671,45	68,57	69,42	70,22	7.516,00
16-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	14,08	1.900,00	26.752,00	13,96	14,04	14,21	6.922,00
16-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	14,04	4.400,00	61.794,88	13,96	14,04	14,21	6.922,00
16-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	43,25	1.200,00	51.900,34	42,93	43,43	44,74	58.856,00
16-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	25,98	4.600,00	119.506,96	25,49	25,77	26,15	23.799,00
16-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	26,07	600,00	15.641,59	25,49	25,77	26,15	23.799,00
16-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	28,66	3.200,00	91.717,73	28,57	28,74	29,13	11.111,00
16-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	3,45	35.500,00	122.536,41	3,36	3,47	3,65	77.281,00



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO  
E CONTROLE DE RISCO - MAIO DE 2023



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 02 DE MAIO DE 2023 À 31 DE MAIO 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
16-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	27,08	9.200,00	249.160,95	26,83	27,06	27,32	41.264,00
16-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	LTRE3	17,37	3.100,00	53.853,07	16,91	17,27	17,58	28.115,00
16-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	13,02	4.700,00	61.191,51	12,78	12,97	13,35	29.079,00
16-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	13,06	5.000,00	65.283,41	12,78	12,97	13,35	29.079,00
16-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	7,30	1.900,00	13.870,00	7,09	7,26	7,43	12.709,00
16-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	7,29	5.600,00	40.805,64	7,09	7,26	7,43	12.709,00
16-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	27,99	4.700,00	131.548,92	27,28	27,89	28,37	37.988,00
16-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	27,96	8.800,00	246.010,21	27,28	27,89	28,37	37.988,00
16-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	28,03	5.460,00	153.045,87	27,28	27,89	28,37	37.988,00
16-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	27,70	400,00	11.080,00	27,28	27,89	28,37	37.988,00
16-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	17,19	1.900,00	32.655,14	17,06	17,31	17,63	16.627,00
16-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	17,37	900,00	15.634,29	17,06	17,31	17,63	16.627,00
16-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	17,32	100,00	1.731,74	17,06	17,31	17,63	16.627,00
16-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	17,14	4.700,00	80.576,50	16,70	16,88	17,51	9.535,00
16-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	17,17	2.000,00	34.338,32	16,70	16,88	17,51	9.535,00
16-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	TEND3	7,43	2.500,00	18.580,89	7,18	7,39	7,61	5.192,00
16-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	VIVA3	23,29	2.600,00	60.559,63	22,95	23,30	23,98	7.856,00
16-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	VIVA3	23,72	500,00	11.860,52	22,95	23,30	23,98	7.856,00
16-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	GMAT3	6,40	71,00	454,40	6,21	6,33	6,49	10.237,00
16-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	GMAT3	6,33	901,00	5.703,33	6,21	6,33	6,49	10.237,00
16-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	GMAT3	6,37	1.360,00	8.663,20	6,21	6,33	6,49	10.237,00
16-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	GMAT3	6,32	1.180,00	7.457,60	6,21	6,33	6,49	10.237,00
16-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	GMAT3	6,38	993,00	6.335,34	6,21	6,33	6,49	10.237,00
16-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	3,50	36.663,00	128.209,00	3,36	3,47	3,65	77.281,00
16-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	3,52	13.749,00	48.362,06	3,36	3,47	3,65	77.281,00
16-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	3,45	54.026,00	186.228,57	3,36	3,47	3,65	77.281,00
16-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	MULT3	26,41	2.249,00	59.400,54	26,28	26,54	27,20	29.510,00
16-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	MULT3	26,44	7.616,00	201.375,14	26,28	26,54	27,20	29.510,00
16-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	VBRR3	14,92	22.681,00	338.423,13	14,50	14,96	15,18	26.427,00
17-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	71,61	5.600,00	401.029,78	68,67	70,51	72,02	12.244,00
17-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	ELET3	34,46	19.200,00	661.565,80	34,29	34,91	35,81	33.826,00
17-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	RENT3	62,00	7.100,00	440.205,11	61,52	62,12	62,46	21.535,00
17-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	UGPA3	17,19	19.400,00	333.480,28	16,91	17,18	17,31	15.712,00
17-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	ARZZ3	71,64	1.100,00	78.807,37	68,67	70,51	72,02	12.244,00
17-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	ARZZ3	69,90	400,00	27.960,00	68,67	70,51	72,02	12.244,00
17-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	ARZZ3	69,85	700,00	48.895,00	68,67	70,51	72,02	12.244,00
17-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	25,95	4.100,00	106.401,26	25,62	26,01	26,25	20.039,00
17-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	21,42	3.100,00	66.407,78	20,83	21,34	21,56	16.028,00
17-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	27,09	3.900,00	105.634,86	26,95	27,11	27,42	42.093,00
17-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	LTRE3	18,32	6.900,00	126.398,32	17,05	18,16	18,67	54.440,00
17-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	7,48	7.000,00	52.390,74	7,20	7,42	7,63	17.714,00
17-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	7,45	25.700,00	191.506,67	7,20	7,42	7,63	17.714,00
17-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	35,66	3.400,00	121.249,74	34,79	35,90	36,50	31.833,00
17-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	16,90	900,00	15.210,00	16,67	16,96	17,14	8.875,00
17-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	16,84	9.100,00	153.261,13	16,67	16,96	17,14	8.875,00
17-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	17,03	3.600,00	61.293,41	16,67	16,96	17,14	8.875,00
17-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	16,90	900,00	15.209,84	16,67	16,96	17,14	8.875,00
17-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	GMAT3	6,30	4.957,00	31.229,10	6,24	6,31	6,44	15.325,00
17-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	GMAT3	6,30	67.979,00	428.523,82	6,24	6,31	6,44	15.325,00
17-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	MULT3	26,49	874,00	23.156,47	26,35	26,55	26,88	18.435,00
17-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	MULT3	26,57	11.941,00	317.226,05	26,35	26,55	26,88	18.435,00
17-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	VBRR3	15,49	10.737,00	166.306,01	14,97	15,40	15,77	30.198,00
17-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	VBRR3	15,15	488,00	7.544,70	14,97	15,40	15,77	30.198,00
18-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	BBDC4	15,58	48.200,00	750.903,36	15,51	15,64	15,74	33.669,00
18-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	BRFS3	7,60	140.100,00	1.065.028,63	6,90	7,59	8,03	39.451,00
18-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	ELET3	34,33	22.700,00	779.271,87	34,10	34,43	35,12	30.350,00
18-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	MGLU3	3,55	123.000,00	436.144,88	3,33	3,49	3,59	52.873,00
18-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	PETZ3	25,76	25.900,00	667.185,46	25,35	25,58	25,85	98.332,00
18-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	RECV3	17,46	59.100,00	1.032.178,61	17,32	17,51	17,94	16.945,00
18-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	45,30	13.300,00	602.453,17	44,14	45,01	45,47	30.808,00
18-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	VAMO3	11,76	29.700,00	349.359,01	11,46	11,71	12,09	18.099,00
18-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	VBRR3	16,06	70.800,00	1.137.109,07	15,58	16,05	16,39	39.681,00
18-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	20,69	100,00	2.069,31	20,10	20,52	20,78	16.673,00
18-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	ARZZ3	71,58	1.000,00	71.581,09	70,30	71,90	73,25	11.918,00
18-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	13,73	9.200,00	126.316,00	13,66	13,75	13,93	10.080,00
18-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	13,78	100,00	1.377,75	13,66	13,75	13,93	10.080,00
18-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,12	1.400,00	16.964,69	11,85	11,99	12,30	16.908,00
18-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,09	4.400,00	53.196,62	11,85	11,99	12,30	16.908,00
18-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,11	4.100,00	49.647,62	11,85	11,99	12,30	16.908,00
18-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENJU3	1,13	18.400,00	20.713,31	0,96	1,06	1,14	1.914,00
18-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	27,04	6.400,00	173.061,47	26,76	26,95	27,14	39.919,00
18-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	7,58	7.100,00	53.785,79	7,38	7,53	7,70	14.554,00
18-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	7,67	400,00	3.069,74	7,38	7,53	7,70	14.554,00
18-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	36,12	1.600,00	57.798,08	35,61	36,15	36,49	27.316,00
18-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	36,12	1.000,00	36.123,13	35,61	36,15	36,49	27.316,00
18-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	17,45	2.100,00	36.645,00	17,32	17,51	17,94	16.945,00
18-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	17,52	5.400,00	94.621,88	17,32	17,51	17,94	16.945,00
18-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	17,17	2.800,00	48.063,45	16,87	17,19	17,45	10.639,00
18-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	17,08	4.700,00	80.285,40	16,87	17,19	17,45	10.639,00
18-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	10,04	900,00	9.037,64	9,80	9,99	10,12	20.470,00
18-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	10,03	8.100,00	81.253,34	9,80	9,99	10,12	20.470,00
18-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBRR3	15,87	8.000,00	126.957,30	15,58	16,05	16,39	39.681,00
18-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBRR3	15,80	5.800,00	91.613,10	15,58	16,05	16,39	39.681,00
18-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	13,07	700,00	9.147,02	12,45	13,12	13,41	18.135,00



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 02 DE MAIO DE 2023 À 31 DE MAIO DE 2023

DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FROVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
18-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	13,24	4.700,00	62.229,47	12,45	13,12	13,41	18.135,00
18-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	13,24	8.100,00	107.205,95	12,45	13,12	13,41	18.135,00
18-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	EQLT3	28,86	10.308,00	297.490,18	28,35	28,74	28,98	22.812,00
18-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	EQLT3	28,62	3.980,00	113.894,48	28,35	28,74	28,98	22.812,00
18-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	EQLT3	28,64	1.160,00	33.220,36	28,35	28,74	28,98	22.812,00
18-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	PRI03	36,09	7.568,00	273.108,55	35,61	36,15	36,49	27.316,00
18-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	PRI03	36,25	4.318,00	156.507,49	35,61	36,15	36,49	27.316,00
18-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSM11	85,08	912,00	77.595,46	84,97	85,09	85,24	1.957,00
19-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	MGLU3	3,70	74.100,00	274.131,84	3,53	3,65	3,73	
19-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	PETRA	25,94	21.100,00	547.425,96	25,64	25,91	26,18	
19-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	RAIL3	21,06	70.100,00	1.476.455,36	20,92	21,13	21,40	
19-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	USIM5	7,95	114.600,00	910.765,73	7,74	7,94	8,02	
19-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	VAMO3	12,56	4.100,00	51.479,54	12,00	12,96	13,70	
19-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	VBBR3	16,45	25.700,00	422.713,22	16,05	16,48	16,70	
19-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	20,79	6.900,00	143.480,42	20,35	20,82	21,05	
19-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	ARZZ3	72,04	200,00	14.408,24	70,69	71,62	73,15	
19-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	ARZZ3	72,06	400,00	28.822,18	70,69	71,62	73,15	
19-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	ARZZ3	71,88	500,00	35.937,76	70,69	71,62	73,15	
19-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	43,88	400,00	17.551,74	42,99	43,66	44,12	
19-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	43,58	300,00	13.073,90	42,99	43,66	44,12	
19-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	43,58	1.700,00	74.079,89	42,99	43,66	44,12	
19-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	26,72	400,00	10.687,43	26,57	26,76	27,00	
19-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	26,76	5.400,00	144.497,76	26,57	26,76	27,00	
19-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	26,77	1.800,00	48.180,91	26,57	26,76	27,00	
19-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	19,89	12.600,00	250.563,98	18,64	19,48	20,11	
19-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	19,95	900,00	17.957,46	18,64	19,48	20,11	
19-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	19,56	9.000,00	176.056,46	18,64	19,48	20,11	
19-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	7,47	11.900,00	88.871,56	7,31	7,46	7,61	
19-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	17,31	1.000,00	17.312,93	16,46	17,02	17,71	
19-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	17,17	3.700,00	63.519,75	16,46	17,02	17,71	
19-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	16,73	8.800,00	147.194,64	16,46	17,02	17,71	
19-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	17,43	700,00	12.201,00	16,46	17,02	17,71	
19-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	10,03	2.300,00	23.070,24	9,89	10,04	10,20	
19-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	16,54	10.800,00	178.657,14	16,05	16,48	16,70	
19-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	16,50	1.900,00	31.350,00	16,05	16,48	16,70	
19-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	13,96	59.032,00	823.983,40	13,79	13,96	14,07	
19-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	MULT3	27,10	5.162,00	139.881,26	26,60	27,07	27,34	
19-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	MULT3	27,11	11.520,00	312.306,22	26,60	27,07	27,34	
19-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	PRI03	37,00	12.385,00	458.205,13	36,57	36,98	37,34	
19-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSM11	85,11	4.891,00	416.265,28	84,90	85,13	85,29	
22-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	BBAS3	44,04	13.200,00	581.303,83	43,44	43,86	44,61	25.916,00
22-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	BRFS3	8,08	140.100,00	1.132.170,30	7,96	8,31	8,72	33.997,00
22-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	GGBR4	24,35	25.800,00	628.338,97	24,01	24,73	25,19	20.709,00
22-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	HAPV3	3,68	97.200,00	358.125,12	3,61	3,74	3,91	50.840,00
22-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	PETRA	25,73	33.300,00	856.944,71	25,50	25,68	26,01	45.630,00
22-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	45,27	8.700,00	393.812,66	45,06	45,39	45,90	13.825,00
22-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALPA4	10,53	4.500,00	47.385,00	10,10	10,36	10,70	46.858,00
22-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALPA4	10,33	27.200,00	281.054,54	10,10	10,36	10,70	46.858,00
22-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	ARZZ3	71,59	589,00	42.166,20	70,57	71,50	72,53	6.041,00
22-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	14,18	3.200,00	45.381,27	13,99	14,16	14,25	8.641,00
22-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	14,11	200,00	2.822,00	13,99	14,16	14,25	8.641,00
22-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	14,23	600,00	8.538,00	13,99	14,16	14,25	8.641,00
22-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	14,17	900,00	12.753,00	13,99	14,16	14,25	8.641,00
22-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	43,69	5.900,00	257.791,86	43,44	43,86	44,61	25.916,00
22-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	3,79	24.300,00	92.021,12	3,61	3,74	3,91	50.840,00
22-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	22,00	1.500,00	33.000,00	21,75	22,00	22,17	13.784,00
22-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	22,02	1.000,00	22.015,93	21,75	22,00	22,17	13.784,00
22-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	26,50	11.200,00	296.805,00	26,30	26,53	27,14	39.500,00
22-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	13,84	2.900,00	40.137,22	13,02	13,68	14,04	32.053,00
22-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	13,85	5.200,00	72.001,33	13,02	13,68	14,04	32.053,00
22-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	7,58	1.900,00	14.402,00	7,38	7,52	7,67	9.870,00
22-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	7,55	7.500,00	56.602,53	7,38	7,52	7,67	9.870,00
22-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	7,62	1.000,00	7.620,00	7,38	7,52	7,67	9.870,00
22-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	16,43	5.600,00	92.012,65	16,31	16,54	16,97	10.420,00
22-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	16,67	3.000,00	50.009,91	16,31	16,54	16,97	10.420,00
22-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	16,75	3.700,00	61.962,60	16,31	16,54	16,97	10.420,00
22-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	10,29	7.400,00	76.171,06	10,00	10,22	10,46	22.540,00
22-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	16,89	5.500,00	92.874,46	16,52	16,84	17,04	28.493,00
22-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	13,51	1.400,00	18.909,16	13,03	13,40	13,65	9.891,00
22-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	13,43	4.100,00	55.045,33	13,03	13,40	13,65	9.891,00
22-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	14,18	19.664,00	278.780,31	13,99	14,16	14,25	8.641,00
22-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	14,22	1.044,00	14.840,57	13,99	14,16	14,25	8.641,00
22-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	MULT3	26,86	9.082,00	243.937,19	26,78	26,96	27,51	27.485,00
22-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	MULT3	26,96	34.400,00	927.434,32	26,78	26,96	27,51	27.485,00
22-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	17,47	10.230,00	178.672,89	17,15	17,41	17,72	17.892,00
22-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	17,50	25.222,00	441.382,95	17,15	17,41	17,72	17.892,00
22-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	17,43	18.636,00	324.733,28	17,15	17,41	17,72	17.892,00
22-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	17,47	1.560,00	27.248,88	17,15	17,41	17,72	17.892,00
22-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	16,86	9.100,00	153.389,00	16,52	16,84	17,04	28.493,00
22-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	16,86	18.000,00	303.523,00	16,52	16,84	17,04	28.493,00
22-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSLG11	86,03	6.749,00	580.586,77	85,56	86,08	87,78	1.431,00
22-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSM11	85,25	4.507,00	384.222,20	85,00	85,28	85,50	2.270,00
23-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	BBAS3	44,41	15.700,00	697.246,33	43,34	44,31	44,63	37.503,00
23-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	PRI03	36,64	5.000,00	183.218,00	36,02	36,45	36,75	25.674,00



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 02 DE MAIO DE 2023 À 31 DE MAIO DE 2023

DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FROVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
23-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	WEGE3	40,35	13.300,00	536.618,00	40,02	40,38	40,87	15.192,00
23-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALPA4	10,47	12.400,00	129.849,45	10,24	10,42	10,63	26.240,00
23-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALPA4	10,45	2.800,00	29.260,00	10,24	10,42	10,63	26.240,00
23-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	14,23	2.000,00	28.462,99	14,13	14,27	14,49	12.959,00
23-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	14,22	1.800,00	25.596,00	14,13	14,27	14,49	12.959,00
23-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBA53	44,27	2.000,00	88.547,11	43,34	44,31	44,63	37.503,00
23-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	EUCA4	10,28	100,00	1.028,16	10,12	10,23	10,32	69,00
23-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	3,84	19.300,00	74.036,76	3,61	3,75	3,91	40.026,00
23-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	26,72	3.400,00	90.833,90	26,26	26,65	26,97	40.076,00
23-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	MRVE3	9,62	7.600,00	73.124,27	9,28	9,53	9,83	15.741,00
23-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	7,49	4.800,00	35.954,08	7,30	7,47	7,65	9.385,00
23-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	16,55	1.100,00	18.203,42	16,23	16,67	17,05	9.792,00
23-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	16,69	2.800,00	46.725,50	16,23	16,67	17,05	9.792,00
23-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	16,65	1.900,00	31.635,00	16,23	16,67	17,05	9.792,00
23-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	16,80	1.900,00	31.920,00	16,23	16,67	17,05	9.792,00
23-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	46,75	5.900,00	275.837,65	45,86	46,61	47,56	35.986,00
23-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	17,15	6.400,00	109.778,95	16,76	17,08	17,30	28.714,00
23-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	13,68	4.600,00	62.926,77	13,22	13,63	13,92	14.259,00
23-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	13,73	8.900,00	122.178,22	13,22	13,63	13,92	14.259,00
23-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	13,58	4.200,00	57.036,00	13,22	13,63	13,92	14.259,00
23-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	14,27	15.695,00	223.892,69	14,13	14,27	14,49	12.959,00
23-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ITUB4	26,53	17.000,00	451.044,00	26,26	26,65	26,97	40.076,00
23-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	MULT3	26,78	6.711,00	179.720,58	26,68	26,89	27,20	19.034,00
23-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	MULT3	26,79	6.295,00	168.657,41	26,68	26,89	27,20	19.034,00
23-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	PRI03	36,28	12.400,00	449.885,00	36,02	36,45	36,75	25.674,00
23-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	SUZB3	46,24	5.407,00	250.030,17	45,86	46,61	47,56	35.986,00
23-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	SUZB3	46,28	885,00	40.956,18	45,86	46,61	47,56	35.986,00
23-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	SUZB3	46,46	3.545,00	164.707,01	45,86	46,61	47,56	35.986,00
23-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSLG11	8.779,00	4,00	35.116,00	87,01	87,50	88,00	2.020,00
23-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSLG11	8.795,00	1,00	8.795,00	87,01	87,50	88,00	2.020,00
23-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSLG11	8.789,00	1,00	8.789,00	87,01	87,50	88,00	2.020,00
23-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSLG11	8.787,00	1,00	8.787,00	87,01	87,50	88,00	2.020,00
23-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSLG11	8.781,00	1,00	8.781,00	87,01	87,50	88,00	2.020,00
23-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSLG11	8.777,00	1,00	8.777,00	87,01	87,50	88,00	2.020,00
23-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSLG11	8.751,00	37,00	323.787,00	87,01	87,50	88,00	2.020,00
23-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSLG11	8.778,00	1,00	8.778,00	87,01	87,50	88,00	2.020,00
23-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSLG11	8.769,00	20,00	175.380,00	87,01	87,50	88,00	2.020,00
23-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSLG11	8.777,00	3,00	2.631,00	87,01	87,50	88,00	2.020,00
23-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSLG11	8.797,00	1,00	8.797,00	87,01	87,50	88,00	2.020,00
23-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSLG11	8.767,00	30,00	263.010,00	87,01	87,50	88,00	2.020,00
23-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSLG11	8.791,00	1,00	8.791,00	87,01	87,50	88,00	2.020,00
23-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSLG11	8.784,00	1,00	8.784,00	87,01	87,50	88,00	2.020,00
23-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSLG11	8.775,00	4,00	35.100,00	87,01	87,50	88,00	2.020,00
23-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSLG11	8.783,00	6,00	52.698,00	87,01	87,50	88,00	2.020,00
23-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSLG11	8.752,00	28,00	245.056,00	87,01	87,50	88,00	2.020,00
23-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSLG11	8.763,00	15,00	131.445,00	87,01	87,50	88,00	2.020,00
23-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSLG11	8.759,00	7,00	61.313,00	87,01	87,50	88,00	2.020,00
23-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSLG11	8.758,00	13,00	113.854,00	87,01	87,50	88,00	2.020,00
23-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSLG11	8.776,00	18,00	157.968,00	87,01	87,50	88,00	2.020,00
23-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSLG11	8.794,00	1,00	8.794,00	87,01	87,50	88,00	2.020,00
23-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSLG11	8.774,00	2,00	17.536,00	87,01	87,50	88,00	2.020,00
23-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSLG11	8.757,00	9,00	78.813,00	87,01	87,50	88,00	2.020,00
23-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSLG11	8.754,00	58,00	507.732,00	87,01	87,50	88,00	2.020,00
23-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSLG11	8.755,00	60,00	525.300,00	87,01	87,50	88,00	2.020,00
23-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSLG11	8.760,00	7,00	6.132,00	87,01	87,50	88,00	2.020,00
23-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSLG11	8.762,00	13,00	113.906,00	87,01	87,50	88,00	2.020,00
23-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSLG11	8.761,00	8,00	70.088,00	87,01	87,50	88,00	2.020,00
23-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSLG11	8.774,00	46,00	403.604,00	87,01	87,50	88,00	2.020,00
23-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSLG11	8.782,00	3,00	26.346,00	87,01	87,50	88,00	2.020,00
23-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSLG11	8.780,00	24,00	21.072,00	87,01	87,50	88,00	2.020,00
23-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSLG11	8.750,00	1.970,00	1.723.750,00	87,01	87,50	88,00	2.020,00
23-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSLG11	8.756,00	59,00	516.604,00	87,01	87,50	88,00	2.020,00
23-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSM111	859,00	41,00	35.219,00	85,48	85,90	86,06	1.958,00
23-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSM111	8.587,00	3.943,00	33.858.541,00	85,48	85,90	86,06	1.958,00
23-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSM111	8.591,00	5,00	42.955,00	85,48	85,90	86,06	1.958,00
24-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	PETRA	26,37	71.500,00	1.885.752,64	26,05	26,52	26,90	79.913,00
24-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	SBSB3	50,27	7.400,00	371.968,62	49,70	50,07	50,57	7.991,00
24-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	UGPA3	17,42	26.500,00	461.606,34	16,99	17,38	17,69	31.464,00
24-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	65,17	2.500,00	162.926,37	64,82	65,16	65,78	72.032,00
24-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALPA4	10,30	4.393,00	45.239,93	10,08	10,28	10,43	22.597,00
24-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	20,82	500,00	10.410,00	20,68	20,83	21,03	10.730,00
24-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	20,78	1.400,00	29.094,16	20,68	20,83	21,03	10.730,00
24-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	EUCA4	10,13	200,00	2.025,75	10,00	10,11	10,32	101,00
24-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	EUCA4	10,12	100,00	1.012,02	10,00	10,11	10,32	101,00
24-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	21,99	1.600,00	35.182,46	21,79	22,03	22,20	13.423,00
24-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	MRVE3	9,11	10.100,00	92.033,58	8,98	9,11	9,27	31.788,00
24-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	7,50	4.900,00	36.757,59	7,18	7,46	7,57	16.561,00
24-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	7,47	19.400,00	144.986,81	7,18	7,46	7,57	16.561,00
24-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	36,21	2.000,00	72.428,24	35,83	36,22	36,80	30.688,00
24-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	17,33	10.600,00	183.711,03	16,74	17,32	17,69	39.648,00
24-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	17,20	1.900,00	32.687,94	16,74	17,32	17,69	39.648,00
24-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	13,36	2.900,00	38.737,88	13,15	13,42	13,60	11.113,00
24-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSM111	85,78	886,00	76.004,49	85,80	85,91	85,99	3.408,00
24-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	MALL11	107,85	14.825,00	1.598.876,25	107,61	107,87	108,01	2.572,00



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO  
E CONTROLE DE RISCO - MAIO DE 2023



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 02 DE MAIO DE 2023 À 31 DE MAIO 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
25-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	21,20	1.300,00	27.564,00	20,99	21,26	21,71	15.972,00
25-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	11,65	1.000,00	11.649,00	11,35	11,66	11,88	27.394,00
25-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	14,20	1.900,00	26.972,93	14,10	14,20	14,32	5.912,00
25-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	14,20	3.200,00	45.440,00	14,10	14,20	14,32	5.912,00
25-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	14,24	10.400,00	148.115,02	14,10	14,20	14,32	5.912,00
25-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBA53	45,00	2.800,00	125.997,35	44,66	44,94	45,40	42.481,00
25-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	26,84	6.800,00	182.487,90	26,00	26,74	27,29	35.386,00
25-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	11,82	10.700,00	126.424,62	11,71	11,82	12,01	14.139,00
25-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	11,79	1.200,00	14.152,63	11,71	11,82	12,01	14.139,00
25-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENJU3	1,15	2.100,00	2.416,63	1,11	1,14	1,16	512,00
25-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	28,94	1.900,00	54.990,83	28,70	28,92	29,31	24.621,00
25-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	EUCA4	10,30	1.000,00	10.300,20	10,14	10,32	10,52	194,00
25-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	EUCA4	10,47	200,00	2.094,00	10,14	10,32	10,52	194,00
25-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	3,85	22.500,00	86.549,87	3,73	3,86	3,96	69.117,00
25-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	3,89	24.000,00	93.457,47	3,73	3,86	3,96	69.117,00
25-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	27,06	3.500,00	94.721,08	26,68	27,13	27,36	54.378,00
25-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	27,28	1.200,00	32.732,77	26,68	27,13	27,36	54.378,00
25-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	LTRE3	19,32	2.800,00	54.091,29	18,81	19,34	19,65	43.022,00
25-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	MRVE3	9,69	15.000,00	145.324,74	9,30	9,84	10,09	43.943,00
25-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	7,86	6.900,00	54.238,94	7,49	7,71	8,00	12.846,00
25-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	35,21	6.000,00	211.260,00	35,21	35,38	36,35	32.984,00
25-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	17,75	1.100,00	19.528,99	17,64	17,81	18,07	8.640,00
25-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	63,84	300,00	19.152,84	63,23	64,02	66,32	46.663,00
25-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	18,07	1.000,00	18.069,55	16,99	17,73	18,38	19.298,00
25-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	9,91	15.300,00	151.556,22	9,66	9,90	10,26	33.349,00
25-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	9,96	2.900,00	28.884,00	9,66	9,90	10,26	33.349,00
25-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	44,44	600,00	26.662,89	44,09	44,57	45,10	21.299,00
25-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	17,55	4.100,00	71.974,03	16,94	17,35	18,05	48.330,00
25-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	VIVA3	24,76	1.000,00	24.760,00	24,00	24,66	24,91	8.007,00
25-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	13,89	6.300,00	87.536,49	13,65	13,89	14,28	13.571,00
25-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ITUB4	27,30	14.661,00	400.249,84	26,68	27,13	27,36	54.378,00
25-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ITUB4	27,28	467,00	12.737,98	26,68	27,13	27,36	54.378,00
25-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	MULT3	26,95	3.005,00	80.989,05	26,48	26,84	27,20	32.657,00
25-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	MULT3	26,74	4.647,00	124.263,11	26,48	26,84	27,20	32.657,00
25-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	MULT3	26,88	4.722,00	126.938,00	26,48	26,84	27,20	32.657,00
25-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	MULT3	26,74	4.293,00	114.777,63	26,48	26,84	27,20	32.657,00
25-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	MULT3	26,79	3.864,00	103.506,43	26,48	26,84	27,20	32.657,00
25-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	PRI03	35,21	5.082,00	178.937,22	35,21	35,38	36,35	32.984,00
25-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	PRI03	35,21	6.353,00	223.689,13	35,21	35,38	36,35	32.984,00
25-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	PRI03	35,21	3.964,00	139.572,44	35,21	35,38	36,35	32.984,00
25-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	SUZB3	44,18	3.152,00	139.247,03	44,09	44,57	45,10	21.299,00
25-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	SUZB3	44,63	2.195,00	97.958,46	44,09	44,57	45,10	21.299,00
25-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	SUZB3	45,00	4.187,00	188.415,60	44,09	44,57	45,10	21.299,00
25-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	SUZB3	44,14	38,00	1.677,50	44,09	44,57	45,10	21.299,00
25-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSM111	86,33	4.504,00	388.839,14	85,72	86,30	86,84	2.885,00
26-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	21,43	1.500,00	32.137,87	20,98	21,37	21,69	11.657,00
26-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	21,45	5.000,00	107.233,00	20,98	21,37	21,69	11.657,00
26-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	14,14	7.400,00	104.601,24	14,03	14,14	14,38	6.653,00
26-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBA53	44,55	1.200,00	53.458,93	44,15	44,67	45,32	32.748,00
26-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBA53	44,98	400,00	17.991,78	44,15	44,67	45,32	32.748,00
26-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBA53	44,42	300,00	13.326,00	44,15	44,67	45,32	32.748,00
26-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	27,27	2.700,00	73.636,96	26,56	27,35	28,11	40.142,00
26-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	27,95	1.300,00	36.335,00	26,56	27,35	28,11	40.142,00
26-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	35,42	300,00	10.627,11	35,00	35,58	36,55	22.265,00
26-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	11,72	9.500,00	111.295,64	11,56	11,72	11,95	10.572,00
26-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENJU3	1,23	15.100,00	18.578,62	1,15	1,22	1,29	1.264,00
26-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	EUCA4	10,44	600,00	6.261,20	10,34	10,43	10,50	34,00
26-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,91	4.100,00	16.016,34	3,81	3,91	4,03	55.503,00
26-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	27,08	2.100,00	56.874,97	26,79	27,27	27,76	36.933,00
26-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	27,68	700,00	19.375,90	26,79	27,27	27,76	36.933,00
26-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	27,03	400,00	10.812,38	26,79	27,27	27,76	36.933,00
26-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	LTRE3	20,15	4.600,00	92.695,99	19,69	20,11	20,45	52.482,00
26-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	LTRE3	20,13	800,00	16.105,15	19,69	20,11	20,45	52.482,00
26-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	NINJ3	3,34	1.900,00	6.341,35	3,17	3,30	3,41	574,00
26-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	13,88	9.200,00	127.705,85	13,52	13,83	14,04	24.149,00
26-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	13,81	1.500,00	20.716,16	13,52	13,83	14,04	24.149,00
26-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	PETZ3	7,66	2.600,00	19.911,00	7,53	7,65	7,77	9.841,00
26-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	64,50	1.300,00	83.854,66	63,32	64,47	65,25	25.669,00
26-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	64,36	1.800,00	115.853,27	63,32	64,47	65,25	25.669,00
26-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	10,30	8.900,00	91.675,40	9,96	10,18	10,42	22.509,00
26-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	13,94	2.400,00	33.449,10	13,66	13,97	14,16	10.988,00
26-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	3,93	8.911,00	34.993,55	3,81	3,91	4,03	55.503,00
26-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	3,93	8.911,00	35.062,18	3,81	3,91	4,03	55.503,00
26-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	3,94	26.733,00	105.417,13	3,81	3,91	4,03	55.503,00
26-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	3,91	48.471,00	189.340,68	3,81	3,91	4,03	55.503,00
26-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	SUZB3	45,39	1.583,00	71.854,79	44,62	45,34	45,70	18.700,00
26-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	BTGL1	98,19	18.332,00	1.800.019,08	97,91	98,14	98,34	4.906,00
26-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSM111	86,89	8.677,00	753.968,72	86,04	87,13	88,00	4.893,00
29-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	21,60	800,00	17.281,44	21,15	21,49	21,67	10.349,00
29-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	21,53	3.800,00	81.819,51	21,15	21,49	21,67	10.349,00
29-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	14,17	3.000,00	42.510,00	14,05	14,18	14,26	3.642,00
29-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	11,53	2.700,00	31.125,79	11,45	11,54	11,71	7.260,00
29-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	11,50	2.100,00	24.150,00	11,45	11,54	11,71	7.260,00
29-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	28,35	100,00	2.835,00	28,23	28,40	29,04	14.239,00



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 02 DE MAIO DE 2023 À 31 DE MAIO 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
29-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	28,31	3.300,00	93.430,28	28,23	28,40	29,04	14.239,00
29-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	EUCA4	10,51	400,00	4.204,80	10,41	10,51	10,70	134,00
29-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	LREN3	19,67	2.600,00	51.133,32	19,47	19,68	20,19	17.432,00
29-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	LREN3	19,62	1.100,00	21.582,00	19,47	19,68	20,19	17.432,00
29-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	13,70	6.800,00	93.165,29	13,52	13,70	13,94	10.617,00
29-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	13,70	2.600,00	35.608,86	13,52	13,70	13,94	10.617,00
29-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	64,00	1.200,00	76.802,08	63,68	64,07	64,45	10.973,00
29-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	10,24	3.100,00	31.733,88	10,13	10,23	10,38	7.264,00
29-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	10,23	2.500,00	25.581,26	10,13	10,23	10,38	7.264,00
29-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	VIVA3	25,16	100,00	2.516,23	24,94	25,19	25,57	4.190,00
29-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	VIVA3	25,17	1.900,00	47.828,93	24,94	25,19	25,57	4.190,00
29-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	14,28	6.600,00	94.220,26	14,00	14,28	14,40	8.463,00
29-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	3,92	9.228,00	36.137,93	3,88	3,92	3,98	25.843,00
29-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	SUZB3	45,49	776,00	35.303,41	45,16	45,49	45,82	7.892,00
29-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSLG11	87,60	3.042,00	266.476,96	87,05	87,78	88,70	3.813,00
29-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSM11	87,79	1.728,00	151.698,44	86,68	87,41	87,99	4.460,00
29-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	XPM112	0,00	6,00	0,00		2,70		
30-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	21,68	2.600,00	56.373,21	21,42	21,65	21,85	15.526,00
30-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	21,68	1.000,00	21.680,00	21,42	21,65	21,85	15.526,00
30-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	14,19	2.000,00	28.370,11	14,15	14,22	14,30	6.609,00
30-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	44,42	1.000,00	44.415,93	44,21	44,52	44,86	29.801,00
30-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	44,73	200,00	8.945,33	44,21	44,52	44,86	29.801,00
30-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	26,76	4.100,00	109.732,76	26,33	26,78	27,77	30.131,00
30-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	34,93	800,00	27.947,32	34,46	34,77	35,07	25.038,00
30-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	11,49	1.600,00	18.382,29	11,38	11,51	11,76	9.994,00
30-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	11,57	2.100,00	24.296,87	11,38	11,51	11,76	9.994,00
30-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENJU3	1,21	11.400,00	13.810,00	1,18	1,21	1,27	944,00
30-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	28,12	1.600,00	44.999,82	28,02	28,18	28,50	18.064,00
30-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	28,13	5.000,00	140.635,34	28,02	28,18	28,50	18.064,00
30-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	21,96	800,00	17.570,89	21,72	21,96	22,40	13.972,00
30-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	26,48	2.600,00	68.836,99	26,21	26,50	27,19	46.501,00
30-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	26,63	1.200,00	31.951,36	26,21	26,50	27,19	46.501,00
30-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	LWSA3	7,84	1.200,00	9.413,00	7,74	7,89	8,17	9.804,00
30-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	13,88	6.400,00	88.857,20	13,63	13,85	14,08	29.361,00
30-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	13,98	8.800,00	122.980,94	13,63	13,85	14,08	29.361,00
30-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	7,28	5.100,00	37.150,41	7,18	7,28	7,65	9.948,00
30-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	34,14	2.100,00	71.701,83	33,58	34,23	35,41	36.054,00
30-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	34,21	300,00	10.262,55	33,58	34,23	35,41	36.054,00
30-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	17,22	1.800,00	30.998,21	16,82	17,17	17,87	14.124,00
30-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	17,34	1.000,00	17.338,30	16,82	17,17	17,87	14.124,00
30-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	63,45	500,00	31.725,62	62,81	63,52	65,33	23.235,00
30-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	18,15	26.100,00	473.715,00	17,64	18,05	18,50	17.816,00
30-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	17,95	1.500,00	26.930,60	17,64	18,05	18,50	17.816,00
30-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	10,37	5.600,00	58.073,20	10,25	10,34	10,58	18.875,00
30-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	45,17	800,00	36.134,90	44,83	45,18	46,10	14.743,00
30-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	16,06	2.200,00	35.334,90	15,76	16,04	16,72	34.787,00
30-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	14,36	1.164,00	16.711,93	14,16	14,33	14,58	11.826,00
30-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	4,06	49.953,00	203.004,66	3,88	3,99	4,11	44.731,00
30-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	4,07	4.226,00	17.199,82	3,88	3,99	4,11	44.731,00
30-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	3,96	29.948,00	118.701,23	3,88	3,99	4,11	44.731,00
30-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	4,06	31.769,00	128.979,50	3,88	3,99	4,11	44.731,00
30-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	SUZB3	45,13	2.137,00	96.434,09	44,83	45,18	46,10	14.743,00
30-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	SUZB3	45,00	8.006,00	360.270,00	44,83	45,18	46,10	14.743,00
30-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	SUZB3	45,01	418,00	18.813,37	44,83	45,18	46,10	14.743,00
30-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSM11	87,01	3.671,00	319.398,93	86,52	86,92	87,53	3.490,00
30-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	PATC11	72,00	6.944,00	499.968,00	71,61	72,00	72,78	67,00
31-05-23	FIA RVA EMB II	Compra	BRFS3	8,12	85.000,00	690.564,30	7,70	8,06	8,41	58.990,00
31-05-23	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	64,04	8.300,00	531.495,84	63,51	64,00	64,87	64.411,00
31-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	22,05	2.300,00	50.722,93	21,49	21,80	22,15	13.083,00
31-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	44,78	2.000,00	89.565,53	44,52	44,80	45,14	38.317,00
31-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	26,29	2.200,00	57.838,96	26,07	26,31	26,69	24.272,00
31-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT9	25,00	4.937,00	123.425,00	24,96	28,15	28,30	16.441,00
31-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	26,35	4.400,00	115.957,48	26,20	26,34	26,56	34.059,00
31-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	34,01	1.600,00	54.411,07	33,35	34,05	34,27	21.398,00
31-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	17,21	1.100,00	18.927,34	16,93	17,20	17,33	11.651,00
31-05-23	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	62,04	1.200,00	74.448,00	62,04	62,43	63,41	30.890,00
31-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT9	41,15	25,00	1.028,75	62,04	62,43	63,41	30.890,00
31-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	19,05	3.100,00	59.055,00	17,57	18,81	19,06	16.636,00
31-05-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	21,92	48.140,00	1.055.208,77	21,49	21,80	22,15	13.083,00
31-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	14,15	204,00	2.886,13	14,05	14,10	14,22	9.965,00
31-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	14,12	942,00	13.301,57	14,05	14,10	14,22	9.965,00
31-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	EQLT9	25,00	6.698,00	167.450,00	24,96	28,15	28,30	16.441,00
31-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	3,98	3.227,00	12.843,46	3,91	3,98	4,09	30.122,00
31-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	3,96	62.763,00	248.311,86	3,91	3,98	4,09	30.122,00
31-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	3,98	45.710,00	182.076,86	3,91	3,98	4,09	30.122,00
31-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	62,90	2.960,00	186.170,52	62,04	62,43	63,41	30.890,00
31-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	62,79	3.212,00	201.690,93	62,04	62,43	63,41	30.890,00
31-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	62,50	11,00	687,50	62,04	62,43	63,41	30.890,00
31-05-23	FIA RVA EMB IV	Venda	RENT9	41,15	21,00	864,15	62,04	62,43	63,41	30.890,00
31-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	16,85	5.324,00	89.693,56	16,74	16,90	16,99	11.654,00
31-05-23	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	16,92	21.551,00	364.577,72	16,74	16,90	16,99	11.654,00
31-05-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSM11	87,96	3.845,00	338.217,19	87,30	87,89	88,21	2.487,00
31-05-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	EQLT9	25,00	762,00	19.050,00	24,96	28,15	28,30	16.441,00





## 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](http://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.