



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO



Agosto/2021





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 4.661/2018.

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



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/08/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.695.521.410,28	VAR / PL:	5,028%
VAR:	185.797.295,72	ETL / PL:	6,3049%
ETL:	232.997.384,45	VAR / CDI:	25226,91%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(252.992.260,92)	BAIXA 1:	232.352.491,55	Cenário 1:	343.232.531,24
				Cenário 2:	(71.821.017,79)
				Cenário 3:	(506.087.073,41)

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	100.141,56	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	2.399.042,75	-	-	0,00%	-	-	-
ABEV3	26.400.591,90	2.750.988,65	1.185.661,06	0,64%	1.592.793,59	6.030,33	(2.020.188,76)
ALSO3	1.455.405,00	225.313,58	191.838,28	0,10%	366.996,38	1.276,50	(383.210,54)
AMER3	3.467.509,15	1.196.969,88	1.026.226,29	0,55%	-	-	-
ANIM3	263.535,70	69.953,51	62.291,08	0,03%	162.352,38	493,62	(126.267,86)
ASAI3	9.463.482,60	422.893,24	192.655,71	0,10%	-	-	-
AZUL4	678.231,00	113.522,66	78.457,50	0,04%	202.158,71	690,16	(202.438,02)
B3SA3	30.362.008,50	4.228.613,85	3.759.873,79	2,02%	11.613.713,03	38.364,50	(10.810.631,49)
Banco BTG Pactual SA UNT	21.805.497,84	3.329.528,83	3.127.039,02	1,68%	4.469.380,63	15.856,37	(4.880.463,37)
BBAS3	16.314.600,96	2.004.402,97	1.630.596,66	0,88%	2.607.029,62	9.431,87	(2.976.693,94)
BBDC3	1.348.116,30	129.014,54	95.322,52	0,05%	204.852,21	743,70	(235.762,32)
BBDC4	38.385.412,62	4.149.041,86	2.934.254,77	1,58%	6.077.142,41	22.000,56	(6.949.205,71)
BBRK3	23.278,00	6.770,13	3.633,93	0,00%	7.474,91	25,29	(7.333,91)
BBSE3	1.028.157,00	94.824,50	67.853,88	0,04%	212.733,22	754,11	(231.864,13)
BEEF3	111.408,00	9.841,69	8.329,16	0,00%	30.517,71	105,21	(31.233,67)
BIDI11	4.906.677,36	1.348.141,08	1.155.524,76	0,62%	2.526.343,66	7.951,57	(2.116.240,34)
BIDI4	6.083,42	1.707,07	1.487,49	0,00%	3.364,49	10,45	(2.738,83)
BKBR3	163.916,00	38.722,59	35.933,19	0,02%	94.524,11	291,23	(75.625,37)
BLCP11	1.526.877,30	-	-	0,00%	-	-	-
BLCP12	11.350,96	0,00	0,00	0,00%	-	-	-
BMBG4	146.544,00	19.325,46	18.044,26	0,01%	46.001,62	156,06	(45.421,13)
BMLC11	1.740.481,50	-	-	0,00%	-	-	-
BPAN4	2.295.216,00	666.894,77	602.182,41	0,32%	1.105.788,43	3.521,55	(950.142,96)
BPML11	1.334.158,40	65.265,50	29.153,98	0,02%	103.615,58	389,10	(128.939,38)
BRAP4	4.560.310,39	997.826,49	772.463,38	0,42%	1.576.382,70	5.281,58	(1.513.973,17)
BRDT3	4.662.981,00	790.074,89	734.724,77	0,40%	879.212,36	3.141,28	(975.568,45)
BRFS3	1.044.594,00	212.900,29	171.909,89	0,09%	260.884,23	908,33	(273.022,69)
BRIT3	186.528,00	-	-	0,00%	-	-	-
BRKM5	906.105,00	115.973,98	81.277,94	0,04%	105.999,78	390,90	(126.476,72)
BRML3	5.340.936,48	708.206,80	587.144,56	0,32%	1.177.933,66	4.151,53	(1.267.152,17)
BTLG11	948.729,51	43.894,97	25.950,15	0,01%	51.329,35	194,91	(65.555,01)
CASH3	140.700,00	102.069,49	78.960,43	0,04%	99.757,98	-	(72.776,97)
CBAV3	136.572,00	10.859,46	1.638,19	0,00%	-	-	-
CBOP11	34.430,16	1.672,14	1.365,90	0,00%	2.469,65	9,30	(3.093,23)
CCRO3	6.255.821,00	878.531,13	834.444,04	0,45%	1.801.924,08	6.176,50	(1.820.739,25)
CEAB3	9.365,08	2.781,76	2.529,01	0,00%	7.829,95	22,21	(5.263,89)
CEOC11	527.994,04	26.419,32	15.439,28	0,01%	40.683,73	152,82	(50.660,58)
CESP6	10.114.677,90	362.940,90	96.099,75	0,05%	953.733,01	3.553,89	(1.165.688,95)
CIEL3	3.232.658,00	542.424,07	462.924,58	0,25%	1.189.220,05	3.950,43	(1.120.698,23)
CJCT11	2.346.271,35	47.552,43	(34.991,82)	-0,02%	-	-	-



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/08/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.695.521.410,28	VAR / PL:	5,028%
VAR:	185.797.295,72	ETL / PL:	6,3049%
ETL:	232.997.384,45	VAR / CDI:	25226,91%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(252.992.260,92)	BAIXA 1:	232.352.491,55	Cenário 1:	343.232.531,24
				Cenário 2:	(71.821.017,79)
				Cenário 3:	(506.087.073,41)

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CLSA3	1.267.590,00	189.616,09	(163.681,76)	-0,09%	-	-	-
CMIG4	777.475,02	86.627,32	(663,48)	0,00%	(1.924,15)	(7,51)	2.622,38
CNES11	594.513,48	13.486,62	5.289,35	0,00%	41.310,93	155,73	(51.869,28)
CNRD11	78.302,00	-	-	0,00%	-	-	-
COGN3	750.758,44	168.171,48	138.484,42	0,07%	452.151,82	1.381,08	(355.128,85)
CPFE3	8.555.096,00	1.133.741,76	(508.883,60)	-0,27%	(181.899,84)	(716,78)	253.533,34
CPL6	204.327,00	20.997,35	(16.259,56)	-0,01%	(35.227,95)	(150,69)	59.917,72
CRFB3	1.402.422,84	108.088,65	65.690,71	0,04%	298.173,08	1.054,42	(323.205,22)
CSAN3	1.833.720,00	414.300,51	378.058,04	0,20%	629.596,20	2.111,34	(605.886,00)
CSED3	4.270.976,00	1.112.505,95	963.515,07	0,52%	-	-	-
CSNA3	11.638.068,00	2.116.407,35	1.209.140,99	0,65%	3.229.009,94	11.115,65	(3.294.166,75)
CURY3	52.000,00	8.366,85	7.485,67	0,00%	24.800,10	79,12	(21.390,07)
CVCB3	271.461,00	80.830,72	62.032,92	0,03%	216.512,47	621,36	(149.108,98)
CYRE COM-CPP ON	187.256,00	28.480,12	27.423,31	0,01%	81.186,95	263,12	(72.471,87)
CYRE3	996.548,95	145.059,84	115.603,78	0,06%	442.496,19	1.428,59	(391.693,94)
ECOR3	181.980,00	32.256,84	30.970,86	0,02%	94.475,14	296,91	(78.882,95)
EGIE3	527.366,00	26.372,84	2.686,82	0,00%	33.038,61	124,95	(41.796,54)
ELET3	3.203.169,75	579.367,27	531.562,07	0,29%	957.549,13	3.267,88	(958.126,17)
ELET6	7.993.161,54	1.299.408,63	1.170.439,31	0,63%	2.067.419,36	7.171,81	(2.145.819,25)
ENBR3	234.188,00	16.637,92	(6.808,47)	0,00%	(1.261,71)	(4,93)	1.725,50
ENEV3	1.312.980,00	152.015,61	135.400,38	0,07%	215.907,37	779,53	(245.373,34)
ENGI11	815.077,12	68.846,95	12.044,64	0,01%	55.708,91	210,12	(70.034,74)
ENJU3	22.356,00	5.709,45	4.568,16	0,00%	29.404,53	-	(15.212,13)
EQTL3	12.662.416,34	530.551,44	11.286,01	0,01%	29.994,66	116,80	(40.646,14)
ESPA3	2.221.886,94	403.258,63	344.215,15	0,19%	-	-	-
EUCATEX PN	75.544,00	8.520,21	(5.139,96)	0,00%	(876,25)	(3,44)	1.207,24
EWJ_US	3.090.269,13	169.482,10	(118.832,48)	-0,06%	(149.116,56)	(27.812,42)	214.824,40
EZTC3	141.752,00	17.227,51	8.976,87	0,00%	45.032,67	152,54	(44.316,61)
FLRY3	394.416,00	27.868,30	4.887,57	0,00%	45.222,25	166,95	(54.090,31)
GGBR4	1.557.867,00	152.876,64	(16.029,45)	-0,01%	36.039,39	138,91	(47.671,39)
GGPS3	2.184.224,90	436.970,89	323.337,74	0,17%	-	-	-
GMAT3	3.976.288,50	238.624,42	83.174,55	0,04%	342.605,99	1.281,47	(422.426,11)
GNDI3	14.435.450,25	973.871,75	57.338,61	0,03%	661.046,03	2.520,14	(852.146,35)
GOAU4	492.534,00	43.186,86	8.588,64	0,00%	30.431,77	115,14	(38.535,42)
GOLL4	194.777,88	28.170,62	20.356,53	0,01%	82.868,21	269,37	(74.458,79)
HAPV3	21.245.344,87	1.739.077,66	(240.029,49)	-0,13%	374.897,92	1.448,90	(499.050,91)
HBRH11	1.373.149,33	-	-	0,00%	-	-	-
HBSA3	402.606,70	95.880,02	84.207,98	0,05%	360.121,06	1.004,15	(233.639,62)
HGTX3	496.990,00	76.724,46	72.618,90	0,04%	4.373,21	16,98	(5.881,67)
HSML11	7.558.646,30	542.118,74	497.484,34	0,27%	1.331.963,04	4.784,36	(1.496.050,27)
HYPE3	6.414.129,40	487.837,45	83.899,45	0,05%	(255.147,76)	(1.014,98)	363.744,51



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/08/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.695.521.410,28	VAR / PL:	5,028%
VAR:	185.797.295,72	ETL / PL:	6,3049%
ETL:	232.997.384,45	VAR / CDI:	25226,91%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(252.992.260,92)	BAIXA 1:	232.352.491,55	Cenário 1:	343.232.531,24
				Cenário 2:	(71.821.017,79)
				Cenário 3:	(506.087.073,41)

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
QUAL3	565.450,00	149.153,75	141.412,87	0,08%	415.353,43	1.215,43	(297.926,33)
RADL3	11.622.708,00	774.710,96	308.836,17	0,17%	390.459,67	1.497,35	(510.334,24)
RAIL3	13.270.154,95	1.870.568,49	1.531.539,36	0,82%	3.195.275,44	11.166,45	(3.372.071,39)
RAPT4	5.143.320,00	991.374,67	878.282,17	0,47%	2.122.711,47	6.932,88	(1.927.174,44)
RBGS11	638.881,62	47.306,13	24.893,16	0,01%	70.035,81	259,14	(84.215,32)
RBRL11	2.038.382,00	125.840,20	41.087,90	0,02%	-	-	-
RCRB11	1.636.107,54	164.821,92	73.003,04	0,04%	122.062,07	459,03	(152.402,00)
RDOR3	234.560,00	24.854,21	(20.686,00)	-0,01%	(32.712,50)	-	-
RECV3	402.280,00	96.202,78	82.064,22	0,04%	-	-	-
RENT3	5.871.752,25	1.154.253,57	1.082.041,09	0,58%	2.667.060,00	8.578,58	(2.341.787,70)
RNGO11	153.719,68	14.400,15	13.009,51	0,01%	27.448,03	98,49	(30.757,87)
SANB11	887.735,00	76.087,45	23.112,61	0,01%	3.962,46	15,41	(5.356,38)
SBSP3	681.876,00	55.956,33	(11.735,27)	-0,01%	63.749,65	237,64	(77.984,18)
SDIL11	374.340,85	18.645,34	13.697,47	0,01%	38.160,98	141,70	(46.262,28)
SDIL12	9.316,34	-	-	0,00%	-	-	-
SEER3	392.691,73	115.943,83	99.210,16	0,05%	186.155,28	594,49	(160.919,75)
SMFT3	78.300,00	18.742,89	10.655,33	0,01%	-	-	-
SOMA3	551.460,00	92.916,09	85.241,83	0,05%	4.795,09	18,61	(6.449,86)
SPY	5.930.990,72	280.969,66	(186.223,65)	-0,10%	(286.191,56)	(53.378,92)	412.301,15
STBP3	8.462.070,00	2.124.783,41	2.012.868,21	1,08%	3.249.726,44	10.728,86	(3.021.151,23)
SULA11	2.872.044,06	340.301,16	211.304,21	0,11%	842.138,74	2.880,61	(846.974,72)
SUZB3	19.809.686,08	2.917.660,16	(1.731.190,66)	-0,93%	279.229,20	1.081,05	(373.234,03)
TAAE11	458.400,00	27.661,92	(12.939,04)	-0,01%	(40.091,41)	(163,54)	60.708,20
TCSA3	65.712,00	15.908,09	14.695,44	0,01%	48.929,67	142,73	(34.865,79)
TEND3	1.437.240,00	227.743,85	216.371,69	0,12%	750.429,62	2.355,95	(625.167,37)
TEPP11	7.835.972,08	877.072,98	507.462,82	0,27%	887.901,41	3.279,85	(1.063.522,24)
TIMS3	5.242.380,00	412.339,25	(132.911,57)	-0,07%	(110.093,48)	(433,77)	153.400,70
TOTS3	14.220.360,00	1.695.870,53	1.092.066,43	0,59%	672.700,43	2.562,72	(865.697,31)
TRXF11	13.506.110,10	351.804,88	58.328,52	0,03%	271.893,36	1.049,53	(360.896,38)
UGPA3	8.542.452,39	1.321.789,46	1.175.343,14	0,63%	4.312.404,14	13.621,34	(3.640.164,12)
USIM5	521.920,00	87.554,23	17.790,50	0,01%	45.896,46	171,53	(56.481,03)
VALE3	87.801.078,60	13.504.017,28	11.052.425,36	5,95%	22.982.177,05	79.622,89	(23.785.448,95)
VIIA3	899.536,00	39.142,14	(24.972,26)	-0,01%	-	-	-
VISC11	5.106,00	456,71	333,76	0,00%	579,54	2,14	(694,03)
VISC13	78,92	-	-	0,00%	-	-	-
VIVT3	1.058.228,00	88.325,72	(54.465,98)	-0,03%	(72.484,92)	(292,70)	107.116,72
VTV_US	5.993.036,73	328.680,90	(230.454,82)	-0,12%	(289.185,50)	(53.937,33)	416.614,36
VVPR11	1.086.602,50	-	-	0,00%	-	-	-
WEGE3	11.722.928,00	601.650,56	(137.491,12)	-0,07%	(616.375,64)	(2.468,26)	892.777,95
WEST3	118.300,00	-	-	0,00%	-	-	-
WSPU21	3.061.479,41	188.111,51	(125.935,58)	-0,07%	(147.727,35)	(27.553,31)	212.823,04



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/08/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.695.521.410,28	VAR / PL:	5,028%
VAR:	185.797.295,72	ETL / PL:	6,3049%
ETL:	232.997.384,45	VAR / CDI:	25226,91%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(252.992.260,92)	BAIXA 1:	232.352.491,55	Cenário 1:	343.232.531,24
				Cenário 2:	(71.821.017,79)
				Cenário 3:	(506.087.073,41)

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lambda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
XPIN11	1.981.847,52	83.095,00	34.495,48	0,02%	156.683,55	-	(194.681,17)
XPIN13	294.229,80	-	-	0,00%	-	-	-
XPIN14	2.842.600,00	-	-	0,00%	-	-	-
XPPR11	3.638.634,00	276.775,97	163.472,75	0,09%	13.356,71	-	(18.072,16)
YDUQ3	869.141,92	192.072,49	166.709,69	0,09%	493.388,43	1.524,77	(397.341,61)
INDV21	-	1.347.585,12	1.269.851,38	0,68%	-	-	-
WINV21	-	1.155.756,03	1.063.360,60	0,57%	-	-	-
DI1U21	-	12.843,00	9.221,15	0,00%	15.857,59	(8.269,55)	(24.590,43)
DI1V21	-	145.889,50	(81.332,33)	-0,04%	(413.865,84)	215.635,52	640.833,85
DI1F22	-	7.893,13	7.367,84	0,00%	19.912,68	(10.338,65)	(30.652,32)
DI1J22	-	1.986,23	1.770,84	0,00%	5.184,21	(2.682,61)	(7.935,59)
DI1N22	-	2.619,95	(2.318,75)	0,00%	(6.667,49)	3.439,73	10.154,68
DAPQ22	-	115.498,36	84.067,51	0,05%	48.702,57	(17.783,95)	(107.804,53)
DI1V22	-	2.647,79	2.373,86	0,00%	6.307,48	(3.244,31)	(9.558,72)
DI1F23	-	57.927,31	53.135,43	0,03%	123.911,71	(63.554,99)	(186.899,11)
DAPK23	-	242.911,90	220.528,29	0,12%	177.939,24	(64.654,22)	(389.312,05)
DI1N23	-	11.550,20	10.994,37	0,01%	21.103,57	(10.761,03)	(31.522,62)
DI1F24	-	67.207,24	65.110,58	0,04%	108.079,60	(54.787,98)	(159.867,16)
DI1N24	-	12.517,22	12.221,24	0,01%	18.646,73	(9.398,56)	(27.320,84)
DAPQ24	-	389.743,46	361.596,25	0,19%	355.791,49	(128.327,58)	(765.100,97)
DI1F25	-	197.315,77	193.523,38	0,10%	285.036,62	(142.795,38)	(413.433,05)
DAPK25	-	93.174,71	87.211,05	0,05%	-	-	-
DI1F26	-	28.147,87	27.731,06	0,01%	38.932,97	(19.272,86)	(55.365,65)
DAPQ26	-	80.227,36	75.392,77	0,04%	-	-	-
DI1F27	-	2.841.379,08	2.799.216,70	1,51%	3.978.077,20	(1.945.416,61)	(5.544.548,49)
DAPQ28	-	9.741,65	(9.290,40)	-0,01%	-	-	-
DI1F29	-	2.086.550,69	2.050.384,68	1,10%	2.940.517,64	(1.403.067,53)	(3.935.996,25)
DAPQ30	-	0,42	(0,41)	0,00%	(0,54)	0,19	1,09
DI1F31	-	16.509,66	16.201,95	0,01%	24.751,00	(11.521,94)	(31.819,69)
AFSU21	-	17.367,27	6.363,01	0,00%	21.008,06	4.210,77	(30.139,63)
AUSU21	-	14.190,18	29,40	0,00%	22.367,28	5.117,24	(29.032,43)
CHLU21	-	50.027,56	(10.865,88)	-0,01%	(131.361,93)	(14.031,73)	198.089,24
DOLU21	-	342.005,16	239.877,40	0,13%	301.069,97	56.015,38	(433.793,08)
EUPU21	-	16.135,97	1.762,29	0,00%	(8.773,95)	(8.331,59)	11.789,84
MEXU21	-	28.486,28	4.877,50	0,00%	7.553,15	7.020,25	(10.382,47)
NZLU21	-	15.291,32	(3.148,84)	0,00%	2.304,84	4.912,62	(3.116,38)
SWIU21	-	25.965,78	1.846,94	0,00%	7.459,63	(7.087,00)	(10.024,82)
WDOU21	-	342.005,16	(239.877,40)	-0,13%	(301.069,97)	(56.015,38)	433.793,08
COMPROMISSADA	319.729.350,77	8.288,81	5.951,28	0,00%	10.234,41	(5.337,13)	(15.870,53)
EMP AÇÃO PROVISÃO	(104.797,64)	20,75	(12,23)	0,00%	(59,32)	30,91	91,87
LTN	5.728.357,68	114.744,07	111.164,40	0,06%	184.526,15	(93.540,46)	(272.943,93)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/08/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.695.521.410,28	VAR / PL:	5,028%
VAR:	185.797.295,72	ETL / PL:	6,3049%
ETL:	232.997.384,45	VAR / CDI:	25226,91%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(252.992.260,92)	BAIXA 1:	232.352.491,55	Cenário 1:	343.232.531,24
				Cenário 2:	(71.821.017,79)
				Cenário 3:	(506.087.073,41)

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lambda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
DE252 AEGEA SA CDI -	1.052.465,18	47,28	28,29	0,00%	142,54	(73,37)	(216,33)
DE252 AERIS CDI - AER11	1.259.580,82	1.087,16	1.047,96	0,00%	1.909,00	(967,99)	(2.825,35)
DE252 ALIANSCE CDI -	4.066.962,39	46.925,40	46.273,34	0,02%	62.553,09	(30.749,92)	(87.922,96)
DE252 AUTOPIST CDI -	1.504.874,31	573,52	555,72	0,00%	967,20	(486,30)	(1.411,62)
DE252 B3SA CDI - BSA313	1.696.681,30	250,04	224,56	0,00%	568,83	(290,98)	(854,27)
DE252 BCBF CDI - BCBF14	275.059,44	170,76	163,47	0,00%	312,74	(158,90)	(464,42)
DE252 BCBF CDI - BCBF15	2.663.483,81	1.821,51	1.748,99	0,00%	3.283,63	(1.667,20)	(4.870,39)
DE252 BKBR CDI - BKBR18	1.469.979,95	446,60	420,67	0,00%	870,45	(443,47)	(1.298,46)
DE252 BRKA CDI - BRKP18	2.724.047,23	3.123,42	3.010,57	0,00%	5.460,05	(2.770,05)	(8.087,81)
DE252 BRML CDI - BRML17	3.189.778,55	6.355,63	(6.246,91)	0,00%	(8.959,11)	4.507,63	13.088,81
DE252 CELPA CDI - CELP15	2.588.032,77	96,49	40,72	0,00%	297,44	(153,29)	(452,33)
DE252 COELCE CDI -	4.224.708,04	30.669,53	29.922,27	0,02%	46.033,29	(23.213,56)	(67.501,77)
DE252 COPEL GT CDI -	291.426,24	627,56	(593,82)	0,00%	(1.231,06)	633,54	1.867,32
DE252 COPEL GT CDI -	290.676,62	451,48	(439,08)	0,00%	(707,85)	360,43	1.054,86
DE252 CORSAN CDI -	1.617.764,55	23.607,48	23.240,58	0,01%	32.665,35	(16.373,38)	(47.397,98)
DE252 COSAN LO CDI -	2.659.716,71	1.513,60	1.445,89	0,00%	2.805,99	(1.426,36)	(4.170,08)
DE252 CSAN CDI - CSAN23	1.131.044,55	4.555,22	4.480,70	0,00%	6.722,98	(3.279,18)	(9.334,86)
DE252 DASA CDI - DASAA2	2.684.276,86	534,67	494,70	0,00%	1.114,81	(568,87)	(1.667,40)
DE252 ECORODOV CDI -	1.853.562,44	34.568,49	33.987,22	0,02%	48.927,51	(23.565,20)	(66.506,65)
DE252 ECORODOV CDI -	2.144.803,94	400,43	347,78	0,00%	1.017,88	(523,72)	(1.543,44)
DE252 ELEKTRO CDI -	3.138.926,28	4.038,99	(3.828,20)	0,00%	(7.478,96)	3.841,34	11.306,99
DE252 ENERG TR CDI -	2.996.478,20	67.249,13	66.062,61	0,04%	101.910,52	(49.525,89)	(140.684,12)
DE252 ENERSUL CDI -	984.083,71	414,68	(377,78)	0,00%	(957,80)	498,18	1.478,76
DE252 GETI CDI - TIET19	2.406.803,04	28.500,67	27.997,21	0,02%	41.930,74	(19.751,75)	(54.968,26)
DE252 GETI CDI - TIET27	7.068.658,57	191,62	(62,29)	0,00%	361,69	(186,62)	(551,25)
DE252 GUAR CDI - GUAR24	2.773.611,70	2.389,23	2.296,43	0,00%	4.276,87	(2.172,21)	(6.347,02)
DE252 IGUATEMI CDI -	2.129.200,03	4.475,87	(4.385,50)	0,00%	(6.404,81)	3.239,97	9.441,45
DE252 INTERVIA CDI -	1.327.744,08	447,78	425,01	0,00%	847,36	(430,97)	(1.260,42)
DE252 LAME CDI - LAMEA1	369.309,95	43,68	33,73	0,00%	130,90	(67,94)	(201,40)
DE252 LOCALIZA CDI -	1.145.356,21	229,44	(215,52)	0,00%	(500,38)	260,22	772,28
DE252 MOV_PART CDI -	1.124.347,07	1.371,80	1.334,71	0,00%	2.272,23	(1.145,06)	(3.328,75)
DE252 MOV_PART CDI -	1.421.433,18	47,94	(37,97)	0,00%	0,02	-	(0,03)
DE252 MOVIDA L CDI -	1.798.157,93	2.553,08	(209,75)	0,00%	6.089,16	(3.303,43)	(10.053,86)
DE252 MULTIPLA CDI -	3.139.474,29	4.654,93	(4.546,03)	0,00%	(6.888,34)	3.498,35	10.220,83
DE252 NATURA CDI -	1.763.189,76	59,46	(47,09)	0,00%	0,03	0,00	(0,04)
DE252 OMEGA GE CDI -	3.349.683,12	6.345,28	6.228,65	0,00%	9.663,08	(4.793,91)	(13.795,61)
DE252 OURO VER CDI -	2.199.979,61	2.632,33	2.559,61	0,00%	4.313,41	(2.176,51)	(6.332,36)
DE252 RD COLIN CDI -	3.281.510,60	51.472,11	50.720,69	0,03%	70.701,69	(35.462,03)	(102.643,00)
DE252 RENNER CDI -	1.388.605,28	462,97	436,57	0,00%	903,93	(460,46)	(1.348,04)
DE252 RT BANDE CDI -	3.391.723,55	3.747,69	3.654,59	0,00%	6.040,30	(3.036,42)	(8.812,72)
DE252 S LUIZ A CDI -	1.118.225,69	4.323,11	4.252,30	0,00%	6.382,46	(3.112,82)	(8.860,78)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/08/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.695.521.410,28	VAR / PL:	5,028%
VAR:	185.797.295,72	ETL / PL:	6,3049%
ETL:	232.997.384,45	VAR / CDI:	25226,91%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(252.992.260,92)	BAIXA 1:	232.352.491,55	Cenário 1:	343.232.531,24
				Cenário 2:	(71.821.017,79)
				Cenário 3:	(506.087.073,41)

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lambda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
DE252 SANEAMEN CDI -	2.625.914,63	1.499,67	1.435,45	0,00%	2.754,44	(1.399,56)	(4.090,61)
DE252 SBF COME CDI -	4.160.657,86	50.461,07	49.451,81	0,03%	72.112,09	(36.580,18)	(106.693,29)
DE252 SUL AME CDI -	1.321.602,28	365,79	(340,99)	0,00%	(797,71)	412,42	1.219,25
DE252 TELEF BR CDI -	5.046.091,82	22.900,34	19.729,81	0,01%	42.654,11	(22.497,07)	(67.287,48)
DE252 USIMINAS CDI -	3.429.800,11	10.337,76	9.662,16	0,01%	19.275,58	(9.919,24)	(29.223,20)
DE252 VAMOS CDI -	2.713.962,79	2.363,97	2.292,26	0,00%	3.974,18	(2.007,01)	(5.842,49)
DE252 VAMOS CDI -	297.050,32	1.526,09	1.501,26	0,00%	2.248,44	(1.098,03)	(3.128,16)
LF selic	8.342.665,76	10.831,59	(10.586,31)	-0,01%	(15.637,00)	8.159,49	24.273,23
LF252 ABC CDI -	1.026.751,98	34,63	(27,42)	0,00%	0,02	0,00	(0,02)
LF252 B.ALFA CDI -	999.223,69	33,70	(26,69)	0,00%	0,02	(0,00)	(0,02)
LF252 PARANA B CDI -	516.116,17	17,41	(13,78)	0,00%	0,01	(0,00)	(0,01)
LFSN B VOTORA CDI -	2.283.400,06	181,41	(138,25)	0,00%	(321,13)	167,44	497,75
LFSN BRADESCO CDI -	3.374.273,86	113,80	(90,12)	0,00%	0,06	0,00	(0,08)
LFT	127.984.048,35	48.278,25	(10.732,31)	-0,01%	2,10	-	(2,85)
CMTR33	5.222.503,20	33.441,37	16.035,68	0,01%	(1.232,78)	452,70	2.765,44
CRI RB CAPIT IPCA M D -	8.351.008,30	155.943,98	146.184,10	0,08%	150.167,66	(53.934,98)	(301.361,89)
DE252 AEGEA SA IPCA -	11.781.005,54	238.955,56	222.999,28	0,12%	227.838,47	(82.458,76)	(469.540,15)
DE252 CCR IPCA - CCRDD1	4.963.501,69	81.812,06	75.534,07	0,04%	72.308,42	(26.020,45)	(150.951,05)
DE252 CEMIG - IPCA	2.516.107,11	34.095,81	30.835,65	0,02%	26.242,57	(9.476,39)	(56.590,51)
DE252 COMGAS IGPM-100 -	39.748.564,89	866.004,80	776.273,81	0,42%	1.387.499,50	(41.588,17)	(39.626.016,97)
DE252 CSAN IPCA -	5.540.191,26	202.113,38	194.867,30	0,10%	252.741,56	(87.794,58)	(471.563,01)
DE252 CSMG IPCA -	12.859.382,95	207.268,68	191.308,52	0,10%	183.140,41	(66.155,62)	(380.182,99)
DE252 DUKE GEP - IPCA	13.789.513,58	140.763,80	120.696,19	0,06%	89.006,64	(32.353,68)	(194.925,83)
DE252 ECORODOV IPCA -	10.284.093,83	202.440,30	188.767,59	0,10%	191.889,63	(69.653,98)	(395.155,51)
DE252 ECORODOV IPCA -	3.309.001,13	54.541,37	50.356,04	0,03%	48.205,61	(17.346,97)	(100.634,04)
DE252 ECPT - IPCA ECPT11	2.968.520,12	22.567,15	13.836,84	0,01%	6.045,69	(2.200,06)	(13.274,74)
DE252 ECPT - IPCA ECPT21	447.326,11	3.163,90	2.015,42	0,00%	381,41	(139,49)	(847,38)
DE252 ECPT - IPCA ECPT31	593.305,16	4.700,97	3.356,21	0,00%	1.637,91	(598,37)	(3.629,52)
DE252 ECPT - IPCA ECPT41	3.031.597,78	23.783,58	17.279,99	0,01%	4.538,66	(1.655,00)	(10.013,47)
DE252 IMED - IPCA	1.095.676,80	7.840,83	5.256,75	0,00%	1.506,93	(556,89)	(3.292,02)
DE252 IRB IPCA - IRBR12	13.553.281,42	346.463,27	328.007,17	0,18%	359.914,94	(129.462,01)	(716.713,86)
DE252 LIGHT IPCA - LIGHD7	5.333.438,35	128.191,72	120.935,27	0,07%	127.112,21	(44.912,33)	(258.811,09)
DE252 LIGHT IPCA -	4.635.067,27	42.071,22	35.187,11	0,02%	22.136,97	(8.034,32)	(47.546,49)
DE252 LOCALIZA IPCA -	9.186.859,65	327.560,95	315.698,88	0,17%	411.953,85	(141.826,13)	(768.655,74)
DE252 MOVIDA L IPCA -	6.038.962,44	251.655,03	241.010,05	0,13%	293.203,11	(103.665,22)	(601.884,92)
DE252 PETR IPCA - PETR45	13.755.226,34	218.792,70	200.823,31	0,11%	189.897,01	(68.361,29)	(401.790,07)
DE252 RD COLIN - IPCA	8.220.923,83	56.927,52	50.015,98	0,03%	48.363,72	(20.766,10)	(91.193,18)
DE252 SABESP - IPCA	10.001.678,75	80.463,81	57.765,25	0,03%	31.086,41	(11.315,28)	(68.297,14)
DE252 SABESP IPCA -	13.887.023,12	244.031,54	225.919,74	0,12%	219.119,08	(78.685,02)	(457.050,90)
DE252 TRANS AL - IPCA	15.372.007,38	189.803,58	169.818,01	0,09%	132.968,59	(48.090,96)	(287.789,70)
DE252 VAMOS IPCA -	6.084.471,64	217.811,75	210.238,47	0,11%	272.267,59	(96.081,49)	(504.825,56)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/08/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.695.521.410,28	VAR / PL:	5,028%
VAR:	185.797.295,72	ETL / PL:	6,3049%
ETL:	232.997.384,45	VAR / CDI:	25226,91%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(252.992.260,92)	BAIXA 1:	232.352.491,55	Cenário 1:	343.232.531,24
				Cenário 2:	(71.821.017,79)
				Cenário 3:	(506.087.073,41)

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lambda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
DEBI ALGA IPCA - ALGAB1	3.185.569,92	115.425,56	111.026,19	0,06%	142.894,96	(48.676,59)	(270.446,21)
DEBI ANEMUS IPCA -	2.231.745,75	91.524,37	88.412,47	0,05%	122.073,41	(43.463,70)	(211.874,46)
DEBI ANET IPCA - ANET11	6.938.507,53	160.099,41	151.723,56	0,08%	165.899,39	(58.608,00)	(331.128,25)
DEBI B2W IPCA - BTOW15	9.019.796,01	330.814,98	319.908,87	0,17%	422.074,36	(150.695,56)	(769.650,88)
DEBI BRISANET IPCA -	3.405.981,88	87.872,19	83.350,56	0,04%	92.247,16	(32.685,71)	(183.931,18)
DEBI BRKA IPCA - BRKP28	8.666.965,34	310.448,57	297.069,05	0,16%	406.515,00	(134.333,21)	(762.596,18)
DEBI CAGECE IPCA -	9.049.317,12	193.139,66	173.317,06	0,09%	201.380,05	(50.951,93)	(479.289,46)
DEBI CEEE D IPCA - CEED21	4.093.052,18	137.422,45	131.970,06	0,07%	162.258,81	(56.420,56)	(311.889,73)
DEBI CORSAN IPCA -	4.342.905,63	131.881,91	125.937,45	0,07%	148.916,67	(51.226,60)	(291.554,53)
DEBI CTEEP IPCA - CTEE29	979.133,58	37.126,40	35.622,85	0,02%	49.564,13	(16.537,69)	(86.472,32)
DEBI ECHOENER IPCA -	1.683.758,67	46.077,27	43.846,07	0,02%	50.129,25	(17.297,55)	(99.272,22)
DEBI ELETROB IPCA -	2.185.383,22	79.842,16	76.846,03	0,04%	100.638,86	(34.026,04)	(188.762,29)
DEBI ELETROB IPCA -	11.891.713,50	366.350,13	350.428,25	0,19%	414.604,61	(144.033,79)	(809.758,51)
DEBI ENERGMIR IPCA -	1.005.689,14	21.754,58	20.476,08	0,01%	21.633,23	(7.776,69)	(43.563,73)
DEBI ENSINOP IPCA -	590.484,00	17.925,58	17.259,69	0,01%	21.586,61	(7.871,86)	(39.931,85)
DEBI ENTREVIA IPCA -	26.767.651,02	830.764,37	799.986,70	0,43%	993.627,13	(360.773,28)	(1.861.655,26)
DEBI IGUA SAN IPCA -	10.827.920,50	367.500,12	353.292,22	0,19%	458.545,23	(160.445,37)	(846.718,33)
DEBI JAGUARA IPCA -	1.664.640,62	34.566,83	32.474,61	0,02%	33.944,15	(12.206,26)	(68.488,32)
DEBI LAME IPCA - LAMEA6	9.346.606,87	334.110,97	323.376,76	0,17%	424.943,38	(153.164,82)	(772.423,71)
DEBI METRORIO IPCA -	9.658.391,54	316.906,50	304.727,23	0,16%	374.726,57	(134.602,51)	(710.518,22)
DEBI MG050 IPCA -	2.241.545,43	64.460,60	61.712,99	0,03%	73.808,91	(26.009,63)	(141.909,22)
DEBI NEOENERG IPCA -	5.877.754,92	189.004,10	180.351,58	0,10%	212.162,10	(71.993,75)	(422.082,87)
DEBI NORTE EN IPCA -	7.917.927,65	228.210,91	218.798,06	0,12%	260.585,03	(94.163,09)	(497.910,80)
DEBI PAMPASUL IPCA -	1.402.614,91	29.775,37	28.173,66	0,02%	29.985,17	(10.711,16)	(59.571,89)
DEBI PAMPASUL IPCA -	4.114.419,93	154.271,75	149.227,97	0,08%	206.367,63	(74.051,22)	(357.498,78)
DEBI PAMPASUL IPCA -	2.802.465,17	97.010,37	93.523,94	0,05%	122.399,01	(42.370,93)	(225.693,14)
DEBI PARANAGU IPCA -	710.304,04	16.455,82	15.615,25	0,01%	17.630,99	(6.258,39)	(34.502,67)
DEBI QUATA IPCA -	4.424.738,06	102.258,30	96.409,65	0,05%	102.951,32	(37.334,75)	(206.755,36)
DEBI RIO PR IPCA - RIPR22	529.785,39	18.807,03	18.071,78	0,01%	23.037,09	(7.767,73)	(43.950,82)
DEBI TAUBATE IPCA -	9.442.781,20	318.702,01	305.099,36	0,16%	403.054,69	(136.075,80)	(741.563,18)
DEBI UTE GNA IPCA -	1.075.566,68	49.270,98	47.424,66	0,03%	68.014,33	(23.251,75)	(117.935,62)
DEBI VENSJOR IPCA -	1.313.393,86	30.592,16	29.105,83	0,02%	33.145,40	(12.278,57)	(63.969,19)
DEBI VIARONDO IPCA -	10.145.765,55	356.647,18	342.661,56	0,18%	447.548,35	(154.148,99)	(829.030,70)
ECCR32	6.911.008,46	55.686,58	41.913,09	0,02%	15.055,06	(5.490,23)	(33.222,22)
LF ipca	1.307.574,43	13.266,69	11.037,61	0,01%	8.477,03	(3.085,39)	(18.621,43)
LFS ITAU IPCA -	5.020.873,26	41.572,83	30.322,40	0,02%	17.907,87	(6.538,74)	(39.633,87)
LFS ITAU IPCA M D -	792.253,09	7.524,04	6.285,31	0,00%	4.092,24	(1.491,88)	(9.023,87)
LFS ITAU IPCA M D -	3.961.265,43	37.620,21	31.426,57	0,02%	20.461,19	(7.459,42)	(45.119,37)
LFS ITAU IPCA M D -	9.507.037,03	90.288,50	75.423,77	0,04%	49.106,87	(17.902,61)	(108.286,50)
LFS ITAU IPCA M D -	7.130.277,78	67.716,37	56.567,83	0,03%	36.830,15	(13.426,96)	(81.214,87)
LFS ITAU IPCA M D -	5.545.771,60	52.668,29	43.997,20	0,02%	28.645,67	(10.443,19)	(63.167,12)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/08/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.695.521.410,28	VAR / PL:	5,028%
VAR:	185.797.295,72	ETL / PL:	6,3049%
ETL:	232.997.384,45	VAR / CDI:	25226,91%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(252.992.260,92)	BAIXA 1:	232.352.491,55	Cenário 1:	343.232.531,24
				Cenário 2:	(71.821.017,79)
				Cenário 3:	(506.087.073,41)

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lambda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
LFS ITAU IPCA M D -	7.934.934,93	76.346,56	64.305,74	0,03%	42.207,72	(15.385,24)	(93.042,00)
LFSN BRADESCO IPCA -	11.820.219,86	283.643,98	265.597,21	0,14%	266.561,49	(95.909,07)	(569.949,15)
LFSN BRADESCO IPCA M D -	3.826.932,67	103.817,15	97.627,96	0,05%	101.310,00	(36.352,99)	(215.251,97)
NTNB	1.886.072.735,17	110.990.525,95	110.068.291,82	59,24%	196.010.313,11	(63.741.545,60)	(334.406.777,37)
DOLUPDB	0,00	0,03	0,02	0,00%	1.065,68	0,03	(0,00)
IBOVJ124	(65.497,18)	110.015,89	(103.555,99)	-0,06%	-	(1.487,46)	65.384,63
IBOVU115	115.980,97	303.689,43	(285.930,47)	-0,15%	(392.190,37)	(2.727,36)	2.354.135,11
IBOVV113	48.322,02	68.728,92	(64.690,88)	-0,03%	(115.876,27)	(961,30)	371.961,99
IDIFQHK	-	0,00	0,00	0,00%	(46.335,26)	-	-
IDIFQHL	-	0,00	(0,00)	0,00%	85.941.017,00	-	-
IDIFQHM	(0,00)	0,00	(0,00)	0,00%	(90.541.696,47)	0,00	0,00
IDIFQHN	0,00	0,00	0,00	0,00%	(110.573.777,43)	(0,00)	(0,00)
IDIFQHP	0,00	0,00	0,00	0,00%	101.539.383,91	(0,00)	(0,00)
IDIFQHV	(12,57)	143,07	(137,81)	0,00%	14.931.057,66	15,29	15,29
IDIFQHW	70,14	732,13	705,22	0,00%	(20.225.417,98)	(83,95)	(83,96)
IDIVPDX	-	0,00	0,00	0,00%	20.956.035,08	-	-
IDIVPDY	(0,00)	0,00	(0,00)	0,00%	45.094.741,39	0,00	0,00
IDIVPDZ	0,00	0,03	0,03	0,00%	(94.824.000,33)	(0,00)	(0,00)
AB AMERICAN GROWTH	8.945.046,45	483.410,47	(171.204,19)	-0,09%	49.729.258,94	(80.505,42)	621.827,46
FARM SYN AGRO FIDC	3.987.556,54	120,94	109,50	0,00%	(431.630,55)	-	25,14
FIDC CELG DIST SN B	3.817.938,66	61.363,55	(12.103,54)	-0,01%	(18,50)	1.149,72	(380.372,91)
FIDC CREZ MZ4	636.927,21	1.762,73	(620,15)	0,00%	306.542,15	-	(23.469,38)
FIDC VERDECARD SN4	8.209.888,70	171,73	5,19	0,00%	17.842,46	-	(31.141,15)
FII VIA PQ SHOPPING	1.556.213,34	-	-	0,00%	22.992,16	-	-
FUNDSMITH EQ FUND	9.929.670,65	494.794,19	(212.985,46)	-0,11%	-	(89.367,04)	690.274,99
GLOBAL DOL FICFIA IE	4.472.638,81	233.405,74	(83.545,50)	-0,04%	(479.142,20)	-	-
JANUS H GL FICFIA IE	3.869.531,00	172.279,44	(46.321,20)	-0,02%	-	-	-
LOOMIS US GROWTH	7.555.308,34	354.031,10	(176.314,97)	-0,09%	-	(67.997,78)	525.217,86
MFS MERIDIAN EUROPEA	5.687.122,40	413.692,80	(368.080,39)	-0,20%	(364.570,71)	(51.184,10)	395.348,30
PICTET GL FIC FIM IE	3.780.388,53	187.187,71	(119.884,47)	-0,06%	(274.424,04)	-	-
SANEAGOIFR IV 1 FIDC	3.430.899,02	40.129,62	(1.662,15)	0,00%	-	-	-
WELLINGTON EM RESEAR	3.127.815,95	119.635,44	9.300,32	0,01%	-	(28.150,34)	217.434,52
WELLINGTON GLO QUAL	10.076.078,36	615.214,66	(455.480,06)	-0,25%	(150.928,33)	(90.684,71)	700.452,73
Total	3.920.149.988,87	248.609.320,33	185.797.295,72	100,00%	343.232.531,24	(71.821.017,79)	(506.087.073,41)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/08/2021

EMBRAERPREV RENDA FIXA CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	1.953.998.541,72	VAR / PL:	5,461%
VAR:	106.704.283,15	ETL / PL:	6,8481%
ETL:	133.811.521,78	VAR / CDI:	27400,46%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(204.730.963,03)	BAIXA 1:	216.117.170,05	Cenário 1:	170.158.446,23
				Cenário 2:	(61.464.410,85)
				Cenário 3:	(297.791.550,90)

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lambda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	6.000,00	5,40	4,32	0,00%	(54,89)	(0,21)	75,40
RECEBER	(98.767,95)	88,88	(71,04)	0,00%	903,53	3,54	(1.241,20)
COMPROMISSADA	119.410.239,86	108.969,24	87.963,76	0,08%	(1.088.550,53)	(6.270,40)	1.494.679,49
CMTR33	5.219.598,87	35.658,40	19.952,18	0,02%	(50.145,35)	693,89	70.982,79
17H0164854	8.335.164,98	154.810,14	148.337,40	0,14%	75.768,77	(54.762,93)	(200.147,21)
AEGP23	11.755.948,96	236.272,69	225.279,50	0,21%	123.699,14	(83.971,98)	(328.639,51)
DE252 CCR IPCA - CCRDD1	4.956.540,52	81.609,99	77.041,12	0,07%	28.108,20	(26.572,50)	(91.032,03)
CMDT33	2.512.949,76	34.412,06	31.915,16	0,03%	3.543,32	(9.666,57)	(25.574,21)
GASP17	39.534.341,16	841.813,02	777.610,90	0,73%	986.159,84	(36.975,01)	(2.171.933,76)
CSMGC3	12.843.967,87	207.254,15	195.643,55	0,18%	68.002,86	(67.336,35)	(223.425,11)
GEPA24	13.784.709,11	145.709,71	129.142,15	0,12%	(35.804,43)	(33.312,24)	(24.455,63)
ERDV17	10.262.839,51	200.418,85	190.952,97	0,18%	100.920,80	(70.963,96)	(272.048,33)
ERDV36	3.304.360,35	54.406,66	51.360,75	0,05%	18.738,80	(17.715,00)	(60.688,02)
DE252 ECPT - IPCA ECPT11	2.975.148,19	24.310,92	16.401,50	0,02%	(21.605,12)	(2.146,48)	25.098,41
DE252 ECPT - IPCA ECPT21	447.409,53	3.415,03	2.378,38	0,00%	(3.688,40)	(163,99)	4.723,54
DE252 ECPT - IPCA ECPT31	593.305,16	5.021,80	3.830,05	0,00%	(3.772,60)	(625,85)	3.788,69
DE252 ECPT - IPCA ECPT41	3.031.489,73	25.934,41	19.752,98	0,02%	(23.068,27)	(1.809,45)	27.803,99
SULM23	1.095.707,55	8.454,55	6.133,19	0,01%	(8.460,08)	(617,38)	10.349,23
DE252 PETR IPCA - PETR45	13.737.849,50	218.740,39	205.308,43	0,19%	67.023,07	(69.789,48)	(234.967,18)
RDCO34	8.219.156,72	60.860,59	55.241,46	0,05%	(26.312,11)	(21.255,38)	11.028,35
SBESC7	10.018.233,09	86.134,56	65.758,94	0,06%	(61.532,09)	(11.314,55)	59.821,89
SBSPC2	13.861.997,79	242.643,05	229.635,08	0,22%	95.260,19	(80.078,70)	(288.566,77)
TAEE33	15.359.979,24	193.855,87	178.107,93	0,17%	(5.263,73)	(49.453,96)	(99.528,43)
ELET42	11.844.196,20	357.555,16	348.289,40	0,33%	310.370,21	(145.412,87)	(668.312,25)
ENMI21	1.003.344,99	21.473,69	20.643,12	0,02%	12.754,52	(7.903,53)	(31.542,04)
ENTV12	26.663.986,12	813.226,67	796.983,92	0,75%	759.006,27	(364.192,83)	(1.542.269,37)
IGSN15	2.261.355,34	75.144,97	73.609,38	0,07%	75.906,84	(33.764,74)	(149.718,17)
ENJG21	1.660.986,98	34.178,67	32.807,00	0,03%	19.228,51	(12.412,18)	(48.558,20)
NEOE16	5.854.759,22	184.312,85	179.152,99	0,17%	160.693,99	(72.672,87)	(352.318,50)
ECCR32	6.910.654,54	60.269,92	47.423,92	0,04%	(47.890,07)	(5.837,85)	53.015,99
LFS0120016V	5.021.345,67	44.206,19	34.310,45	0,03%	(27.930,70)	(6.753,89)	23.255,87
LFS012001GU	792.162,05	7.894,53	6.837,47	0,01%	(3.122,30)	(1.531,92)	861,26
LFS012001GZ	3.960.810,24	39.472,66	34.187,36	0,03%	(15.611,51)	(7.659,59)	4.306,31
LFS012001H2	9.505.944,58	94.734,38	82.049,66	0,08%	(37.467,63)	(18.383,03)	10.335,16
LFS012001H4	7.129.458,44	71.050,78	61.537,24	0,06%	(28.100,72)	(13.787,27)	7.751,37
LFS012001H6	5.545.134,34	55.261,72	47.862,30	0,04%	(21.856,12)	(10.723,43)	6.028,84
LFS012001IP	7.934.007,86	79.996,42	69.745,52	0,07%	(30.029,60)	(15.793,75)	5.919,13
LFSN16000GM	11.787.253,50	278.781,01	266.428,10	0,25%	163.869,57	(98.137,93)	(432.223,00)
LFSN1800DC5	3.814.017,00	101.750,02	97.687,14	0,09%	68.288,87	(37.142,70)	(171.048,79)
NTNB	1.729.220.181,86	101.796.673,30	101.787.047,51	95,39%	168.560.465,18	(59.968.195,49)	(292.193.138,91)
Total	2.142.077.768,40	107.086.783,31	106.704.283,15	100,00%	170.158.446,23	(61.464.410,85)	(297.791.550,90)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/08/2021

EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	798.137.013,67	VAR / PL:	7,166%
VAR:	57.196.632,78	ETL / PL:	8,9868%
ETL:	71.726.909,61	VAR / CDI:	35957,82%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(1.518,62)	BAIXA 1:	1.719,02	Cenário 1:	116.448.621,65
				Cenário 2:	354.521,42
				Cenário 3:	(94.236.467,11)

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lambda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	26.003,97	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	97.622,66	-	-	0,00%	-	-	-
ABEV3	26.277.655,51	2.629.629,58	1.594.218,37	2,79%	1.479.002,75	5.610,29	(1.884.317,54)
ALSO3	1.458.310,00	226.459,87	203.239,68	0,36%	392.429,96	1.355,51	(403.413,46)
AMER3	2.884.363,68	971.912,67	851.043,18	1,49%	-	-	-
ASAI3	9.270.462,85	429.441,12	182.459,81	0,32%	-	-	-
AZUL4	675.367,00	109.000,14	88.902,55	0,16%	192.884,40	661,81	(195.328,27)
B3SA3	30.987.838,36	4.224.606,64	3.472.366,86	6,07%	12.186.995,46	40.094,42	(11.242.876,11)
UNT	21.427.636,33	3.164.024,78	2.877.802,24	5,03%	4.368.674,33	15.506,26	(4.775.511,22)
BBAS3	16.417.106,73	1.951.450,20	1.768.869,68	3,09%	2.721.264,55	9.819,42	(3.088.566,05)
BBDC3	1.359.708,60	125.691,37	109.856,64	0,19%	209.874,73	761,12	(240.955,94)
BBDC4	38.602.185,16	4.040.118,31	3.510.854,44	6,14%	6.190.392,43	22.390,39	(7.064.127,07)
BBRK3	22.145,00	6.310,72	3.305,22	0,01%	7.414,61	24,95	(7.188,21)
BBSE3	1.015.898,00	91.809,83	79.413,13	0,14%	207.993,90	737,99	(227.174,54)
BEEF3	110.352,00	9.561,68	7.410,00	0,01%	30.939,51	106,38	(31.480,22)
BIDI11	4.734.182,44	1.266.912,81	926.723,73	1,62%	2.447.329,55	7.697,28	(2.046.834,92)
BIDI4	5.838,70	1.598,67	1.201,62	0,00%	3.251,04	10,08	(2.639,16)
BKBR3	161.336,00	37.141,79	34.456,85	0,06%	94.174,53	289,45	(74.960,67)
BMGB4	143.448,00	18.606,26	17.462,58	0,03%	46.362,93	156,71	(45.405,12)
BPAN4	2.233.440,00	623.500,54	599.121,30	1,05%	1.049.948,74	3.357,78	(910.423,52)
BRAP4	4.494.827,55	981.978,55	660.277,18	1,15%	1.662.370,06	5.518,02	(1.563.986,67)
BRDT3	4.695.794,57	778.523,03	718.152,09	1,26%	911.693,56	3.249,49	(1.006.075,28)
BRFS3	1.037.506,00	210.878,13	194.393,11	0,34%	264.723,25	919,64	(275.652,26)
BRKM5	956.855,00	124.968,68	68.220,61	0,12%	99.549,96	369,29	(120.414,96)
BRML3	5.288.229,87	700.635,75	594.780,07	1,04%	1.260.783,51	4.410,39	(1.333.512,73)
CCRO3	6.077.225,00	824.787,79	760.952,94	1,33%	1.800.207,13	6.150,35	(1.805.675,30)
CESP6	10.067.433,12	372.456,28	56.868,50	0,10%	912.292,48	3.405,26	(1.119.446,70)
CIEL3	3.243.961,00	548.338,13	480.818,91	0,84%	1.257.884,65	4.147,00	(1.165.777,19)
CLSA3	1.267.590,00	187.328,53	(147.466,30)	-0,26%	-	-	-
CMIG4	796.941,39	94.528,16	2.424,99	0,00%	(11.907,33)	(46,77)	16.470,86
COGN3	323.568,00	70.639,25	63.954,53	0,11%	193.950,89	592,98	(152.643,76)
CPFE3	8.560.992,00	1.203.093,25	(422.514,66)	-0,74%	(320.914,53)	(1.275,09)	456.214,68
CPLE6	212.724,00	21.323,59	(14.878,24)	-0,03%	(37.054,07)	(158,67)	63.185,66
CRFB3	1.361.903,40	102.894,48	74.528,81	0,13%	277.945,61	986,46	(303.768,99)
CSAN3	1.406.790,00	319.682,86	274.195,10	0,48%	525.651,71	1.742,29	(492.954,15)
CSED3	4.244.720,00	1.079.472,00	980.619,77	1,71%	-	-	-
CSNA3	11.057.592,00	2.130.253,29	974.812,17	1,70%	3.442.310,51	11.689,98	(3.406.700,98)
CVCB3	261.867,00	75.111,90	58.570,45	0,10%	203.160,20	586,93	(141.868,82)
CYRE COM-CPP ON	178.356,00	26.577,23	24.091,36	0,04%	80.579,04	259,41	(70.888,34)
CYRE3	985.340,82	139.747,96	106.357,28	0,19%	431.638,56	1.396,59	(383.913,15)
ECOR3	177.300,00	30.160,55	28.657,99	0,05%	93.285,74	292,46	(77.479,42)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/08/2021

EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	798.137.013,67	VAR / PL:	7,166%
VAR:	57.196.632,78	ETL / PL:	8,9868%
ETL:	71.726.909,61	VAR / CDI:	35957,82%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(1.518,62)	BAIXA 1:	1.719,02	Cenário 1:	116.448.621,65
				Cenário 2:	354.521,42
				Cenário 3:	(94.236.467,11)

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lambda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
EGIE3	521.945,00	26.342,64	4.646,80	0,01%	29.664,22	112,50	(37.770,44)
ELET3	3.176.160,15	555.281,94	544.431,35	0,95%	953.870,45	3.253,52	(953.266,01)
ELET6	7.874.327,37	1.242.541,91	1.209.853,56	2,12%	2.059.218,61	7.134,97	(2.131.668,57)
ENBR3	234.188,00	17.496,13	(6.358,39)	-0,01%	(3.081,49)	(12,09)	4.253,39
ENEV3	1.067.127,00	124.675,34	116.454,87	0,20%	185.097,20	665,66	(208.471,69)
ENGI11	812.148,48	67.967,93	21.536,82	0,04%	48.861,05	185,00	(61.983,57)
EQL3	12.399.189,11	541.349,97	18.724,05	0,03%	(16.456,84)	(64,20)	22.398,25
ESPA3	2.247.895,65	395.801,66	344.637,00	0,60%	-	-	-
EUCATEX PN	75.240,00	8.761,64	(4.483,90)	-0,01%	(2.101,19)	(8,31)	2.952,39
EZTC3	139.360,00	16.497,92	9.502,70	0,02%	43.782,62	148,52	(43.220,24)
FLRY3	392.756,00	27.199,46	7.909,35	0,01%	42.522,15	157,44	(51.204,58)
GGBR4	1.537.776,00	148.454,96	(33.720,14)	-0,06%	49.578,03	190,25	(64.899,03)
GGPS3	2.184.224,90	438.467,69	319.546,42	0,56%	-	-	-
GMAT3	3.805.494,90	221.843,29	74.958,51	0,13%	303.259,95	1.137,73	(376.545,68)
GNDI3	12.719.413,28	832.831,74	216.715,03	0,38%	513.074,75	1.961,16	(665.480,57)
GOAU4	488.754,00	42.471,37	4.126,57	0,01%	34.621,75	130,43	(43.406,11)
GOLL4	193.132,96	26.944,23	19.743,58	0,03%	79.840,71	260,70	(72.445,45)
HAPV3	20.602.509,45	1.643.785,02	74.692,44	0,13%	224.499,45	870,53	(301.198,52)
HBSA3	380.334,84	87.950,17	71.184,18	0,12%	345.514,17	959,52	(222.300,99)
HGTX3	483.990,00	73.907,70	68.832,96	0,12%	9.016,14	34,83	(11.988,33)
HYPE3	6.638.073,40	507.949,33	127.950,45	0,22%	(192.714,21)	(762,40)	271.147,22
IFCM3	4.440.000,00	1.071.024,61	214.383,46	0,37%	-	-	-
IGTA3	441.051,00	78.849,91	66.151,18	0,12%	151.015,54	506,61	(145.446,87)
INTB3	6.216.390,00	771.117,38	423.656,77	0,74%	-	-	-
IRBR3	364.722,00	36.270,88	16.771,36	0,03%	58.370,39	211,15	(66.630,69)
ITSA4	8.494.288,00	566.660,10	341.640,47	0,60%	(275.029,32)	(1.089,92)	388.545,77
ITUB4	55.351.567,20	4.830.515,29	1.253.229,08	2,19%	(3.931.712,76)	(15.897,75)	5.828.991,03
JBSS3	17.367.924,01	1.895.964,95	(1.285.487,73)	-2,25%	(2.655.337,13)	(11.231,18)	4.392.563,96
JHSF3	104.438,00	16.746,04	12.446,24	0,02%	21.829,87	77,31	(23.744,48)
KLBN11	1.323.393,00	133.397,25	(23.451,96)	-0,04%	121.984,70	455,00	(149.433,34)
LAME4	3.440.708,00	2.851.849,08	1.280.606,50	2,24%	14.960.850,03	22.565,94	(3.088.265,38)
LCAM3	1.352.881,88	245.183,02	219.736,79	0,38%	485.646,55	1.618,78	(461.137,63)
LREN3	14.394.177,82	1.759.526,31	1.679.748,92	2,94%	3.965.944,75	13.663,19	(4.053.081,42)
LWSA3	6.509.442,00	736.570,53	505.510,61	0,88%	1.204.562,06	4.310,21	(1.341.187,95)
MATD3	1.362.770,70	144.873,14	(1.676,56)	0,00%	-	-	-
MDNE3	152.250,00	24.591,56	19.802,60	0,03%	52.624,01	176,32	(50.542,02)
MGLU3	16.594.752,01	3.422.968,23	2.900.517,52	5,07%	7.075.561,05	22.992,17	(6.352.784,56)
MOVI3	9.477.550,00	2.318.603,15	1.832.378,23	3,20%	2.440.085,71	8.468,72	(2.535.403,63)
MRFG3	413.898,00	24.496,87	(14.377,47)	-0,03%	(25.207,33)	(101,38)	36.894,42
MRVE3	574.021,70	80.200,36	69.005,96	0,12%	314.115,74	977,59	(256.811,98)
MULT3	7.266.164,80	882.120,95	703.083,52	1,23%	1.597.497,22	5.631,90	(1.719.633,45)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/08/2021

EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	798.137.013,67	VAR / PL:	7,166%
VAR:	57.196.632,78	ETL / PL:	8,9868%
ETL:	71.726.909,61	VAR / CDI:	35957,82%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(1.518,62)	BAIXA 1:	1.719,02	Cenário 1:	116.448.621,65
				Cenário 2:	354.521,42
				Cenário 3:	(94.236.467,11)

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
NTCO3	24.691.136,51	4.545.222,52	4.128.474,20	7,22%	7.426.712,82	25.326,83	(7.418.942,03)
OMGE3	1.616.171,52	149.580,65	135.440,54	0,24%	421.313,74	1.460,30	(436.468,55)
PACUCAR_CBD ON ED	240.805,00	41.890,59	36.189,12	0,06%	128.430,50	401,63	(106.094,24)
PARD3	683.136,00	130.350,64	(27.686,01)	-0,05%	(77.824,70)	(322,05)	122.034,68
PETR3	31.011.804,97	3.393.547,15	952.044,93	1,66%	(3.525.938,88)	(14.589,24)	5.527.248,07
PETR4	43.968.595,55	4.559.726,17	486.663,97	0,85%	(5.159.469,45)	(21.391,28)	8.127.692,24
PETZ3	3.905.800,00	699.527,44	(407.358,34)	-0,71%	(1.013.204,05)	(4.570,23)	1.968.290,37
POWE3	108.750,00	-	-	0,00%	-	-	-
PRI03	10.712.502,73	1.331.601,96	492.694,46	0,86%	1.497.616,59	5.466,41	(1.745.111,24)
QUAL3	562.031,00	146.218,53	136.522,21	0,24%	428.007,80	1.241,98	(301.644,79)
RADL3	11.279.628,00	725.518,98	234.945,83	0,41%	411.631,59	1.576,33	(536.235,55)
RAIL3	13.178.636,65	1.844.092,83	1.250.132,93	2,19%	3.457.886,12	11.976,91	(3.576.659,15)
RAPT4	5.094.964,00	968.478,73	746.352,10	1,30%	2.228.033,14	7.210,93	(1.982.891,83)
RECV3	398.212,00	92.251,48	78.119,52	0,14%	-	-	-
RENT3	5.388.881,82	1.037.527,37	902.227,98	1,58%	2.508.363,23	8.035,27	(2.182.961,26)
SANB11	901.710,00	75.061,24	37.183,14	0,07%	1.083,28	4,22	(1.469,99)
SBSP3	672.018,00	55.371,94	(15.632,76)	-0,03%	61.732,02	230,29	(75.648,38)
SEER3	371.240,98	110.216,05	101.817,68	0,18%	177.896,75	567,06	(153.164,61)
SOMA3	533.583,00	91.387,42	80.845,94	0,14%	11.548,50	44,55	(15.302,12)
STBP3	8.204.475,00	2.024.596,41	1.913.502,18	3,35%	3.280.586,94	10.766,25	(3.010.027,23)
SULA11	2.845.864,05	325.877,33	240.276,86	0,42%	818.253,51	2.805,33	(827.182,28)
SUZB3	18.170.436,01	2.815.633,26	(1.722.493,59)	-3,01%	(64.971,65)	(253,75)	88.663,75
TAAE11	454.920,00	28.527,20	(8.492,41)	-0,01%	(36.453,49)	(148,11)	54.678,53
TCSA3	64.602,00	15.186,70	14.511,10	0,03%	48.637,75	141,51	(34.471,22)
TEND3	1.405.920,00	217.586,12	195.339,00	0,34%	744.249,33	2.330,64	(616.646,76)
TIMS3	5.345.340,00	444.759,83	(124.270,77)	-0,22%	(146.540,03)	(579,25)	205.775,59
TOTS3	14.113.440,00	1.647.287,01	1.047.224,06	1,83%	554.672,86	2.121,23	(720.279,81)
UGPA3	8.200.461,56	1.263.257,02	1.088.995,82	1,90%	4.281.374,30	13.441,41	(3.566.840,13)
USIM5	517.720,00	85.283,15	5.452,74	0,01%	53.481,49	198,46	(64.741,50)
VALE3	86.342.236,99	13.060.266,04	9.905.044,05	17,32%	23.349.957,83	80.610,41	(23.974.145,83)
VIIA3	868.604,00	37.938,72	(18.978,21)	-0,03%	-	-	-
VIVT3	1.067.012,00	88.991,91	(39.969,52)	-0,07%	(79.607,39)	(322,50)	118.563,11
WEGE3	11.364.976,00	576.910,62	(67.864,16)	-0,12%	(530.274,07)	(2.116,94)	762.426,41
WEST3	118.300,00	-	-	0,00%	-	-	-
YDUQ3	427.353,00	91.739,85	83.294,87	0,15%	242.716,48	750,02	(195.427,31)
INDV21	-	44.824,85	44.745,41	0,08%	-	-	-
COMPROMISSADA	25.800.622,65	680,33	352,12	0,00%	825,38	(430,43)	(1.279,93)
EMP AÇÃO PROVISÃO	(104.796,64)	20,54	(10,93)	0,00%	(59,51)	31,01	92,16
LFT	296.397,67	103,03	(87,53)	0,00%	0,01	0,00	(0,01)
Total	799.048.340,39	101.658.249,65	57.196.632,78	100,00%	116.448.621,65	354.521,42	(94.236.467,11)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/08/2021

FI RF EMB II CNPJ - 11005764000196

Dados Gerais

PL:	1.754.239.900,15	VAR / PL:	6,387%
VAR:	112.038.678,38	ETL / PL:	8,0092%
ETL:	140.501.070,90	VAR / CDI:	32046,40%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(200.300.654,11)	BAIXA 1:	212.626.942,97	Cenário 1:	119.220.908,11
				Cenário 2:	(60.865.402,22)
				Cenário 3:	(223.328.361,07)

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lambda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	5.000,00	30,59	23,87	0,00%	(172,82)	(0,69)	244,81
RECEBER	(58.281,10)	356,59	(278,27)	0,00%	2.014,45	7,99	(2.853,53)
COMPROMISSADA	101.608.035,66	623.084,87	486.906,04	0,43%	(3.508.776,36)	(15.628,57)	4.969.833,02
GASP17	32.757.024,76	806.433,23	767.240,91	0,68%	(15.462,20)	(33.954,75)	(607.422,40)
CSMGC3	12.843.967,50	262.565,68	248.080,49	0,22%	(258.444,71)	(68.637,45)	244.026,35
DE252 PETR IPCA - PETR45	13.737.849,11	277.594,55	261.325,60	0,23%	(282.143,77)	(71.181,13)	265.016,77
SBESC7	9.790.545,71	130.277,77	105.462,52	0,09%	(308.974,18)	(12.049,19)	414.785,60
SBSPC2	7.847.773,36	170.769,02	161.970,12	0,14%	(145.532,04)	(46.130,40)	122.248,83
ELET42	11.844.195,87	403.645,34	394.674,70	0,35%	9.333,23	(146.612,70)	(237.247,10)
ENTV12	11.519.993,86	396.725,33	389.678,98	0,35%	35.126,58	(158.514,02)	(247.061,07)
IGSN15	2.261.355,28	84.014,33	82.492,34	0,07%	18.431,30	(33.993,82)	(67.416,98)
NEOE16	5.854.759,05	206.875,28	201.967,33	0,18%	11.887,01	(73.265,96)	(139.236,70)
LFS0120016V	5.021.345,53	68.346,56	55.545,80	0,05%	(155.555,29)	(7.262,56)	206.005,89
LFS012001GU	792.162,03	11.663,62	10.157,58	0,01%	(23.256,22)	(1.612,17)	29.691,71
LFS012001GZ	3.960.810,13	58.318,09	50.787,89	0,05%	(116.281,09)	(8.060,83)	148.458,54
LFS012001H2	9.505.944,31	139.963,41	121.890,93	0,11%	(279.074,63)	(19.345,99)	356.300,49
LFS012001H4	7.129.458,23	104.972,56	91.418,20	0,08%	(209.305,97)	(14.509,49)	267.225,37
LFS012001H6	5.545.134,18	81.645,32	71.103,04	0,06%	(162.793,53)	(11.285,16)	207.841,95
NTNB	1.729.220.132,92	108.543.291,24	108.538.230,29	96,88%	124.609.888,34	(60.143.365,34)	(229.258.802,61)
Total	1.971.187.206,38	112.370.573,38	112.038.678,38	100,00%	119.220.908,11	(60.865.402,22)	(223.328.361,07)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/08/2021

FI RF EMB V CREDITO PRIVADO CNPJ - 20726178000121

Dados Gerais

PL:	199.758.641,57	VAR / PL:	1,197%
VAR:	2.391.967,36	ETL / PL:	1,5016%
ETL:	2.999.624,60	VAR / CDI:	6008,28%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(5.380.164,30)	BAIXA 1:	2.732.847,05	Cenário 1:	2.400.340,80
				Cenário 2:	(792.567,17)
				Cenário 3:	(4.870.096,06)

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	1.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	(40.486,85)	-	-	0,00%	-	-	-
COMPROMISSADA	17.802.201,31	469,42	326,00	0,01%	569,51	(296,99)	(883,14)
CMTR33	5.219.598,86	32.748,50	21.612,27	0,90%	(2.396,21)	880,90	5.389,20
17H0164854	8.335.164,98	149.312,21	149.177,10	6,24%	152.019,25	(54.464,30)	(304.893,47)
AEGP23	11.755.948,95	228.696,10	228.113,08	9,54%	231.243,12	(83.550,78)	(476.374,04)
CCRDD1	4.956.540,52	78.358,54	78.195,42	3,27%	73.450,87	(26.394,91)	(153.319,83)
CMDT33	2.512.949,76	32.722,13	32.530,37	1,36%	26.531,90	(9.576,54)	(57.153,92)
100 - GASP17	6.777.315,47	140.747,53	128.491,78	5,37%	231.055,17	(6.095,75)	(457.500,58)
GEPA24	13.784.709,11	136.186,62	132.623,72	5,54%	90.298,74	(32.818,36)	(197.685,16)
ERDV17	10.262.839,51	193.785,15	193.333,34	8,08%	194.805,74	(70.596,25)	(401.019,27)
ERDV36	3.304.360,34	52.239,03	52.130,28	2,18%	48.967,24	(17.596,61)	(102.213,22)
ECPT11	2.975.148,19	22.462,19	17.431,22	0,73%	5.611,68	(2.039,88)	(12.289,65)
ECPT21	447.409,53	3.124,13	2.515,39	0,11%	404,52	(147,96)	(898,96)
ECPT31	593.305,16	4.619,89	4.019,97	0,17%	1.654,99	(604,60)	(3.667,25)
ECPT41	3.031.489,73	23.730,17	19.911,23	0,83%	4.663,95	(1.700,84)	(10.292,10)
SULM23	1.095.707,55	7.721,73	6.429,70	0,27%	1.563,50	(578,12)	(3.420,29)
RDCO34	8.219.156,72	55.080,89	54.110,37	2,26%	48.877,13	(20.960,90)	(92.260,06)
SBESC7	227.687,11	1.805,45	1.561,33	0,07%	684,44	(248,99)	(1.501,71)
SBSPC2	6.014.224,21	101.356,82	101.139,26	4,23%	96.348,39	(34.527,80)	(200.778,27)
TAE33	15.359.979,23	183.139,69	181.013,84	7,57%	135.250,09	(48.903,63)	(292.554,05)
ENMI21	1.003.344,99	20.822,10	20.767,78	0,87%	21.933,16	(7.867,58)	(44.150,87)
ENTV12	15.143.991,93	451.905,55	445.620,36	18,63%	569.620,72	(206.303,20)	(1.066.253,70)
ENJG21	1.660.986,98	33.095,25	33.033,13	1,38%	34.423,30	(12.352,67)	(69.431,47)
ECCR32	6.910.654,54	55.243,95	48.063,73	2,01%	15.328,92	(5.590,25)	(33.828,74)
LFS012001IP	7.934.007,86	74.366,00	71.351,94	2,98%	42.551,08	(15.509,49)	(93.785,87)
LFSN16000GM	11.787.253,50	271.285,20	269.926,59	11,28%	271.699,93	(97.715,61)	(580.350,92)
D - LFSN1800DC5	3.814.017,00	99.353,57	98.538,19	4,12%	103.179,68	(37.006,05)	(218.978,73)
Total	170.890.506,17	2.454.377,81	2.391.967,36	100,00%	2.400.340,80	(792.567,17)	(4.870.096,06)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/08/2021

FIM EMB I A CNPJ - 20725946000122

Dados Gerais

PL:	149.271.846,38	VAR / PL:	0,635%
VAR:	947.371,70	ETL / PL:	0,7959%
ETL:	1.188.042,74	VAR / CDI:	3184,51%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(154.170,16)	BAIXA 1:	145.919,45	Cenário 1:	2.281.789,55
				Cenário 2:	(50.706,58)
				Cenário 3:	(1.647.982,62)

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lambda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	9.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	(22.034,25)	-	-	0,00%	-	-	-
AMER3	431.012,56	145.233,62	138.099,78	14,58%	-	-	-
B3SA3	194.166,00	26.470,87	22.748,55	2,40%	76.362,22	251,23	(70.446,48)
BRIT3	186.528,00	-	-	0,00%	-	-	-
CASH3	142.380,00	105.854,80	75.318,35	7,95%	121.622,87	-	(80.855,64)
CBAV3	138.510,00	11.548,93	(107,64)	-0,01%	-	-	-
CSAN3	414.540,00	94.201,22	81.249,03	8,58%	154.894,23	513,40	(145.259,22)
CURY3	51.090,00	8.215,50	7.841,80	0,83%	25.132,54	79,75	(21.425,94)
ENEV3	235.050,00	27.461,53	24.670,08	2,60%	40.770,31	146,62	(45.918,88)
ENJU3	21.636,00	5.358,64	4.423,91	0,47%	28.042,11	-	(14.643,53)
EQTL3	323.215,00	14.111,60	(555,69)	-0,06%	(428,99)	(1,67)	583,86
GNDI3	103.922,00	6.804,52	1.684,62	0,18%	4.192,00	16,02	(5.437,21)
HAPV3	513.728,00	40.988,13	1.656,60	0,17%	5.597,94	21,71	(7.510,45)
LAME4	147.664,96	122.392,89	64.379,82	6,80%	642.075,21	968,46	(132.539,17)
LJQQ3	144.905,00	31.182,61	29.874,08	3,15%	46.610,61	157,64	(45.709,39)
LREN3	540.452,00	66.064,18	60.205,43	6,35%	148.907,62	513,01	(152.179,30)
MGLU3	549.516,48	113.347,73	105.062,72	11,09%	234.299,22	761,36	(210.365,29)
MRVE3	162.911,00	22.761,37	20.541,38	2,17%	89.148,04	277,45	(72.884,87)
MULT3	113.940,00	13.832,45	9.438,95	1,00%	25.050,19	88,31	(26.965,40)
NTCO3	831.082,00	152.988,20	147.787,59	15,60%	249.976,64	852,48	(249.715,08)
PETZ3	272.744,00	48.848,36	(28.201,09)	-2,98%	(70.752,55)	(319,14)	137.446,72
RADL3	199.368,00	12.823,58	2.986,60	0,32%	7.275,61	27,86	(9.477,99)
RDOR3	220.224,00	22.901,51	(16.184,57)	-1,71%	(31.134,69)	-	-
RENT3	349.398,00	67.269,98	62.842,91	6,63%	162.634,31	520,98	(141.536,28)
SMFT3	78.300,00	18.340,15	8.117,17	0,86%	-	-	-
STBP3	17.314,00	4.272,53	4.010,07	0,42%	6.923,06	22,72	(6.352,10)
SUZB3	225.700,00	34.973,76	(18.378,01)	-1,94%	(807,03)	(3,15)	1.101,32
UGPA3	242.592,00	37.370,59	32.155,68	3,39%	126.654,72	397,63	(105.516,85)
VALE3	256.568,00	38.808,89	29.929,04	3,16%	69.384,95	239,54	(71.239,74)
DI1F22	-	3.139,20	2.885,57	0,30%	8.256,33	(4.286,59)	(12.708,81)
DI1N22	-	3.973,32	(3.194,21)	-0,34%	(10.519,20)	5.426,41	16.018,96
DI1F23	-	12.610,84	(10.894,98)	-1,15%	(28.124,79)	14.422,14	42.405,60
DI1F27	-	3.418,37	3.198,86	0,34%	4.997,76	(2.440,31)	(6.948,16)
COMPROMISSADA	122.934.301,96	3.241,64	2.058,69	0,22%	3.932,76	(2.050,90)	(6.098,58)
DE252 AERIS CDI - AER11	1.259.392,33	1.050,83	951,67	0,10%	1.931,91	(978,98)	(2.856,27)
DE252 B3SA CDI - BSA313	1.696.643,46	242,13	197,17	0,02%	573,98	(293,51)	(861,51)
DE252 BCBF CDI - BCBF14	275.030,82	165,06	147,99	0,02%	316,34	(160,64)	(469,33)
ETEN13	2.982.856,41	64.911,25	60.440,54	6,38%	102.812,86	(49.885,57)	(141.569,09)
IVIA35	1.327.667,42	433,16	382,47	0,04%	857,11	(435,69)	(1.273,80)
LAMEA1	369.307,46	42,52	27,80	0,00%	131,36	(68,17)	(202,09)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/08/2021

FIM EMB I A CNPJ - 20725946000122

Dados Gerais

PL:	149.271.846,38	VAR / PL:	0,635%
VAR:	947.371,70	ETL / PL:	0,7959%
ETL:	1.188.042,74	VAR / CDI:	3184,51%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(154.170,16)	BAIXA 1:	145.919,45	Cenário 1:	2.281.789,55
				Cenário 2:	(50.706,58)
				Cenário 3:	(1.647.982,62)

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lambda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
LORTA1	608.154,24	116,72	(109,54)	-0,01%	(266,25)	138,46	410,92
DE252 MOV_PART CDI -	1.421.433,18	46,49	(40,65)	0,00%	0,02	-	(0,03)
NATU27	635.568,40	20,79	(18,18)	0,00%	0,01	(0,00)	(0,01)
OMGE13	1.124.314,04	2.059,67	1.912,41	0,20%	3.283,37	(1.627,01)	(4.678,66)
CBAN22	1.100.907,49	1.175,94	1.080,69	0,11%	1.986,30	(997,62)	(2.893,79)
SULM15	1.321.632,73	353,06	(314,03)	-0,03%	(803,24)	415,23	1.227,48
VIVT15	2.145.031,81	9.582,00	7.574,53	0,80%	18.411,91	(9.717,02)	(29.071,83)
VAMO22	1.090.973,89	918,56	837,16	0,09%	1.618,05	(816,51)	(2.375,74)
LF selic	3.334.450,32	1.678,33	(1.563,10)	-0,16%	(2.532,52)	1.321,82	3.932,80
LF0021006S0	999.223,69	32,68	(28,58)	0,00%	0,02	-	(0,02)
LFT	439.267,92	14,27	(12,37)	0,00%	0,01	0,00	(0,01)
NTNB	940.200,41	12.056,70	10.254,63	1,08%	12.494,31	(4.204,31)	(23.123,74)
Total	153.101.780,74	1.415.711,66	947.371,70	100,00%	2.281.789,55	(50.706,58)	(1.647.982,62)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/08/2021

FIM EMB II A CNPJ - 20725957000102

Dados Gerais

PL:	142.147.541,03	VAR / PL:	1,434%
VAR:	2.038.243,18	ETL / PL:	1,7982%
ETL:	2.556.040,05	VAR / CDI:	7194,77%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(3.975.049,34)	BAIXA 1:	4.115.362,67	Cenário 1:	2.880.119,07
				Cenário 2:	(1.080.592,63)
				Cenário 3:	(4.212.393,47)

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	Var Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	9.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	(24.703,71)	-	-	0,00%	-	-	-
WSPU21	3.029.725,16	176.341,29	(94.198,19)	-4,62%	(141.946,10)	(27.267,53)	204.138,42
INDV21	-	475.143,40	415.284,99	20,37%	-	-	-
DI1V21	-	439,63	233,10	0,01%	1.262,24	(657,65)	(1.954,39)
DI1F22	-	1.962,00	1.833,87	0,09%	5.160,21	(2.679,12)	(7.943,00)
DI1J22	-	1.911,89	1.767,63	0,09%	5.201,01	(2.691,17)	(7.960,67)
DI1N22	-	1.444,84	1.338,92	0,07%	3.825,16	(1.973,24)	(5.825,08)
DI1V22	-	2.559,68	2.406,53	0,12%	6.343,81	(3.262,59)	(9.611,77)
DI1F23	-	12.610,84	12.072,61	0,59%	28.124,79	(14.422,14)	(42.405,60)
DI1N23	-	11.192,67	10.980,26	0,54%	21.325,62	(10.870,42)	(31.835,69)
DI1F24	-	30.156,65	29.788,29	1,46%	50.761,94	(25.717,52)	(75.013,37)
DI1N24	-	12.108,60	11.978,65	0,59%	18.934,18	(9.535,67)	(27.704,69)
DI1F25	-	100.190,79	99.111,38	4,86%	152.013,55	(76.076,14)	(220.114,56)
DI1F27	-	126.479,52	124.199,19	6,09%	184.917,00	(90.291,50)	(257.082,00)
DI1F29	-	122.933,87	119.976,95	5,89%	180.332,30	(85.868,67)	(240.572,96)
DI1F31	-	15.889,35	15.489,40	0,76%	24.824,69	(11.522,57)	(31.763,70)
COMPROMISSADA	35.969.079,37	948,46	673,50	0,03%	1.150,68	(600,07)	(1.784,37)
AEGP13	1.052.459,60	46,53	32,23	0,00%	143,42	(73,81)	(217,61)
CPGT14	291.500,94	607,20	(593,56)	-0,03%	(1.242,19)	639,13	1.883,53
CPGT16	290.754,24	437,43	(432,44)	-0,02%	(718,02)	365,41	1.069,06
ERDV18	1.847.106,15	33.470,84	32.711,01	1,60%	49.334,18	(23.717,91)	(66.860,54)
ESUL18	984.110,65	400,06	(379,12)	-0,02%	(962,98)	500,85	1.486,65
LORTA1	537.202,92	103,10	(96,11)	0,00%	(235,19)	122,31	362,98
NATU27	1.127.621,36	36,88	(26,01)	0,00%	0,02	(0,00)	(0,03)
VIVT15	2.898.691,63	12.948,65	11.696,68	0,57%	24.880,97	(13.131,11)	(39.286,26)
LF selic	3.684.869,21	3.099,15	(3.062,85)	-0,15%	(4.642,67)	2.422,12	7.204,48
LFSN14000H2	2.283.405,36	174,91	(125,23)	-0,01%	(322,19)	167,99	499,38
LFT	34.001.588,71	13.519,29	(9.283,47)	-0,46%	0,59	(0,00)	(0,80)
NTNB	60.389.063,01	1.406.947,38	1.403.355,97	68,85%	2.000.339,37	(682.039,07)	(3.803.414,45)
IBOV J124	(55.039,30)	93.742,55	(81.795,97)	-4,01%	(367.898,90)	(1.307,69)	54.972,57
IBOV V113	59.643,96	76.464,72	(66.715,53)	-3,27%	(56.530,76)	(1.104,68)	387.340,91
IDIFQG0	(43,50)	68,83	(64,90)	0,00%	(90.229,79)	32,78	43,18
IDIFQG1	43,50	69,74	65,77	0,00%	96.973,24	(32,98)	(43,17)
IDIFQG7	60,00	104,61	98,64	0,00%	211.555,16	(47,19)	(59,51)
IDIFQG8	(120,00)	212,32	(200,21)	-0,01%	(458.770,71)	94,95	119,00
IDIFQG9	60,00	107,76	101,62	0,00%	249.049,34	(47,77)	(59,49)
IDIFQHM	(70,00)	385,15	(363,17)	-0,02%	(13.926.198,28)	67,90	68,20
IDIFQHN	70,00	405,92	382,77	0,02%	14.613.363,39	(67,89)	(68,11)
Total	148.376.079,26	2.735.666,51	2.038.243,18	100,00%	2.880.119,07	(1.080.592,63)	(4.212.393,47)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/08/2021

FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A CNPJ - 34081188000161

Dados Gerais

PL:	198.629.818,62	VAR / PL:	5,585%
VAR:	11.094.096,20	ETL / PL:	7,0042%
ETL:	13.912.448,98	VAR / CDI:	28025,14%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(18.901.688,04)	BAIXA 1:	26.078.985,31	Cenário 1:	18.754.867,15
				Cenário 2:	(5.925.679,46)
				Cenário 3:	(23.220.134,95)

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	500,00	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	2.670.197,28	-	-	0,00%	-	-	-
AMER3	5.211,36	1.756,02	1.521,31	0,01%	-	-	-
ANIM3	256.649,34	67.480,50	60.062,18	0,54%	159.612,73	484,34	(123.623,77)
UNT	13.677,84	2.019,68	1.880,07	0,02%	2.788,64	9,90	(3.048,34)
CEAB3	9.138,92	2.728,85	2.454,64	0,02%	7.893,61	22,21	(5.217,26)
COGN3	415.675,74	90.747,61	74.517,59	0,67%	249.161,48	761,78	(196.095,74)
GNDI3	1.556.351,86	101.905,58	4.093,38	0,04%	62.780,01	239,97	(81.428,43)
LAME3	19.363,14	16.812,95	5.231,68	0,05%	86.677,57	128,79	(17.442,56)
LREN3	20.856,88	2.549,52	2.265,71	0,02%	5.746,58	19,80	(5.872,84)
MGLU3	955.101,12	197.006,91	187.965,86	1,69%	407.229,72	1.323,30	(365.630,75)
OIBR3	880.610,73	211.539,73	100.173,01	0,90%	702.241,01	2.015,42	(483.664,35)
ONCO3	302.940,00	53.395,32	44.535,39	0,40%	-	-	-
SUZB3	1.246.108,00	193.092,95	(113.156,11)	-1,02%	(4.455,68)	(17,40)	6.080,46
YDUQ3	416.400,48	89.388,67	77.064,89	0,69%	236.495,96	730,80	(190.418,76)
INDV21	-	779.952,37	726.246,80	6,55%	-	-	-
WINV21	-	1.116.172,55	1.014.385,25	9,14%	-	-	-
DI1V21	-	145.025,35	(76.973,20)	-0,69%	(416.389,36)	216.945,63	644.717,87
DI1F22	-	1.177,20	1.088,83	0,01%	3.096,12	(1.607,47)	(4.765,80)
DI1F23	-	15.413,24	14.165,97	0,13%	34.374,75	(17.627,06)	(51.829,07)
DI1F24	-	111.103,46	-	0,00%	(187.017,69)	94.748,74	276.365,06
DI1F25	-	4.770,99	4.709,05	0,04%	7.238,74	(3.622,67)	(10.481,65)
DI1F27	-	2.440.712,96	2.421.191,08	21,82%	3.568.398,26	(1.742.381,92)	(4.960.987,79)
DI1F29	-	1.693.314,90	1.675.746,91	15,10%	2.483.931,95	(1.182.771,65)	(3.313.698,55)
COMPROMISSADA	14.243.421,16	375,58	242,17	0,00%	455,66	(237,62)	(706,59)
LTN	5.707.675,10	111.103,46	-	0,00%	187.017,69	(94.748,74)	(276.365,06)
LFT	92.473.910,06	41.841,35	4.348,42	0,04%	1,59	-	(2,16)
NTNB	78.211.237,31	5.225.912,03	5.196.054,60	46,84%	9.962.860,13	(3.196.757,50)	(16.516.742,90)
IBOVU115	149.600,84	361.195,11	(335.843,83)	-3,03%	-	(3.339,75)	2.460.722,43
IDIFQFP	70,30	108,38	104,62	0,00%	(149.424,91)	(52,34)	(69,79)
IDIFQFZ	(70,30)	109,78	(105,98)	0,00%	126.691,72	52,66	69,78
IDIFQGO	(70,30)	111,23	(107,38)	0,00%	(135.840,45)	52,98	69,78
IDIFQGI	70,30	112,71	108,81	0,00%	(145.819,64)	(53,30)	(69,77)
IDIFQHK	468,64	2.340,71	2.259,69	0,02%	156.717,68	(454,12)	(457,70)
IDIFQHL	(468,64)	2.453,57	(2.368,64)	-0,02%	84.034.034,75	454,42	457,18
IDIFQHM	(474,65)	2.611,57	(2.521,17)	-0,02%	(88.633.598,65)	460,38	462,46
IDIFQHN	407,08	2.360,62	2.278,91	0,02%	(94.429.571,62)	(394,79)	(396,07)
IDIFQHP	67,06	411,18	396,95	0,00%	84.982.970,99	(65,00)	(65,14)
IDIFQHV	(74,43)	645,14	(622,81)	-0,01%	14.657.909,86	71,43	71,44
IDIFQHW	74,43	704,91	680,51	0,01%	(19.922.123,58)	(71,17)	(71,17)
IDIVPDX	232,63	1.012,91	903,26	0,01%	20.652.780,93	(163,15)	(203,17)
IDIVPDY	(465,26)	2.226,56	(1.985,53)	-0,02%	44.331.081,51	334,30	400,90
IDIVPDZ	232,63	1.237,26	1.103,32	0,01%	(93.296.629,25)	(170,67)	(197,14)
Total	199.554.626,65	13.094.941,41	11.094.096,20	100,00%	18.754.867,15	(5.925.679,46)	(23.220.134,95)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/08/2021

FIM EMB III A IMOBILIÁRIO CNPJ - 32711990000162

Dados Gerais

PL:	87.549.847,26	VAR / PL:	1,472%
VAR:	1.289.158,60	ETL / PL:	1,8466%
ETL:	1.616.657,45	VAR / CDI:	7388,41%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(7,40)	BAIXA 1:	7,47	Cenário 1:	13.319.066,43
				Cenário 2:	45.938,23
				Cenário 3:	(16.280.778,46)

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	Var Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	1.000,00	43,00	23,49	0,00%	81,86	0,31	(101,41)
RECEBER	(41.965,65)	1.804,40	(985,94)	-0,08%	(3.435,40)	(12,88)	4.255,55
BLCP11	1.526.877,30	65.651,38	35.872,46	2,78%	124.993,61	468,46	(154.833,76)
BLCP12	11.350,96	488,06	266,68	0,02%	929,22	3,48	(1.151,05)
BMLC11	1.740.481,50	74.835,75	40.890,88	3,17%	142.479,72	533,99	(176.494,41)
BPML11	1.334.158,40	47.306,13	(1.100,13)	-0,09%	220.298,30	825,38	(272.682,60)
BTLG11	951.232,99	17.871,94	4.283,72	0,33%	135.511,06	510,05	(169.546,68)
CBOP11	34.189,08	1.300,94	270,86	0,02%	5.404,62	20,28	(6.714,77)
CEOC11	531.482,63	18.670,08	7.264,82	0,56%	87.841,47	329,10	(108.719,85)
CJCT11	2.346.271,35	124.757,43	68.909,31	5,35%	192.071,04	719,86	(237.924,83)
CNES11	590.822,76	29.174,92	12.091,50	0,94%	88.606,54	333,06	(110.514,48)
HBRH11	1.373.149,33	59.041,52	32.260,78	2,50%	112.409,09	421,29	(139.244,90)
HSML11	7.508.582,90	335.711,72	(100.681,91)	-7,81%	1.962.427,86	7.137,90	(2.270.289,94)
JRDM11	851.865,00	64.171,21	26.818,08	2,08%	66.367,44	248,20	(81.785,40)
LVBI11	3.981.151,99	139.520,43	56.534,06	4,39%	653.173,95	2.447,81	(808.958,02)
MALL11	7.759.661,95	170.281,46	(55.962,40)	-4,34%	1.343.836,68	5.024,87	(1.655.734,39)
MAXR11	1.503.426,50	763.122,99	429.260,02	33,30%	86.196,40	315,71	(100.852,26)
NEWU11	600.237,00	25.808,48	14.101,97	1,09%	49.136,75	184,16	(60.867,34)
PATC11	8.003.153,39	220.664,37	55.010,39	4,27%	1.455.193,43	5.428,82	(1.783.487,21)
PVBI11	2.890.876,00	72.071,63	15.664,89	1,22%	345.887,28	886,94	(435.241,76)
QAGR11	8.360.212,10	158.919,92	44.345,71	3,44%	1.322.975,41	2.564,98	(1.643.542,55)
RBGS11	641.490,72	30.040,04	(5.792,39)	-0,45%	125.779,41	467,34	(152.724,55)
RBRL11	2.061.591,30	78.694,48	35.174,70	2,73%	168.766,49	632,51	(209.056,71)
RCRB11	1.660.548,00	113.776,01	11.868,73	0,92%	278.999,36	1.044,58	(344.784,18)
RNGO11	152.870,40	9.185,97	(4.319,80)	-0,34%	41.169,15	149,33	(47.331,70)
SDIL11	374.088,91	5.705,40	385,30	0,03%	71.726,90	266,84	(87.346,40)
SDIL12	9.316,34	400,58	218,88	0,02%	762,66	2,86	(944,73)
TEPP11	7.835.972,08	645.575,11	77.978,81	6,05%	1.639.225,94	6.066,45	(1.972.324,24)
TRXF11	13.504.786,75	518.100,64	271.504,93	21,06%	1.412.201,18	5.325,66	(1.775.307,44)
VISC11	5.100,00	301,79	(22,70)	0,00%	1.091,23	4,03	(1.308,49)
VISC13	78,92	3,39	1,85	0,00%	6,46	0,02	(8,00)
VVPR11	1.086.602,50	46.720,82	25.528,64	1,98%	88.951,72	333,38	(110.187,48)
XPIN11	1.986.641,64	61.664,98	39.958,22	3,10%	331.741,49	609,52	(410.200,41)
XPIN13	294.229,80	12.651,04	6.912,64	0,54%	24.086,31	90,27	(29.836,52)
XPIN14	2.842.600,00	122.223,72	66.784,06	5,18%	232.701,62	872,13	(288.255,29)
XPPR11	3.658.273,60	157.226,46	34.666,90	2,69%	359.019,83	1.122,39	(450.359,59)
COMPROMISSADA	281.524,15	12.099,66	6.608,92	0,51%	23.055,21	81,68	(28.562,06)
FII VIA PQ SHOPPING	1.556.213,34	66.912,75	36.561,68	2,84%	127.395,12	477,46	(157.808,60)
Total	89.810.145,93	4.272.500,57	1.289.158,60	100,00%	13.319.066,43	45.938,23	(16.280.778,46)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/08/2021

FIA RVA EMB II CNPJ - 13294268000125

Dados Gerais

PL:	561.606.636,56	VAR / PL:	0,645%
VAR:	3.624.812,45	ETL / PL:	0,8094%
ETL:	4.545.662,61	VAR / CDI:	3238,57%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(488,45)	BAIXA 1:	493,34	Cenário 1:	159.999.756,60
				Cenário 2:	485.901,57
				Cenário 3:	(127.856.670,27)

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	10.000,00	700,51	(54,12)	0,00%	1.397,08	4,35	(1.154,99)
RECEBER	(292.354,49)	20.479,77	1.582,23	0,04%	(40.844,13)	(127,11)	33.766,62
ABEV3	22.214.695,50	1.721.131,51	(722.649,54)	-19,94%	4.353.885,08	14.401,15	(4.158.743,29)
ASAI3	8.152.850,00	550.657,33	195.951,34	5,41%	1.139.014,67	3.544,62	(941.645,03)
B3SA3	24.124.830,03	2.223.077,66	1.426.218,13	39,35%	12.858.310,57	41.703,31	(11.539.259,33)
UNT	17.329.032,00	1.580.718,13	718.725,84	19,83%	5.954.045,93	20.074,43	(5.863.551,66)
BBAS3	13.863.908,00	854.146,08	65.789,82	1,81%	4.234.944,35	14.319,92	(4.209.496,14)
BBDC4	33.236.246,65	1.776.782,24	(121.181,16)	-3,34%	9.973.244,72	33.728,14	(9.920.919,64)
BIDI11	1.789.656,00	401.305,93	103.437,70	2,85%	1.175.188,83	3.687,88	(980.465,24)
BPAN4	2.233.440,00	475.874,50	86.464,82	2,39%	1.361.977,17	4.328,81	(1.168.383,33)
BRAP4	3.088.035,00	562.450,76	345.718,91	9,54%	1.573.502,75	5.133,58	(1.431.154,20)
CCRO3	5.328.750,00	417.560,55	122.117,55	3,37%	2.322.959,03	7.709,65	(2.198.751,80)
CESP6	5.979.544,00	442.668,67	(111.848,74)	-3,09%	1.377.242,83	4.622,28	(1.355.525,11)
CIEL3	3.069.752,00	350.876,44	192.788,33	5,32%	1.619.200,55	5.258,94	(1.457.724,88)
CPFE3	6.234.888,00	1.091.025,91	(710.040,66)	-19,59%	637.341,95	1.782,11	(387.865,81)
CSEB3	4.244.720,00	825.487,89	242.767,67	6,70%	593.019,42	1.845,48	(490.260,40)
CSNA3	9.834.006,00	1.725.522,49	1.257.569,75	34,69%	4.435.283,95	14.671,95	(4.165.546,63)
ELET6	5.412.441,00	495.090,84	114.903,64	3,17%	2.171.568,54	7.257,42	(2.090.339,23)
GNDI3	7.314.510,00	595.407,14	(174.904,80)	-4,83%	1.316.944,41	4.307,93	(1.227.513,36)
HAPV3	17.937.792,00	1.835.600,66	(716.891,52)	-19,78%	2.701.507,73	8.556,76	(2.334.036,51)
HYPE3	4.119.006,00	373.691,15	157.520,55	4,35%	455.874,69	1.317,74	(307.490,40)
IFCM3	4.440.000,00	1.068.545,42	601.342,53	16,59%	620.301,51	1.930,38	(512.815,02)
INTB3	6.216.390,00	644.773,33	74.062,89	2,04%	868.476,60	2.702,71	(717.986,07)
ITSA4	3.442.568,00	199.389,97	(52.861,88)	-1,46%	369.488,75	1.055,01	(240.142,78)
ITUB4	47.079.448,78	4.408.645,90	(1.186.993,88)	-32,75%	3.233.223,70	6.946,89	(479.756,93)
JBSS3	15.005.238,00	2.481.347,89	283.586,95	7,82%	(197.767,17)	(3.179,48)	2.061.923,14
LAME4	3.164.164,00	2.527.871,87	(797.514,95)	-22,00%	14.200.441,92	22.127,90	(3.205.506,05)
LREN3	10.972.698,00	665.727,34	289.324,81	7,98%	4.556.212,88	15.186,07	(4.357.002,84)
LWSA3	5.938.825,00	497.846,65	28.412,80	0,78%	1.928.668,94	6.514,40	(1.909.547,17)
MGLU3	13.824.096,00	2.132.900,31	863.078,93	23,81%	7.825.557,53	25.163,72	(6.888.792,68)
MOVI3	9.477.550,00	1.871.443,63	1.312.979,36	36,22%	3.764.170,97	12.589,28	(3.630.050,02)
MULT3	5.604.160,00	446.459,35	250.944,52	6,92%	2.015.041,85	6.780,23	(1.973.572,35)
NTCO3	13.978.696,00	1.750.241,47	177.655,62	4,90%	6.157.505,36	20.416,12	(5.814.700,36)
PETR3	23.235.024,00	2.517.763,95	(1.491.940,22)	-41,16%	604.363,40	(828,81)	1.457.569,67
PETR4	32.675.827,21	3.764.780,92	(2.150.642,52)	-59,33%	730.733,58	(1.690,70)	2.266.177,63
PETZ3	3.905.800,00	880.766,91	(367.738,11)	-10,15%	(467.534,31)	(2.872,10)	1.517.174,85
PRIO3	5.637.897,00	653.275,69	(451.257,87)	-12,45%	1.575.839,34	5.328,12	(1.569.607,64)
RADL3	9.779.256,00	770.424,67	28.028,74	0,77%	1.723.113,83	5.618,39	(1.594.400,69)
RAIL3	5.524.272,00	600.090,07	316.932,34	8,74%	2.221.272,60	7.422,32	(2.137.325,07)
RAPT4	5.094.964,00	746.020,98	451.688,97	12,46%	2.939.838,06	9.426,07	(2.571.354,45)
STBP3	8.204.475,00	1.509.259,72	673.610,70	18,58%	4.426.814,01	14.333,32	(3.957.634,89)
SUZB3	12.858.800,00	2.622.073,38	(1.395.047,02)	-38,49%	1.750.492,46	5.411,06	(1.422.431,67)
TIMS3	4.642.596,00	560.221,00	(296.375,64)	-8,18%	521.331,07	1.515,36	(357.492,05)
TOTS3	13.071.960,00	1.171.646,30	(514.745,53)	-14,20%	2.339.993,07	7.648,00	(2.176.924,56)
UGPA3	5.338.468,00	548.146,24	301.953,77	8,33%	3.532.981,98	11.071,32	(2.938.585,86)
VALE3	71.088.578,60	7.867.377,66	4.381.495,38	120,88%	29.156.446,53	97.276,60	(27.949.402,44)
WEGE3	8.495.284,00	772.092,11	(78.652,18)	-2,17%	790.477,08	2.111,09	(411.284,42)
COMPROMISSADA	18.582.149,13	1.301.458,43	(100.501,79)	-2,77%	2.596.660,93	7.768,97	(2.147.139,20)
Total	562.504.932,41	63.300.847,33	3.624.812,45	100,00%	159.999.756,60	485.901,57	(127.856.670,27)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/08/2021

FIA RVA EMB III CNPJ - 38452593000108

Dados Gerais

PL:	58.769.064,60	VAR / PL:	2,327%
VAR:	1.367.446,52	ETL / PL:	2,9179%
ETL:	1.714.833,70	VAR / CDI:	11675,13%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(84,89)	BAIXA 1:	85,74	Cenário 1:	18.541.513,64
				Cenário 2:	59.612,12
				Cenário 3:	(16.401.440,19)

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	1.000,00	70,05	(40,64)	0,00%	139,71	0,43	(115,50)
RECEBER	(480.861,98)	33.684,93	19.541,17	1,43%	(67.180,05)	(209,06)	55.539,02
ALSO3	1.458.310,00	143.861,55	27.919,23	2,04%	596.166,87	1.989,54	(571.846,63)
AMER3	1.985.280,00	552.573,91	475.372,16	34,76%	277.358,60	863,14	(229.297,61)
ASAI3	714.172,85	48.236,45	(22.460,49)	-1,64%	99.775,34	310,50	(82.486,16)
B3SA3	2.177.698,32	200.672,60	109.744,69	8,03%	1.160.693,00	3.764,47	(1.041.624,98)
BBAS3	426.141,72	26.254,31	2.779,30	0,20%	130.171,56	440,16	(129.389,34)
BBRK3	22.145,00	5.686,50	3.493,24	0,26%	10.508,43	34,58	(9.745,93)
BBSE3	316.396,00	14.047,00	(2.297,46)	-0,17%	108.981,50	367,40	(107.295,68)
BKBR3	161.336,00	27.235,66	23.081,68	1,69%	116.714,39	359,60	(93.594,80)
BMGB4	143.448,00	9.966,09	5.112,60	0,37%	66.403,70	219,08	(61.973,20)
BRAP4	636.362,55	115.906,26	37.524,23	2,74%	324.257,41	1.057,89	(294.923,13)
BRDT3	2.259.380,24	241.773,20	139.676,63	10,21%	754.313,57	2.545,80	(745.028,72)
BRML3	2.660.391,51	221.609,93	13.397,89	0,98%	1.005.949,08	3.375,43	(978.133,00)
CESP6	1.434.012,32	106.160,66	(28.209,49)	-2,06%	330.289,93	1.108,51	(325.081,60)
CPFE3	2.029.896,00	355.205,92	(114.785,58)	-8,39%	207.499,78	580,20	(126.277,69)
CRFB3	973.493,40	50.714,65	1.042,61	0,08%	334.680,88	1.128,37	(329.572,55)
CYRE COM-CPP ON	178.356,00	16.492,61	9.373,52	0,69%	105.496,72	336,96	(91.488,26)
CYRE3	675.974,82	66.533,85	45.225,80	3,31%	390.556,43	1.252,00	(341.450,84)
ELET3	587.028,00	63.199,76	38.028,89	2,78%	258.309,61	856,55	(243.986,73)
ELET6	1.367.274,00	125.068,31	69.506,64	5,08%	548.574,89	1.833,35	(528.054,99)
ENGI11	208.716,48	18.223,48	(4.025,07)	-0,29%	41.716,22	138,29	(40.035,86)
EQTL3	2.628.985,00	209.373,90	(93.834,03)	-6,86%	363.799,72	1.129,39	(298.895,74)
ESPA3	350.295,00	42.702,84	37.015,90	2,71%	48.938,86	152,30	(40.458,68)
EUCATEX PN	75.240,00	12.114,94	(7.621,29)	-0,56%	8.410,40	24,40	(5.737,74)
GMAT3	730.988,99	53.971,94	(10.743,15)	-0,79%	160.377,20	536,36	(156.758,22)
GNDI3	487.634,00	39.693,81	(10.907,83)	-0,80%	87.796,29	287,20	(81.834,22)
HAPV3	751.897,60	76.942,79	(18.751,35)	-1,37%	113.238,97	358,67	(97.835,70)
HBSA3	380.334,84	69.283,78	62.681,13	4,58%	398.649,81	1.124,88	(266.229,24)
HGTX3	227.103,00	21.223,42	14.003,59	1,02%	35.958,65	115,08	(31.855,44)
HYPE3	1.722.299,40	156.253,24	(106.210,44)	-7,77%	190.617,03	550,99	(128.572,41)
IGTA3	280.358,00	36.085,76	11.577,08	0,85%	135.162,50	443,93	(124.835,63)
ITSA4	2.211.428,00	128.083,62	(102.647,80)	-7,51%	237.351,24	677,71	(154.262,30)
ITUB4	249.376,40	23.352,28	(18.763,10)	-1,37%	17.126,15	36,80	(2.541,24)
LREN3	1.583.181,82	96.053,62	49.320,05	3,61%	657.387,40	2.191,10	(628.644,63)
MDNE3	152.250,00	17.265,07	9.341,06	0,68%	73.894,49	242,51	(68.126,72)
MULT3	600.506,00	47.839,73	(627,32)	-0,05%	215.919,02	726,53	(211.475,41)
NTCO3	2.649.396,50	331.725,05	272.390,97	19,92%	1.167.038,27	3.869,49	(1.102.066,09)
OMGE3	844.970,58	37.718,19	20.564,51	1,50%	338.321,00	1.130,85	(325.788,66)
PARD3	683.136,00	146.243,12	(21.931,05)	-1,60%	17.614,55	(25,05)	43.133,24



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/08/2021

FIA RVA EMB III CNPJ - 38452593000108

Dados Gerais

PL:	58.769.064,60	VAR / PL:	2,327%
VAR:	1.367.446,52	ETL / PL:	2,9179%
ETL:	1.714.833,70	VAR / CDI:	11675,13%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(84,89)	BAIXA 1:	85,74	Cenário 1:	18.541.513,64
				Cenário 2:	59.612,12
				Cenário 3:	(16.401.440,19)

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
PETR3	2.270.956,96	246.082,53	(117.391,75)	-8,58%	59.069,59	(81,01)	142.460,71
POWE3	108.750,00	7.618,06	(4.419,36)	-0,32%	15.193,20	47,28	(12.560,50)
PRI03	711.475,38	82.440,24	17.889,35	1,31%	198.863,32	672,38	(198.076,91)
QUAL3	232.933,00	46.266,31	33.303,68	2,44%	209.929,76	616,01	(151.919,78)
RAIL3	1.765.670,40	191.801,07	38.371,79	2,81%	709.964,19	2.372,33	(683.132,84)
RECV3	398.212,00	70.436,36	49.250,85	3,60%	55.633,22	173,13	(45.993,04)
RENT3	3.591.977,82	498.405,68	373.887,67	27,34%	2.173.784,59	6.917,63	(1.869.929,79)
SEER3	371.240,98	87.016,03	50.429,82	3,69%	229.761,91	728,47	(196.042,52)
SOMA3	533.583,00	62.078,62	38.217,36	2,79%	86.094,07	276,53	(76.930,36)
SULA11	2.390.939,05	183.730,24	80.486,39	5,89%	1.021.483,99	3.396,40	(971.104,01)
SUZB3	2.902.136,00	591.782,56	(161.565,20)	-11,82%	395.073,19	1.221,24	(321.032,30)
TCSA3	64.602,00	10.996,71	7.498,48	0,55%	57.663,14	169,60	(41.932,68)
TEND3	1.405.920,00	138.285,52	122.455,59	8,96%	940.666,96	2.941,90	(779.028,94)
TIMS3	154.504,00	18.643,96	(7.746,52)	-0,57%	17.349,72	50,43	(11.897,21)
VALE3	2.020.670,36	223.627,72	47.975,73	3,51%	828.762,77	2.765,06	(794.452,92)
WEST3	118.300,00	8.287,05	(4.807,45)	-0,35%	16.527,40	51,43	(13.663,52)
YDUQ3	7.677,00	1.182,97	936,17	0,07%	5.432,71	16,81	(4.397,36)
COMPROMISSADA	3.229.442,53	226.184,02	(131.184,57)	-9,59%	451.280,81	1.350,19	(373.157,20)
Total	58.824.322,84	6.683.970,43	1.367.446,52	100,00%	18.541.513,64	59.612,12	(16.401.440,19)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/08/2021

FIA RVA EMB IV CNPJ - 38452613000132

Dados Gerais

PL:	59.962.221,01	VAR / PL:	7,332%
VAR:	4.396.442,04	ETL / PL:	9,1947%
ETL:	5.513.317,58	VAR / CDI:	36789,51%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(59,19)	BAIXA 1:	59,78	Cenário 1:	8.288.016,65
				Cenário 2:	27.763,29
				Cenário 3:	(7.971.960,97)

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	1.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	843.445,53	-	-	0,00%	-	-	-
UNT	2.417.134,32	356.916,31	326.876,94	7,44%	492.806,23	1.749,18	(538.699,27)
BIDI11	1.941.234,44	519.493,03	433.290,83	9,86%	1.003.518,66	3.156,24	(839.297,28)
BIDI4	5.838,70	1.598,67	1.353,96	0,03%	3.251,04	10,08	(2.639,16)
BRDT3	709.849,33	117.687,02	106.681,20	2,43%	137.818,01	491,22	(152.085,41)
BRML3	2.213.361,36	293.247,48	224.830,31	5,11%	527.694,44	1.845,94	(558.134,88)
CESP6	2.653.876,80	98.183,23	30.754,44	0,70%	240.489,49	897,66	(295.097,43)
CLSA3	1.267.590,00	187.328,53	(158.218,28)	-3,60%	-	-	-
ELET3	1.851.584,15	323.708,88	307.517,42	6,99%	556.071,27	1.896,68	(555.718,90)
ELET6	592.271,37	93.458,40	87.514,50	1,99%	154.885,13	536,66	(160.334,49)
EQTL3	8.362.819,10	365.121,61	33.376,32	0,76%	(11.099,57)	(43,30)	15.106,83
ESPA3	1.897.600,65	334.122,93	307.337,80	6,99%	-	-	-
GGPS3	2.184.224,90	438.467,69	323.779,13	7,36%	-	-	-
GMAT3	3.074.505,91	179.229,91	77.450,34	1,76%	245.007,42	919,19	(304.215,86)
GNDI3	2.335.207,28	152.902,87	38.622,57	0,88%	94.197,42	360,06	(122.178,20)
HAPV3	897.139,84	71.578,90	4.597,60	0,10%	9.775,87	37,91	(13.115,74)
LCAM3	911.797,88	165.245,29	150.967,77	3,43%	327.309,80	1.091,01	(310.791,59)
MATD3	1.362.770,70	144.873,14	5.730,27	0,13%	-	-	-
MRVE3	354.981,70	49.596,83	46.093,02	1,05%	194.252,83	604,55	(158.815,52)
MULT3	778.758,80	94.542,23	67.615,04	1,54%	171.213,43	603,60	(184.303,51)
NTCO3	5.683.362,00	1.046.211,26	990.679,16	22,53%	1.709.467,58	5.829,68	(1.707.678,91)
OMGE3	771.200,94	71.376,55	64.785,05	1,47%	201.041,50	696,82	(208.273,04)
PETR4	4.489.830,32	465.614,07	14.118,76	0,32%	(526.856,55)	(2.184,36)	829.955,08
PRI03	3.513.899,34	436.790,11	211.756,91	4,82%	491.245,98	1.793,08	(572.428,81)
RAIL3	4.647.558,24	650.335,01	441.345,06	10,04%	1.219.452,94	4.223,76	(1.261.339,25)
UGPA3	2.004.257,56	308.749,99	257.550,27	5,86%	1.046.401,69	3.285,19	(871.763,89)
COMPROMISSADA	2.251.684,04	59,37	35,63	0,00%	72,03	(37,56)	(111,70)
Total	60.018.785,20	6.966.439,31	4.396.442,04	100,00%	8.288.016,65	27.763,29	(7.971.960,97)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/08/2021

FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES RVA EMB V CNPJ - 41300472000147

Dados Gerais

PL:	98.928.439,50	VAR / PL:	6,958%
VAR:	6.883.310,20	ETL / PL:	8,7255%
ETL:	8.631.951,65	VAR / CDI:	34912,14%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	14,83	BAIXA 1:	(15,57)	Cenário 1:	13.857.530,48
				Cenário 2:	43.363,10
				Cenário 3:	(11.618.928,57)

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	5.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	22.292,08	-	-	0,00%	-	-	-
ABEV3	3.425.130,00	342.755,96	215.753,34	3,13%	192.778,87	731,27	(245.609,15)
AMER3	758.459,68	255.569,91	221.076,03	3,21%	-	-	-
ASAI3	336.200,00	15.573,99	6.117,12	0,09%	-	-	-
AZUL4	569.723,00	91.949,84	76.397,11	1,11%	162.712,54	558,28	(164.774,13)
B3SA3	3.948.042,00	538.240,98	426.696,35	6,20%	1.552.698,49	5.108,28	(1.432.411,86)
UNT	1.429.956,00	211.148,64	188.626,87	2,74%	291.539,95	1.034,80	(318.689,88)
BBAS3	1.792.327,00	213.048,31	195.105,50	2,83%	297.092,30	1.072,03	(337.192,20)
BBDC3	1.146.350,60	105.968,57	94.288,92	1,37%	176.942,34	641,69	(203.146,46)
BBDC4	4.520.963,50	473.165,63	418.966,96	6,09%	724.998,81	2.622,29	(827.327,79)
BBSE3	588.954,00	53.225,58	46.527,52	0,68%	120.581,83	427,84	(131.701,57)
BEEF3	92.796,00	8.040,50	6.149,79	0,09%	26.017,32	89,46	(26.472,01)
BIDI11	847.375,00	226.765,71	159.509,99	2,32%	438.049,42	1.377,74	(366.364,58)
BRAP4	650.445,00	142.101,79	91.923,99	1,34%	240.561,02	798,51	(226.323,99)
BRDT3	1.454.665,00	241.171,16	218.815,47	3,18%	282.424,77	1.006,63	(311.662,38)
BRFS3	873.566,00	177.556,53	164.715,12	2,39%	222.893,39	774,32	(232.095,47)
BRKM5	805.078,00	105.146,06	57.235,84	0,83%	83.759,28	310,71	(101.314,66)
BRML3	349.461,00	46.299,97	39.004,24	0,57%	83.316,10	291,45	(88.122,25)
CCRO3	630.875,00	85.620,99	77.618,92	1,13%	186.878,99	638,47	(187.446,64)
CIEL3	146.944,00	24.838,46	21.541,50	0,31%	56.979,29	187,85	(52.807,04)
CMIG4	671.298,39	79.625,18	4.826,86	0,07%	(10.030,06)	(39,40)	13.874,12
COGN3	272.850,00	59.566,83	53.792,55	0,78%	163.549,86	500,03	(128.717,45)
CPFE3	249.744,00	35.097,02	(11.108,37)	-0,16%	(9.361,82)	(37,20)	13.308,84
CPLB6	179.208,00	17.963,92	(12.036,06)	-0,17%	(31.215,97)	(133,67)	53.230,37
CRFB3	326.700,00	24.682,83	18.228,00	0,26%	66.674,94	236,64	(72.869,58)
CSAN3	1.186.290,00	269.575,83	226.350,43	3,29%	443.261,16	1.469,21	(415.688,61)
CSNA3	1.031.856,00	198.787,82	85.430,38	1,24%	321.224,44	1.090,87	(317.901,48)
CVCB3	221.416,00	63.509,25	49.258,04	0,72%	171.777,73	496,27	(119.954,12)
CYRE3	260.838,00	36.993,88	28.312,10	0,41%	114.262,74	369,70	(101.628,94)
ECOR3	149.720,00	25.468,91	24.052,68	0,35%	78.774,62	246,96	(65.427,06)
EGIE3	439.335,00	22.173,30	4.485,28	0,07%	24.969,16	94,69	(31.792,39)
ELET3	620.895,00	108.549,87	105.933,20	1,54%	186.468,37	636,02	(186.350,21)
ELET6	423.024,00	66.751,74	64.772,63	0,94%	110.625,18	383,30	(114.517,33)
ENBR3	197.308,00	14.740,83	(4.879,76)	-0,07%	(2.596,21)	(10,19)	3.583,56
ENEV3	899.458,00	105.086,11	96.647,46	1,40%	156.014,38	561,07	(175.716,23)
ENGI11	510.255,00	42.702,75	15.024,75	0,22%	30.698,32	116,23	(38.942,91)
EQTL3	1.185.970,00	51.779,58	3.336,27	0,05%	(1.574,08)	(6,14)	2.142,37
EZTC3	117.920,00	13.959,78	8.240,70	0,12%	37.046,83	125,67	(36.570,97)
FLRY3	331.240,00	22.939,31	7.126,32	0,10%	35.862,05	132,78	(43.184,58)
GGBR4	1.297.056,00	125.216,16	(29.017,19)	-0,42%	41.817,20	160,47	(54.739,88)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/08/2021

FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES RVA EMB V CNPJ - 41300472000147

Dados Gerais

PL:	98.928.439,50	VAR / PL:	6,958%
VAR:	6.883.310,20	ETL / PL:	8,7255%
ETL:	8.631.951,65	VAR / CDI:	34912,14%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	14,83	BAIXA 1:	(15,57)	Cenário 1:	13.857.530,48
				Cenário 2:	43.363,10
				Cenário 3:	(11.618.928,57)

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
GNDI3	2.174.368,00	142.371,56	38.700,59	0,56%	87.709,50	335,26	(113.763,08)
GOAU4	412.467,00	35.842,24	3.010,69	0,04%	29.217,83	110,07	(36.631,08)
GOLL4	163.192,96	22.767,26	16.970,73	0,25%	67.463,58	220,28	(61.214,76)
HAPV3	856.704,00	68.352,70	4.149,74	0,06%	9.335,25	36,20	(12.524,59)
HGTX3	215.934,00	32.974,21	30.189,46	0,44%	4.022,59	15,54	(5.348,64)
HYPE3	672.273,00	51.442,73	12.669,97	0,18%	(19.517,19)	(77,21)	27.460,52
IGTA3	136.760,00	24.449,59	20.026,72	0,29%	46.826,52	157,09	(45.099,80)
IRBR3	307.584,00	30.588,62	14.336,34	0,21%	49.225,98	178,07	(56.192,20)
ITSA4	2.392.920,00	159.633,43	102.001,12	1,48%	(77.478,32)	(307,04)	109.456,96
ITUB4	6.760.390,00	589.977,28	178.338,35	2,59%	(480.201,61)	(1.941,68)	711.926,59
JBSS3	1.991.763,00	217.430,30	(148.051,86)	-2,15%	(304.515,51)	(1.288,00)	503.741,63
JHSF3	87.913,00	14.096,35	10.147,56	0,15%	18.375,78	65,08	(19.987,44)
KLBN11	1.115.544,00	112.446,19	(18.636,34)	-0,27%	102.826,07	383,54	(125.963,69)
LAME4	233.036,00	193.153,12	87.513,05	1,27%	1.013.284,66	1.528,37	(209.165,38)
LCAM3	371.308,00	67.292,21	59.046,19	0,86%	133.289,13	444,29	(126.562,48)
LREN3	1.549.042,00	189.352,96	179.331,48	2,61%	426.798,60	1.470,38	(436.175,89)
LWSA3	480.004,00	54.314,46	36.517,35	0,53%	88.823,99	317,83	(98.898,73)
MGLU3	2.352.960,00	485.340,63	399.688,16	5,81%	1.003.239,59	3.260,05	(900.757,54)
MRFG3	348.330,00	20.616,18	(11.805,95)	-0,17%	(21.214,09)	(85,32)	31.049,76
MRVE3	184.815,00	25.821,72	22.084,10	0,32%	101.134,33	314,75	(82.684,52)
MULT3	238.430,00	28.945,68	22.818,15	0,33%	52.419,85	184,80	(56.427,59)
NTCO3	2.008.018,00	369.642,31	331.378,88	4,81%	603.980,83	2.059,72	(603.348,86)
PACUCAR_CBD ON ED	203.976,00	35.483,79	30.842,75	0,45%	108.788,18	340,20	(89.868,06)
PETR3	4.640.304,00	507.777,29	163.794,61	2,38%	(527.587,10)	(2.182,99)	827.043,49
PETR4	5.739.809,00	595.242,06	89.824,48	1,30%	(673.534,57)	(2.792,49)	1.061.016,40
PRI03	716.958,00	89.120,41	34.322,17	0,50%	100.231,31	365,85	(116.795,44)
QUAL3	277.810,00	72.275,32	65.996,28	0,96%	211.562,79	613,91	(149.101,99)
RADL3	1.265.220,00	81.380,44	25.983,51	0,38%	46.172,14	176,81	(60.148,79)
RAIL3	1.046.448,00	146.429,96	96.144,47	1,40%	274.573,02	951,03	(284.004,17)
RENT3	1.514.058,00	291.503,26	247.274,86	3,59%	704.748,69	2.257,59	(613.323,89)
SANB11	771.696,00	64.238,46	34.677,72	0,50%	927,09	3,61	(1.258,04)
SBSP3	567.241,00	46.738,68	(12.835,16)	-0,19%	52.107,14	194,39	(63.853,74)
SULA11	384.485,00	44.027,03	32.850,32	0,48%	110.548,57	379,01	(111.754,87)
SUZB3	2.031.300,00	314.763,82	(187.206,63)	-2,72%	(7.263,28)	(28,37)	9.911,85
TAEI11	382.891,00	24.010,39	(6.718,83)	-0,10%	(30.681,69)	(124,66)	46.021,10
TIMS3	462.266,00	38.462,91	(9.499,79)	-0,14%	(12.672,81)	(50,09)	17.795,51
TOTS3	879.120,00	102.608,79	64.937,37	0,94%	34.550,33	132,13	(44.865,91)
UGPA3	723.444,00	111.444,42	94.306,67	1,37%	377.702,47	1.185,80	(314.666,32)
USIM5	436.364,00	71.881,51	3.133,82	0,05%	45.077,25	167,28	(54.567,84)
VALE3	11.160.708,00	1.688.186,69	1.252.810,63	18,20%	3.018.245,42	10.419,80	(3.098.928,76)
VIIA3	761.587,00	33.264,45	(16.597,34)	-0,24%	-	-	-
VIVT3	900.838,00	75.132,52	(30.652,66)	-0,45%	(67.209,51)	(272,28)	100.098,36
WEGE3	2.418.080,00	122.746,94	(13.581,18)	-0,20%	(112.824,27)	(450,41)	162.218,38
YDUQ3	353.142,00	75.808,98	68.435,00	0,99%	200.568,11	619,78	(161.490,83)
COMPROMISSADA	1.269.701,20	33,48	16,75	0,00%	40,62	(21,18)	(62,99)
EMP AÇÃO PROVISÃO	(105.810,57)	20,78	(11,01)	0,00%	(60,28)	31,41	93,33
Total	98.822.375,84	12.312.793,60	6.883.310,20	100,00%	13.857.530,48	43.363,10	(11.618.928,57)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/08/2021

FIA RVA EMB VI CNPJ - 41901871000163

Dados Gerais

PL:	18.870.652,00	VAR / PL:	6,998%
VAR:	1.320.614,99	ETL / PL:	8,7761%
ETL:	1.656.105,04	VAR / CDI:	35114,75%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(900,92)	BAIXA 1:	1.095,74	Cenário 1:	2.566.190,23
				Cenário 2:	8.017,17
				Cenário 3:	(2.150.298,84)

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	9.003,97	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	5.101,52	-	-	0,00%	-	-	-
ABEV3	637.830,00	63.828,24	40.188,79	3,04%	35.899,41	136,18	(45.737,50)
AMER3	140.624,00	47.384,54	40.970,06	3,10%	-	-	-
ASAI3	67.240,00	3.114,80	1.222,87	0,09%	-	-	-
AZUL4	105.644,00	17.050,30	14.168,15	1,07%	30.171,86	103,52	(30.554,14)
B3SA3	737.268,00	100.512,57	79.661,82	6,03%	289.955,10	953,93	(267.492,45)
UNT	251.514,00	37.138,79	33.168,37	2,51%	51.278,77	182,01	(56.054,15)
BBAS3	334.730,00	39.788,31	36.449,53	2,76%	55.484,13	200,21	(62.973,08)
BBDC3	213.358,00	19.722,80	17.556,10	1,33%	32.932,39	119,43	(37.809,48)
BBDC4	844.975,00	88.435,38	78.337,06	5,93%	135.503,39	490,11	(154.628,83)
BBSE3	110.548,00	9.990,56	8.736,30	0,66%	22.633,48	80,31	(24.720,68)
BEEF3	17.556,00	1.521,18	1.163,32	0,09%	4.922,19	16,92	(5.008,22)
BID11	155.917,00	41.724,89	29.326,94	2,22%	80.601,09	253,50	(67.411,08)
BRAP4	119.985,00	26.212,95	16.950,65	1,28%	44.375,33	147,30	(41.749,09)
BRDT3	271.900,00	45.078,72	40.890,78	3,10%	52.789,68	188,15	(58.254,65)
BRFS3	163.940,00	33.321,60	30.919,06	2,34%	41.829,86	145,32	(43.556,79)
BRKM5	151.777,00	19.822,62	10.780,63	0,82%	15.790,68	58,58	(19.100,30)
BRML3	65.016,00	8.613,95	7.258,91	0,55%	15.500,67	54,22	(16.394,84)
CCRO3	117.600,00	15.960,42	14.463,77	1,10%	34.835,70	119,02	(34.941,51)
CIEL3	27.265,00	4.608,70	3.997,58	0,30%	10.572,33	34,85	(9.798,18)
CMIG4	125.643,00	14.902,98	905,92	0,07%	(1.877,27)	(7,37)	2.596,74
COGN3	50.718,00	11.072,42	9.997,77	0,76%	30.401,03	92,95	(23.926,30)
CPFE3	46.464,00	6.529,68	(2.066,46)	-0,16%	(1.741,73)	(6,92)	2.476,06
CPL6	33.516,00	3.359,66	(2.249,21)	-0,17%	(5.838,10)	(25,00)	9.955,30
CRFB3	61.710,00	4.662,31	3.443,01	0,26%	12.594,16	44,70	(13.764,25)
CSAN3	220.500,00	50.107,03	42.069,12	3,19%	82.390,55	273,09	(77.265,54)
CSNA3	191.730,00	36.936,93	15.870,88	1,20%	59.686,97	202,70	(59.069,53)
CVCB3	40.451,00	11.602,65	8.994,47	0,68%	31.382,47	90,66	(21.914,70)
CYRE3	48.528,00	6.882,58	5.264,79	0,40%	21.258,18	68,78	(18.907,71)
ECOR3	27.580,00	4.691,64	4.430,10	0,34%	14.511,11	45,49	(12.052,35)
EGIE3	82.610,00	4.169,34	842,97	0,06%	4.695,06	17,81	(5.978,06)
ELET3	116.653,00	20.394,22	19.901,81	1,51%	35.033,45	119,49	(35.011,25)
ELET6	79.317,00	12.515,95	12.145,11	0,92%	20.742,22	71,87	(21.472,00)
ENBR3	36.880,00	2.755,30	(911,90)	-0,07%	(485,27)	(1,90)	669,82
ENEV3	167.669,00	19.589,22	18.013,92	1,36%	29.082,82	104,59	(32.755,46)
ENGI11	93.177,00	7.797,89	2.744,09	0,21%	5.605,78	21,23	(7.111,31)
EQTL3	221.415,00	9.667,00	623,02	0,05%	(293,87)	(1,15)	399,97
EZTC3	21.440,00	2.538,14	1.498,05	0,11%	6.735,79	22,85	(6.649,27)
FLRY3	61.516,00	4.260,16	1.323,08	0,10%	6.660,10	24,66	(8.019,99)
GGBR4	240.720,00	23.238,81	(5.377,85)	-0,41%	7.760,83	29,78	(10.159,15)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/08/2021

FIA RVA EMB VI CNPJ - 41901871000163

Dados Gerais

PL:	18.870.652,00	VAR / PL:	6,998%
VAR:	1.320.614,99	ETL / PL:	8,7761%
ETL:	1.656.105,04	VAR / CDI:	35114,75%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	(900,92)	BAIXA 1:	1.095,74	Cenário 1:	2.566.190,23
				Cenário 2:	8.017,17
				Cenário 3:	(2.150.298,84)

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
GNDI3	407.694,00	26.694,67	7.249,83	0,55%	16.445,53	62,86	(21.330,58)
GOAU4	76.287,00	6.629,13	558,55	0,04%	5.403,92	20,36	(6.775,03)
GOLL4	29.940,00	4.176,97	3.113,19	0,24%	12.377,12	40,41	(11.230,69)
HAPV3	158.976,00	12.684,01	766,90	0,06%	1.732,31	6,72	(2.324,15)
HGTX3	40.953,00	6.253,73	5.723,96	0,43%	762,90	2,95	(1.014,40)
HYPE3	124.495,00	9.526,43	2.353,03	0,18%	(3.614,29)	(14,30)	5.085,28
IGTA3	23.933,00	4.278,68	3.504,63	0,27%	8.194,64	27,49	(7.892,47)
IRBR3	57.138,00	5.682,26	2.666,20	0,20%	9.144,41	33,08	(10.438,48)
ITSA4	447.372,00	29.844,51	19.093,40	1,45%	(14.485,08)	(57,40)	20.463,69
ITUB4	1.262.352,00	110.165,09	33.407,98	2,53%	(89.666,94)	(362,57)	132.936,41
JBSS3	370.923,00	40.491,71	(27.553,36)	-2,09%	(56.709,46)	(239,86)	93.811,04
JHSF3	16.525,00	2.649,69	1.907,69	0,14%	3.454,09	12,23	(3.757,04)
KLBN11	207.849,00	20.951,06	(3.484,82)	-0,26%	19.158,63	71,46	(23.469,65)
LAME4	43.508,00	36.061,84	16.323,27	1,24%	189.181,02	285,35	(39.051,34)
LCAM3	69.776,00	12.645,52	11.091,57	0,84%	25.047,62	83,49	(23.783,55)
LREN3	289.256,00	35.358,29	33.483,46	2,54%	79.697,04	274,57	(81.448,08)
LWSA3	90.613,00	10.253,24	6.893,82	0,52%	16.767,79	60,00	(18.669,66)
MGLU3	417.696,00	86.157,37	70.913,85	5,37%	178.094,47	578,72	(159.901,92)
MRFG3	65.568,00	3.880,69	(2.222,44)	-0,17%	(3.993,24)	(16,06)	5.844,66
MRVE3	34.225,00	4.781,80	4.087,74	0,31%	18.728,58	58,29	(15.311,95)
MULT3	44.310,00	5.379,29	4.241,90	0,32%	9.741,74	34,34	(10.486,54)
NTCO3	371.664,00	68.417,08	61.307,65	4,64%	111.790,80	381,23	(111.673,83)
PACUCAR_CBD ON ED	36.829,00	6.406,80	5.567,61	0,42%	19.642,31	61,43	(16.226,18)
PETR3	865.520,00	94.711,77	30.589,97	2,32%	(98.406,74)	(407,18)	154.262,02
PETR4	1.063.129,00	110.250,90	16.683,35	1,26%	(124.752,26)	(517,23)	196.521,75
PRI03	132.273,00	16.442,00	6.324,04	0,48%	18.491,87	67,50	(21.547,82)
QUAL3	51.288,00	13.343,14	12.182,11	0,92%	39.057,75	113,34	(27.526,52)
RADL3	235.152,00	15.125,25	4.828,19	0,37%	8.581,49	32,86	(11.179,17)
RAIL3	194.688,00	27.242,78	17.884,14	1,35%	51.083,35	176,93	(52.837,99)
RENT3	282.846,00	54.456,65	46.173,01	3,50%	131.656,35	421,75	(114.576,99)
SANB11	130.014,00	10.822,78	5.815,21	0,44%	156,19	0,61	(211,95)
SBSP3	104.777,00	8.633,26	(2.371,30)	-0,18%	9.624,88	35,91	(11.794,64)
SULA11	70.440,00	8.066,02	6.016,97	0,46%	20.253,17	69,44	(20.474,18)
SUZB3	378.200,00	58.604,68	(34.876,46)	-2,64%	(1.352,32)	(5,28)	1.845,45
TAAE11	72.029,00	4.516,81	(1.260,93)	-0,10%	(5.771,80)	(23,45)	8.657,43
TIMS3	85.974,00	7.153,48	(1.764,99)	-0,13%	(2.356,94)	(9,32)	3.309,68
TOTS3	162.360,00	18.950,27	11.986,50	0,91%	6.380,92	24,40	(8.286,05)
UGPA3	134.292,00	20.687,29	17.504,48	1,33%	70.112,43	220,12	(58.411,11)
USIM5	81.356,00	13.401,64	584,57	0,04%	8.404,23	31,19	(10.173,66)
VALE3	2.072.280,00	313.456,42	232.565,27	17,61%	560.416,92	1.934,71	(575.397,91)
VIIA3	107.017,00	4.674,27	(2.333,79)	-0,18%	-	-	-
VIVT3	166.174,00	13.859,40	(5.647,99)	-0,43%	(12.397,87)	(50,23)	18.464,75
WEGE3	451.612,00	22.924,80	(2.529,25)	-0,19%	(21.071,59)	(84,12)	30.296,67
YDUQ3	66.534,00	14.282,85	12.890,26	0,98%	37.788,19	116,77	(30.425,81)
INDV21	-	44.824,85	44.782,47	3,39%	-	-	-
COMPROMISSADA	467.645,74	12,33	6,16	0,00%	14,96	(7,80)	(23,20)
EMP AÇÃO PROVISÃO	1.013,92	0,26	0,19	0,00%	0,76	(0,40)	(1,18)
LFT	296.397,67	103,03	(86,16)	-0,01%	0,01	0,00	(0,01)
Total	18.877.923,83	2.327.422,00	1.320.614,99	100,00%	2.566.190,23	8.017,17	(2.150.298,84)



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/08/2021

FIM EMB V A INVEST NO EXT CNPJ - 41252756000105

Dados Gerais

PL:	76.050.260,01	VAR / PL:	4,184%
VAR:	3.182.124,34	ETL / PL:	5,2472%
ETL:	3.990.513,67	VAR / CDI:	20995,04%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	7.515.048,31	BAIXA 1:	(6.894.772,40)	Cenário 1:	(2.798.540,27)
				Cenário 2:	(537.593,30)
				Cenário 3:	4.024.693,85

Parâmetros do Cálculo

Modelo:	VaR Parametric	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	95%	Lâmbda:	0,94
Horizonte:	21		

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	37.656,19	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	(29.875,51)	-	-	0,00%	-	-	-
EWJ_US	3.059.397,37	159.468,16	153.005,68	4,81%	(143.336,27)	(27.534,58)	206.137,69
SPY	5.871.740,18	261.906,04	251.943,39	7,92%	(275.097,76)	(52.845,66)	395.629,20
VTV_US	5.933.166,35	309.260,62	296.727,78	9,32%	(277.975,64)	(53.398,50)	399.768,01
LFT	10.851,29	9,05	(2,29)	0,00%	0,00	-	(0,00)
AB AMERICAN GROWTH	8.855.685,52	449.008,81	413.717,11	13,00%	(414.899,02)	(79.701,17)	596.683,04
FUNDSMITH EQ FUND	9.830.473,34	470.847,02	418.257,87	13,14%	(460.568,94)	(88.474,26)	662.362,81
GLOBAL DOL FICFIA IE	4.472.638,81	215.147,53	130.883,35	4,11%	-	-	-
JANUS H GL FICFIA IE	3.869.531,00	161.143,47	130.910,00	4,11%	-	-	-
LOOMIS US GROWTH	7.479.830,88	328.388,56	318.171,85	10,00%	(350.438,65)	(67.318,48)	503.979,98
EUROPEA	5.630.308,10	390.875,16	316.437,27	9,94%	(263.786,39)	(50.672,77)	379.361,86
PICTET GL FIC FIM IE	3.780.388,53	175.777,76	166.510,69	5,23%	-	-	-
RESEAR	3.096.569,10	114.006,74	32.138,73	1,01%	(145.077,81)	(27.869,12)	208.642,26
QUAL	9.975.418,43	573.589,61	553.422,90	17,39%	(467.359,79)	(89.778,77)	672.129,00
Total	71.873.779,56	3.609.428,53	3.182.124,34	100,00%	(2.798.540,27)	(537.593,30)	4.024.693,85



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

31/08/2021

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS					INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	Data Aquisição	Data Vencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RF EMB II	20/10/14	15/01/23	SABESP	1.098.792,67	brAAA	Aa2.br	AA(bra)
FI RF EMB II	21/10/14	15/01/23	SABESP	5.488.777,17	brAAA	Aa2.br	AA(bra)
FI RF EMB II	24/02/15	15/01/23	SABESP	2.820.950,23	brAAA	Aa2.br	AA(bra)
FI RF EMB II	04/03/15	02/03/22	B VOTORA	23.432.583,24	brAAA	Aa3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	25/05/15	15/04/23	RD COLIN	1.061.842,66	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	27/05/15	15/04/23	RD COLIN	1.060.947,84	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	27/05/15	15/04/23	RD COLIN	1.167.278,61	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	01/06/15	15/04/23	RD COLIN	1.368.844,73	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB II	09/06/15	07/06/22	B VOTORA	10.881.759,44	brAAA	Aa3.br	-
FI RF EMB II	30/06/15	28/06/22	B VOTORA	10.930.120,86	brAAA	Aa3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	12/08/15	16/07/23	DUKE GEP	2.570.621,49	-	Aaa.br	-
FI RF EMB II	06/11/15	04/11/22	BRADESCO	6.605.424,33	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	18/11/15	16/11/22	BRADESCO	16.412.299,33	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	05/02/16	15/04/22	ECPT	15.915,03	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	05/02/16	15/07/22	ECPT	15.505,35	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	05/02/16	15/10/22	ECPT	48.873,81	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	05/02/16	15/01/23	ECPT	47.607,86	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	11/02/16	15/01/23	ECPT	165.864,30	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	16/02/16	15/07/22	ECPT	135.594,79	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	16/02/16	15/10/22	ECPT	426.454,00	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	16/02/16	15/04/22	ECPT	63.862,59	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	01/03/16	15/04/22	ECPT	75.062,60	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	01/03/16	15/01/23	ECPT	797.880,01	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	18/05/16	15/10/24	TRANS AL	2.219.809,92	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/24	TRANS AL	819.493,85	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/24	TRANS AL	491.696,31	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	20/06/16	15/10/24	TRANS AL	1.636.871,38	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FIM EMB II A	28/07/16	04/10/21	B VOTORA	2.281.006,95	brAAA	Aa3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	25/08/16	15/01/23	ECPT	418.584,81	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	25/08/16	15/01/23	ECPT	269.230,55	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/09/16	15/10/22	ECPT	1.138.053,58	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	10/10/16	15/01/23	SABESP	216.963,67	brAAA	Aa2.br	AA(bra)
FIM EMB II A	12/12/16	12/01/22	LOCALIZA	535.905,39	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB I A	12/12/16	12/01/22	LOCALIZA	606.685,34	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB I A	08/02/17	08/02/22	TELEF BR	1.111.383,54	brAAA	-	-
FIM EMB II A	08/02/17	08/02/22	TELEF BR	1.501.869,64	brAAA	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	24/03/17	15/04/22	ECPT	271.184,47	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	24/03/17	15/07/22	ECPT	266.513,54	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	24/03/17	15/10/22	ECPT	827.240,93	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	24/03/17	15/01/23	ECPT	390.261,83	-	A2.br	-
FIM EMB I A	28/04/17	15/04/22	LAME	462.071,31	brAAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	16/05/17	15/01/23	ECPT	734.966,55	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	16/05/17	15/07/22	ECPT	17.064,51	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/07/17	15/04/23	RD COLIN	2.526.353,72	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB II	25/08/17	15/08/24	PETR	15.716.178,15	AAA	Aaa.br	AA(bra)
FIM EMB II A	22/09/17	15/09/22	ENERSUL	541.266,25	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	28/09/17	25/09/21	NATURA	635.283,22	brAA+	-	AA(bra)
FIM EMB II A	28/09/17	25/09/21	NATURA	1.127.115,40	brAA+	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	18/12/17	06/11/27	RB CAPIT	4.060.242,06	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	21/12/17	06/11/27	RB CAPIT	1.184.964,14	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/01/18	06/11/27	RB CAPIT	4.233.295,33	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	29/01/18	27/10/22	SUL AME	1.310.051,48	-	-	A+(bra)
FI RF EMB II	19/02/18	15/02/25	SABESP	8.391.033,30	brAAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/02/18	15/02/25	SABESP	5.207.552,81	brAAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	11.475.736,77	brAA	-	-
FI RF EMB II	23/05/18	15/05/28	COMGAS	25.468.415,30	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	564.372,11	brAA	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	564.372,11	brAA	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	564.372,11	brAA	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	562.929,02	brAA	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	564.372,11	brAA	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	10.644.490,90	-	A2.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/07/18	15/07/25	AEGEA SA	12.273.808,53	brA	Aa1.br	-
FI RF EMB II	26/07/18	15/07/25	CSMG	13.770.476,14	-	Aa3.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/02/22	CEMIG G	1.502.677,65	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/02/22	CEMIG G	72.690,99	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/02/22	CEMIG G	510.028,58	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/04/23	RD COLIN	788.820,51	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/04/23	RD COLIN	447.708,94	brAA+	A3.br	-



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/08/2021

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS					INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	Data Aquisição	Data Vencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/04/23	RD COLIN	1.183.230,77	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/02/25	CEMIG	2.296.990,66	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FIM EMB II A	14/11/18	15/03/24	BRASESCO	292.741,83	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB I A	14/11/18	15/03/24	BRASESCO	292.741,83	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB I A	04/01/19	07/06/24	MOV_PART	1.167.684,50	brAA+	-	AA-(bra)
FIM EMB II A	17/01/19	16/09/24	ITAUUBB	290.372,40	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB I A	12/02/19	15/01/25	ITAUUBB	2.437.577,36	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB II A	12/02/19	15/01/25	ITAUUBB	2.437.577,36	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB I A	19/08/20	14/08/24	B3SA	1.664.519,99	-	Aaa.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/05/26	OMEGA GE	497.916,70	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/05/26	OMEGA GE	3.152.674,56	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/05/26	OMEGA GE	1.795.372,75	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/05/26	OMEGA GE	5.428.010,30	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/07/29	GUARIROB	613.246,22	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/07/29	GUARIROB	4.961.719,48	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/07/29	GUARIROB	7.358.954,74	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/07/29	GUARIROB	758.195,34	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/05/26	OMEGA GE	544.596,40	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	30/09/20	22/09/25	BCBF	263.461,09	-	-	AA+(bra)
FIM EMB II A	08/01/21	15/04/24	ECORODOV	1.341.990,82	-	-	AA(bra)
FIM EMB II A	20/01/21	15/07/23	AEGEA SA	571.890,00	-	Aa1.br	-
FIM EMB II A	20/01/21	23/07/23	COPEL GT	174.276,40	-	-	AA+(bra)
FIM EMB II A	04/02/21	15/07/23	AEGEA SA	193.314,93	-	Aa1.br	-
FIM EMB II A	05/02/21	23/07/23	COPEL GT	109.529,23	-	-	AA+(bra)
FIM EMB II A	05/02/21	15/07/23	AEGEA SA	265.808,03	-	Aa1.br	-
FIM EMB II A	05/02/21	15/07/24	COPEL GT	282.154,63	-	-	AA+(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	22/08/22	ITAU	4.762.031,74	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	15/12/30	ENTREVIA	5.617.902,88	brAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/12/30	ENTREVIA	5.632.634,98	brAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/05/29	ELETROB	3.640.140,52	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/06/29	NEOENERG	508.175,03	brAA+	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/06/29	NEOENERG	5.051.513,35	brAA+	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/05/29	ELETROB	1.507.366,43	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/05/29	ELETROB	2.889.080,58	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/05/29	ELETROB	3.091.027,72	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/07/34	IGUA SAN	2.363.107,59	brAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/05/28	COMGAS	22.182.168,16	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	07/11/22	ITAU	8.951.864,33	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	07/11/22	ITAU	752.879,57	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	07/11/22	ITAU	752.879,57	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	07/11/22	ITAU	6.023.036,56	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	07/11/22	ITAU	3.764.397,85	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	07/11/22	ITAU	5.270.156,99	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/02/22	CEMIG G	597.287,90	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/02/22	CEMIG G	149.321,98	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/02/22	CEMIG G	1.066.158,90	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	16/07/23	DUKE GEP	10.431.133,16	-	Aaa.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	838.468,80	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/02/22	CEMIG G	151.711,13	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	1.475.705,09	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/02/22	CEMIG G	1.087.063,98	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	1.676.937,60	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	838.468,80	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/22	ECPT	505.713,42	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/07/22	ECPT	127.978,40	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	1.026.285,81	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	14/11/22	ITAU	7.536.240,52	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/22	ECORODOV	3.432.486,48	brAAA	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/22	ECORODOV	1.144.855,35	brAAA	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/05/22	SUL AME	1.523.146,05	-	-	A+(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/22	ECORODOV	1.431.404,36	brAAA	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	860.886,89	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	2.497.737,59	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	27/01/25	BRASESCO	10.686.939,09	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/11/24	CCR	5.470.057,98	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/11/24	ECORODOV	3.751.777,65	brAAA	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/02/25	SABESP	1.223.004,42	brAAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/05/28	COMGAS	9.858.741,41	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/06/27	JAGUARA	1.764.906,91	-	-	AAA(bra)



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/08/2021

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS					INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/06/27	ENERGMIR	1.063.387,63	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	01/08/25	BRADESCO	3.489.280,04	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/07/24	SONAE	361.650,96	-	-	AA+(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/07/24	SONAE	421.926,12	-	-	AA+(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/07/24	SONAE	421.926,12	-	-	AA+(bra)
FIM EMB I A	28/05/21	28/11/23	B.ALFA	969.668,24	-	Aa1.br	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/07/34	IGUA SAN	580.302,75	brAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/07/34	IGUA SAN	143.040,56	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/07/34	IGUA SAN	439.588,06	brAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/34	VIARONDO	3.264.683,48	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/34	VIARONDO	647.381,61	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/34	VIARONDO	593.967,28	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/07/34	IGUA SAN	1.354.815,04	brAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/07/34	IGUA SAN	1.609.497,01	brAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/07/34	IGUA SAN	3.371.338,03	brAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/07/34	IGUA SAN	661.707,95	brAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/07/34	IGUA SAN	607.050,17	brAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/34	VIARONDO	1.324.675,23	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/09/34	BRKA	4.501.139,24	-	Aa3.br	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/10/30	LAME	3.825.487,34	brAAA	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/10/38	TAUBATE	8.557.110,90	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/26	IRB	5.810.481,68	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/10/30	LAME	981.208,68	brAAA	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/31	METRORIO	3.479.162,65	brAA	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/03/29	ANET	2.890.926,59	brA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/03/29	CAGECE	2.455.431,16	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/03/28	BRISANET	3.243.920,66	brA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/10/36	PAMPASUL	1.038.943,07	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/03/27	GETI	1.995.715,15	-	Aa1.br	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/05/23	LIGHT	833.104,97	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/05/23	LIGHT	1.864.568,26	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/02/23	GETI	3.975.664,98	-	Aa1.br	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/05/23	LIGHT	1.174.281,28	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/05/23	LIGHT	856.907,96	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/10/30	LAME	459.941,57	brAAA	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/31	METRORIO	3.261.714,98	brAA	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/03/31	LOCALIZA	8.303.899,30	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/05/30	NORTE EN	1.968.045,59	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/34	VIARONDO	1.574.654,27	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	09/06/21	15/11/25	QUATA	4.337.296,51	-	-	A-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/06/21	15/12/35	MS 306	2.129.125,42	-	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/08/25	COSAN LO	1.018.022,70	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	20/08/26	VAMOS	497.777,57	brAA+	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/11/24	DASA	427.134,19	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/08/25	COSAN LO	814.418,16	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	04/11/25	BCBF	507.201,36	-	-	AA+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	04/11/25	BCBF	507.201,36	-	-	AA+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	20/08/26	VAMOS	1.024.659,08	brAA+	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	27/11/25	SANEAMEN	499.852,92	-	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	27/11/25	SANEAMEN	1.015.961,22	-	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	27/11/25	SANEAMEN	1.000.721,80	-	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/11/24	DASA	1.734.790,86	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/11/24	DASA	433.192,83	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/08/25	COSAN LO	203.604,54	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/08/25	COSAN LO	509.549,99	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	04/11/25	BCBF	1.520.560,45	-	-	AA+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	14/06/21	19/06/24	BNBBM	554.600,73	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	14/06/21	12/06/24	BNBBM	838.784,64	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/06/21	29/06/24	SBF COME	733.660,32	brA+	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/06/21	29/06/24	SBF COME	1.756.651,47	brA+	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/06/21	15/09/25	BRKA	1.901.970,36	-	Aa3.br	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/06/21	15/09/25	BRKA	632.204,23	-	Aa3.br	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/06/21	25/04/23	CELPA	2.540.522,81	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	15/06/21	15/12/30	B2W	2.182.563,99	brAAA	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	15/06/21	15/09/34	BRKA	999.149,13	-	Aa3.br	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	15/06/21	15/10/36	PAMPASUL	2.478.661,34	brAAA	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	16/06/21	13/07/23	ECORODOV	2.072.731,44	brAAA	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	16/06/21	15/05/23	LIGHT	2.062.926,58	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	16/06/21	15/03/29	OMEGA GE	2.070.120,77	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	16/06/21	20/04/26	SMARTIFI	2.077.430,47	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	16/06/21	30/09/23	USIMINAS	2.056.678,04	brAA+	-	AA+(bra)



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/08/2021

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS					INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FIM EMB VI A CRED PRIV	16/06/21	30/09/23	USIMINAS	514.169,51	brAA+	-	AA+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	17/06/21	15/02/31	CORSAN	1.512.377,32	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	17/06/21	15/02/26	CORSAN	1.014.743,88	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	18/06/21	15/12/30	MG050	488.291,76	brAA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	21/06/21	15/04/28	PAMPASUL	1.338.118,55	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/06/21	15/06/31	RIO PR	499.334,13	-	Aaa.br	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	25/06/21	27/11/25	GUAR	1.237.371,10	-	-	A+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	15/10/30	LAME	300.495,16	brAAA	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	15/12/35	MS 306	1.558.204,38	-	-	A+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	15/10/30	LAME	1.557.668,78	brAAA	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	15/12/35	MS 306	85.165,02	-	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	25/06/21	20/06/26	OURO VER	2.031.676,51	-	-	A+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/06/21	15/09/34	BRKA	1.689.169,25	-	Aa3.br	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	30/06/21	27/11/25	GUAR	1.351.749,95	-	-	A+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	30/06/21	15/12/35	MS 306	3.154.259,89	-	-	A+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	01/07/21	15/10/26	LIGHT	5.188.045,28	brAA+	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	01/07/21	15/12/35	MS 306	2.758.925,98	-	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	02/07/21	18/02/25	RENNER	1.107.846,97	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	02/07/21	18/02/25	RENNER	234.293,98	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	07/07/21	15/03/29	CAGECE	1.763.062,80	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	07/07/21	15/07/28	VENSJOR	303.346,37	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	07/07/21	15/07/28	VENSJOR	1.463.484,89	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	08/07/21	15/06/31	VAMOS	255.873,54	brAA+	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	08/07/21	15/06/31	VAMOS	249.337,83	brAA+	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	08/07/21	15/03/29	CAGECE	2.625.098,29	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	08/07/21	15/06/31	VAMOS	4.947.179,21	brAA+	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	12/07/21	31/10/22	ITAU	1.299.229,00	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	12/07/21	15/02/23	GETI	3.008.069,35	-	Aa1.br	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	12/07/21	15/12/22	COELCE	3.027.087,49	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	12/07/21	12/07/26	BRADESCO	3.034.371,64	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/07/29	GUARIROB	1.150.295,13	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/26	IRB	1.897.078,91	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/34	VIARONDO	216.862,16	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/05/26	OMEGA GE	291.586,45	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/26	IRB	921.438,33	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/30	B2W	1.705.456,20	brAAA	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/09/34	BRKA	457.069,33	-	Aa3.br	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/26	IRB	479.147,93	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/05/26	OMEGA GE	858.997,93	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/30	B2W	1.504.814,29	brAAA	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/30	B2W	2.207.060,96	brAAA	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/30	B2W	1.103.530,48	brAAA	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/09/34	BRKA	762.886,24	-	Aa3.br	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/34	VIARONDO	1.824.633,30	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/34	VIARONDO	285.232,49	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/26	IRB	3.794.157,81	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/03/29	ANET	1.070.713,55	brA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	11/03/25	BRML	3.044.610,35	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	10/05/24	MULTIPLA	3.041.248,89	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	20/09/24	IGUATEMI	366.937,88	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	20/09/24	IGUATEMI	366.937,88	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	20/09/24	IGUATEMI	1.308.213,32	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	15/07/27	RT BANDE	2.251.435,08	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	15/05/23	ELEKTRO	965.170,96	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	15/05/23	ELEKTRO	2.105.644,37	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	15/09/23	SONAE	3.031.096,81	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	16/07/21	15/02/31	CORSAN	2.675.899,61	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	19/07/21	15/07/30	PARANAGU	725.437,70	brAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	19/07/21	15/05/30	NORTE EN	1.830.628,93	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	19/07/21	15/10/30	LAME	1.984.494,55	brAAA	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	21/07/21	15/10/36	PAMPASUL	2.007.166,00	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	21/07/21	15/10/36	PAMPASUL	735.489,40	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	15/05/25	INTERVIA	1.268.319,87	-	-	-
FIM EMB I A	21/07/21	05/03/24	ENERG TR	1.303.058,79	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	15/01/26	AERIS	1.197.946,14	brAA	-	AA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	15/07/27	RT BANDE	1.082.315,06	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	15/03/29	OMEGA GE	1.046.446,05	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	20/08/26	VAMOS	1.023.655,49	brAA+	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	23/07/21	15/12/30	MG050	1.464.875,28	brAA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	26/07/21	15/03/29	ANET	2.676.783,88	brA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	494.389,55	-	-	AA(bra)



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/08/2021

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS					INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	Data Aquisição	Data Vencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FIM EMB VII A CRED PRIV	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	1.265.170,10	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	27/07/21	15/06/28	MOVIDA L	1.458.126,13	brAA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	27/07/21	15/06/28	MOVIDA L	3.704.190,60	brAA+	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	29/07/21	15/10/24	BKBR	1.401.466,52	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	29/07/21	15/12/26	RD COLIN	2.117.635,83	brAA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	30/07/21	15/05/30	NORTE EN	1.015.688,37	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	02/08/21	15/01/31	ECHOENER	1.537.615,52	-	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	995.953,10	brAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	04/08/21	15/04/27	MOV_PART	1.041.366,85	brAA+	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	04/08/21	24/01/24	MOVIDA L	1.005.231,46	brAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	05/08/21	15/06/32	ENSINOP	686.335,49	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	06/08/21	15/12/31	METRORIO	1.000.259,26	brAA	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/08/21	10/08/23	PARANA B	501.831,67	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	11/08/21	15/08/31	CSAN	1.008.669,38	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	11/08/21	15/06/27	AUTOPIST	1.518.339,25	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	11/08/21	15/04/31	ELETROB	2.051.657,25	brAAA	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	11/08/21	15/08/31	CSAN	5.000.916,86	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	12/08/21	14/08/23	ABC	1.001.571,54	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	12/08/21	15/07/31	ALGA	3.012.593,43	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	17/08/21	15/05/30	NORTE EN	3.080.523,09	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	18/08/21	15/12/31	METRORIO	1.014.393,36	brAA	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	18/08/21	15/12/31	METRORIO	1.022.004,03	brAA	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	20/08/21	15/05/44	CTEEP	942.276,80	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/08/21	15/08/29	CEEE D	3.796.226,60	brAA+	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	27/08/21	20/08/31	S LUIZ A	1.000.548,08	AAA(bra)	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	FIDC CELG DIST SN B	3.817.938,66	-	-	AA-sf(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	FIDC CREDZ SN4	13.862,48	brAA(sf)	-	Asf(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	FIDC CREDZ SN6	840.046,13	brAA (sf)	-	A+s(f)(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	FIDC	3.428.320,48	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	SN3	5.462.895,78	brAAA	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	SN5	700.000,00	brAAA(sf)	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	SN6	1.400.000,00	brAAA(sf)	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	FARM SYN AGRO FIDC	4.017.625,41	-	-	AAAsf(bra)

Observação: Em Junho de 2021, nenhum dos ativos da carteira de crédito da EMBRAER PREV sofreu rebaixamento de suas classificações de risco e ficou abaixo do mínimo estabelecido na escala da Política de Investimentos de 2021.

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



Bradesco

Relatório Resumo de Enquadramento

Patrimônio Líquido da Fundação **3.773.313.603,77**

Tópico do Enquadramento	Limite	Aplicação Atual	Valor Limite	% Aplicado	Status
% do Segmento RF/PL PLANO	100,00%	2.736.272.679,57	3.773.313.603,77	72,52%	Enquadrado
% do PL em Títulos de Emissão do Tesouro Nacional e/ou do BACEN	100,00%	2.025.946.964,55	3.773.313.603,77	53,69%	Enquadrado
% do PL em Títulos RFI, exceto títulos do Tesouro Nacional	80,00%	710.325.715,02	3.018.650.928,00	18,82%	Enquadrado
% do PL em FIDC	20,00%	Verificar Rel. de Diversificação de FIDC's	754.662.732,00	0,00%	Enquadrado
% do PL em uma mesma pessoa jurídica não-financeira	10,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Não Financ.	377.331.366,00	0,00%	Enquadrado
% do PL em Instituições Financeiras	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Financ.	943.328.400,94	0,00%	Enquadrado
% de uma mesma Série de Debêntures	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Debêntures	943.328.400,94	0,00%	Enquadrado
% do PL em RV	70,00%	785.109.645,20	2.641.319.477,66	20,81%	Enquadrado
% do capital votante de uma empresa	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação RV	943.328.400,94	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Imobiliários	20,00%	98.637.734,18	754.662.732,00	2,61%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Empréstimos	15,00%	31.546.412,75	565.997.063,06	0,84%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Estruturados	20,00%	0,00	754.662.732,00	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos no Exterior	10,00%	117.959.556,07	377.331.366,00	3,13%	Enquadrado

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



6.2. Relatório de Túnel de Preços

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE AGOSTO DE 2021 À 31 DE AGOSTO DE 2021



Bradesco

FIM EMB I A												
FONTE ANBIMA												
DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
11/08/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	XP CCTVM	NTN-B	15/08/2022	Compra	2,1891%	2,1825%	1,8325%	3,2017%	0,0066%	NÃO
11/08/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	XP CCTVM	NTN-B	15/08/2022	Compra	2,1891%	2,1825%	1,8325%	3,2017%	0,0066%	NÃO
16/08/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	RENASCEN	NTN-B	15/08/2050	Compra	4,8495%	4,9154%	4,4835%	5,3960%	-0,0659%	NÃO
17/08/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	XP CCTVM	NTN-B	15/08/2050	Compra	4,9395%	4,8928%	4,5458%	5,4592%	0,0467%	NÃO
23/08/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	XP CCTVM	NTN-B	15/08/2022	Compra	2,4590%	2,5680%	2,0884%	3,4626%	-0,1090%	NÃO
24/08/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	NECTON	NTN-B	15/08/2022	Compra	2,5891%	2,6294%	2,2030%	3,5794%	-0,0403%	NÃO

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE AGOSTO DE 2021 À 31 DE AGOSTO DE 2021



Bradesco

FIM EMB II A												
FONTE ANBIMA												
DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
03/08/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2026	Compra	4,0545%	4,0209%	3,6287%	4,9835%	0,0336%	NÃO
17/08/2021	FIM EMB II A	BNP	LIQUIDEZ	NTN-B	15/08/2026	Compra	4,4990%	4,5045%	4,0688%	5,4261%	-0,0055%	NÃO
17/08/2021	FIM EMB II A	BNP	XP CCTVM	NTN-B	15/08/2026	Compra	4,4890%	4,5045%	4,0688%	5,4261%	-0,0155%	NÃO
17/08/2021	FIM EMB II A	BNP	XP CCTVM	NTN-B	15/08/2030	Compra	4,7390%	4,7163%	4,3531%	5,4517%	0,0227%	NÃO
18/08/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2022	Compra	2,2726%	2,3209%	1,9160%	3,2843%	-0,0483%	NÃO
18/08/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2023	Compra	3,4765%	3,5800%	3,1289%	4,5046%	-0,1035%	NÃO
18/08/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2023	Compra	3,4765%	3,5800%	3,1289%	4,5046%	-0,1035%	NÃO
18/08/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2025	Compra	4,3795%	4,5461%	3,9693%	5,3783%	-0,1666%	NÃO
18/08/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2026	Compra	4,5045%	4,7089%	4,0783%	5,4358%	-0,2044%	NÃO
18/08/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2035	Compra	4,7398%	4,9185%	4,3606%	5,3180%	-0,1787%	NÃO
18/08/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2055	Compra	4,9168%	5,0162%	4,5483%	5,4487%	-0,0994%	NÃO

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE AGOSTO DE 2021 À 31 DE AGOSTO DE 2021



Bradesco

FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A												
FONTE ANBIMA												
DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
02/08/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	XP_INV	LFT	01/03/2024	Venda	0,1955%	0,1915%	0,1015%	0,2513%	0,0040%	NÃO
06/08/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	XP_INV	LFT	01/09/2025	Venda	0,2303%	0,2293%	0,1798%	0,3045%	0,0010%	NÃO
06/08/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	XP_INV	LFT	01/09/2025	Venda	0,2303%	0,2293%	0,1798%	0,3045%	0,0010%	NÃO
06/08/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	XP_INV	LFT	01/09/2025	Venda	0,2303%	0,2293%	0,1798%	0,3045%	0,0010%	NÃO
06/08/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	XP_INV	LFT	01/09/2025	Venda	0,2303%	0,2293%	0,1798%	0,3045%	0,0010%	NÃO
06/08/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	XP_INV	LFT	01/09/2025	Venda	0,2303%	0,2293%	0,1798%	0,3045%	0,0010%	NÃO
12/08/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	XP_INV	NTN-B	15/08/2040	Compra	4,6036%	4,6878%	4,2357%	5,1981%	-0,0842%	NÃO
12/08/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	XP_INV	NTN-B	15/05/2055	Compra	4,7294%	4,8078%	4,3668%	5,2641%	-0,0784%	NÃO
13/08/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	XP_INV	LFT	01/03/2024	Venda	0,1895%	0,1879%	0,0903%	0,2492%	0,0016%	NÃO
20/08/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	INDUSVAL	LFT	01/03/2024	Venda	0,1880%	0,1811%	0,0870%	0,2417%	0,0069%	NÃO
23/08/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	XP_INV	LFT	01/09/2025	Venda	0,2202%	0,2231%	0,1750%	0,3068%	-0,0029%	NÃO
23/08/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	XP_INV	LFT	01/09/2025	Venda	0,2202%	0,2231%	0,1750%	0,3068%	-0,0029%	NÃO
23/08/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	XP_INV	LFT	01/09/2025	Venda	0,2202%	0,2231%	0,1750%	0,3068%	-0,0029%	NÃO
23/08/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	XP_INV	LFT	01/09/2025	Venda	0,2202%	0,2231%	0,1750%	0,3068%	-0,0029%	NÃO
23/08/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	XP_INV	LFT	01/09/2025	Venda	0,2202%	0,2231%	0,1750%	0,3068%	-0,0029%	NÃO
23/08/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	XP_INV	LFT	01/09/2025	Venda	0,2202%	0,2231%	0,1750%	0,3068%	-0,0029%	NÃO
23/08/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	XP_INV	LFT	01/09/2025	Venda	0,2202%	0,2231%	0,1750%	0,3068%	-0,0029%	NÃO
26/08/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	INDUSVAL	LTN	01/01/2024	Compra	9,2695%	9,2800%	8,4781%	10,5701%	-0,0105%	NÃO
26/08/2021	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	MAUA	INDUSVAL	NTN-B	15/05/2055	Compra	4,7390%	4,7800%	4,3923%	5,2916%	-0,0410%	NÃO

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE AGOSTO DE 2021 À 31 DE AGOSTO DE 2021



Bradesco

FIM EMB V A INVEST NO EXT												
FONTE ANBIMA												
DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
06/08/2021	FIM EMB V A INVEST NO EXT	BTG WM	PACTUAL	LFT	01/09/2026	Venda	0,2478%	0,2475%	0,1983%	0,3547%	0,0003%	NÃO



RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO
 Cliente: EMBRAER PREV
 Período: 01 DE AGOSTO DE 2021 À 31 DE AGOSTO DE 2021



FIM EMB VI A CRED PRIV												
FONTE ANBIMA												
DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
03/08/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	AMERICA	NTN-B	15/05/2025	Compra	3,8090%	3,8800%	3,4745%	4,8829%	-0,0710%	NÃO
06/08/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	TULL PRE	NTN-B	15/05/2023	Venda	3,3910%	3,3038%	3,0257%	4,3986%	0,0872%	NÃO
06/08/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	TULL PRE	NTN-B	15/05/2023	Venda	3,3910%	3,3038%	3,0257%	4,3986%	0,0872%	NÃO
06/08/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	TULL PRE	NTN-B	15/05/2023	Venda	3,3910%	3,3038%	3,0257%	4,3986%	0,0872%	NÃO
06/08/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	TULL PRE	NTN-B	15/05/2023	Venda	3,3910%	3,3038%	3,0257%	4,3986%	0,0872%	NÃO
06/08/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	TULL PRE	NTN-B	15/08/2024	Venda	3,9610%	3,9100%	3,5902%	4,9950%	0,0510%	NÃO
16/08/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	CONCORDI	NTN-B	15/05/2025	Venda	4,3500%	4,4101%	3,9392%	5,3481%	-0,0601%	NÃO
16/08/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	CONCORDI	NTN-B	15/05/2025	Venda	4,3500%	4,4101%	3,9392%	5,3481%	-0,0601%	NÃO
17/08/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	AMERICA	NTN-B	15/05/2025	Venda	4,4100%	4,3800%	3,9994%	5,4083%	0,0300%	NÃO
17/08/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	AMERICA	NTN-B	15/05/2025	Venda	4,4100%	4,3800%	3,9994%	5,4083%	0,0300%	NÃO



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL
Mês de Referência: 01 DE AGOSTO DE 2021 À 31 DE AGOSTO DE 2021



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
02-08-21	FIA RVA EMB II	Compra	B3SA3	15,87	275.200,00	4.367.393,89	15,49	15,80	16,00	71.314,00
02-08-21	FIA RVA EMB II	Venda	PETRA	27,30	62.300,00	1.700.546,00	26,37	26,86	27,41	94.024,00
02-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	AMER3	50,80	700,00	35.561,85	49,57	50,82	51,27	20.022,00
02-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	87,48	200,00	17.496,67	85,82	87,27	88,32	7.667,00
02-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	B3SA3	15,83	2.400,00	37.984,51	15,49	15,80	16,00	71.314,00
02-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	32,40	300,00	9.720,60	31,95	32,44	32,79	32.501,00
02-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	21,08	500,00	10.541,47	20,75	21,03	21,59	32.868,00
02-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	BRAP4	74,51	200,00	14.901,76	73,93	74,49	75,67	11.024,00
02-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	BRDT3	29,03	2.300,00	66.770,06	28,44	28,93	29,26	32.485,00
02-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	BRDT3	29,03	2.000,00	58.055,10	28,44	28,93	29,26	32.485,00
02-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CCPR3	11,50	600,00	6.899,13	11,25	11,47	11,55	1.317,00
02-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CESP6	23,35	1.700,00	39.688,03	23,20	23,41	23,76	8.386,00
02-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CPFE3	25,65	1.600,00	41.036,52	25,42	25,59	25,84	6.430,00
02-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CRFB3	18,96	400,00	7.584,89	18,74	19,00	19,20	17.931,00
02-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ELET6	40,91	1.900,00	77.738,14	40,42	40,86	41,30	8.290,00
02-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	43,45	500,00	21.723,52	42,85	43,41	43,72	7.422,00
02-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	24,57	3.300,00	81.080,09	24,32	24,52	24,75	21.714,00
02-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	GMAT3	7,20	2.000,00	14.404,05	7,16	7,22	7,26	7.741,00
02-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	GNDI3	80,93	100,00	8.093,26	79,49	80,95	82,33	14.336,00
02-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	14,57	1.100,00	16.022,37	14,26	14,53	14,69	18.109,00
02-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	HBSA3	5,57	3.500,00	19.495,00	5,44	5,54	5,65	5.164,00
02-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	HGTX3	37,74	300,00	11.321,10	37,26	37,66	38,19	5.775,00
02-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	HYPE3	37,25	1.300,00	48.418,78	36,04	37,07	37,60	18.796,00
02-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	HYPE3	37,25	1.600,00	59.596,93	36,04	37,07	37,60	18.796,00
02-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	HYPE3	37,22	1.900,00	70.724,07	36,04	37,07	37,60	18.796,00
02-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	11,50	3.700,00	42.534,58	11,34	11,49	11,59	64.860,00
02-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	31,03	3.200,00	99.280,79	30,47	30,98	31,51	72.549,00
02-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	30,92	700,00	21.640,98	30,47	30,98	31,51	72.549,00
02-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	JBS53	33,01	1.100,00	36.314,77	32,38	33,01	33,39	45.820,00
02-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	JBS53	33,17	300,00	9.952,25	32,38	33,01	33,39	45.820,00
02-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	42,05	800,00	33.639,77	41,55	42,11	42,82	35.557,00
02-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	MINE3	9,04	700,00	6.330,00	8,97	9,08	9,24	987,00
02-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	MULT3	24,14	400,00	9.654,84	23,52	24,12	24,33	21.560,00
02-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	NTOC3	53,64	1.000,00	53.641,30	53,15	53,62	54,30	33.946,00
02-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	OMGE3	35,97	600,00	21.584,88	35,64	35,95	36,33	4.901,00
02-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	PARD3	19,72	700,00	13.805,50	19,39	19,74	20,07	2.392,00
02-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	PETRA	27,56	1.900,00	52.354,76	27,24	27,63	28,22	34.835,00
02-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	17,80	200,00	3.559,71	17,59	17,89	18,35	23.916,00
02-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	QUAL3	26,37	400,00	10.548,00	25,95	26,27	26,49	7.883,00
02-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	21,08	1.800,00	37.937,15	20,76	21,07	21,25	20.682,00
02-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	18,16	100,00	1.816,22	17,84	18,10	18,49	1.687,00
02-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	18,13	400,00	7.252,00	17,84	18,10	18,49	1.687,00
02-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	62,17	1.100,00	68.381,89	61,17	62,16	62,91	32.024,00
02-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	SEER3	16,00	600,00	9.597,07	15,74	15,98	16,22	2.944,00
02-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	SULA11	30,55	1.500,00	45.820,63	29,97	30,50	30,71	16.653,00
02-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	54,87	1.100,00	60.360,18	54,11	54,81	55,59	26.041,00
02-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	VALE3	110,23	400,00	44.090,40	108,93	110,25	111,37	60.649,00
02-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	CLSA3	29,43	1.368,00	40.260,33	28,51	29,49	30,50	7.416,00
02-08-21	FIA RVA EMB IV	Venda	LCAM3	27,43	2.154,00	59.094,83	27,05	27,38	27,75	17.233,00
02-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	RAIL3	21,15	6.115,00	129.319,24	20,76	21,07	21,25	20.682,00
03-08-21	FIA RVA EMB II	Compra	ITUB4	30,29	44.000,00	1.332.918,27	30,16	30,74	31,43	74.325,00
03-08-21	FIA RVA EMB II	Venda	PETRA	25,94	79.900,00	2.072.723,31	25,79	26,42	26,87	95.752,00
03-08-21	FIA RVA EMB II	Compra	WEGE3	36,04	18.900,00	681.186,72	35,86	36,27	36,69	21.556,00
03-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ALSO3	28,13	500,00	14.063,84	27,52	28,10	28,59	6.604,00
03-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	AMER3	49,90	1.800,00	89.820,00	48,73	49,33	51,20	19.923,00
03-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	AMER3	49,27	2.700,00	133.037,85	48,73	49,33	51,20	19.923,00
03-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	AMER3	49,52	1.100,00	54.472,89	48,73	49,33	51,20	19.923,00
03-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	AMER3	49,32	1.000,00	49.322,71	48,73	49,33	51,20	19.923,00
03-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	AMER3	49,49	900,00	44.539,19	48,73	49,33	51,20	19.923,00
03-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	BRAP4	76,18	400,00	30.472,37	73,50	75,76	76,87	11.742,00
03-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	BRDT3	28,27	400,00	11.307,49	27,60	28,27	28,83	34.845,00
03-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	BRML3	10,10	2.700,00	27.259,20	9,90	10,09	10,23	26.513,00
03-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ELET6	40,33	700,00	28.232,14	39,52	40,25	40,71	6.659,00
03-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	14,19	400,00	5.676,00	14,04	14,32	14,52	19.110,00
03-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	14,33	3.400,00	48.718,18	14,04	14,32	14,52	19.110,00
03-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	NTOC3	53,16	1.200,00	63.787,37	51,81	53,68	54,87	31.435,00
03-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	17,42	100,00	1.741,70	17,17	17,66	18,00	24.173,00
03-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	17,90	100,00	1.790,00	17,17	17,66	18,00	24.173,00
03-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	17,71	100,00	1.771,31	17,35	17,97	18,30	882,00
03-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	18,30	100,00	1.830,00	17,35	17,97	18,30	882,00
03-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	60,42	600,00	36.253,57	59,04	60,26	61,36	36.822,00
03-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	SULA11	29,80	300,00	8.940,00	29,64	29,86	30,67	15.215,00
03-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	54,93	1.700,00	93.376,65	53,90	54,66	55,13	23.699,00
03-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	TEND3	21,98	1.200,00	26.376,00	21,55	21,88	22,80	5.951,00
03-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	TEND3	21,87	600,00	13.122,95	21,55	21,88	22,80	5.951,00



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL
Mês de Referência: 01 DE AGOSTO DE 2021 À 31 DE AGOSTO DE 2021



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
03-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	VALE3	112,25	500,00	56.123,54	109,44	111,73	113,03	79.100,00
03-08-21	FIA RVA EMB IV	Venda	B3SA3	15,93	11.365,00	180.994,68	15,47	15,87	16,08	52.752,00
03-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	BRML3	10,18	4.805,00	48.926,79	9,90	10,09	10,23	26.513,00
03-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	CLSA3	29,50	1.922,00	56.699,00	28,51	29,46	30,25	2.260,00
03-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	7,10	6.516,00	46.263,60	6,98	7,09	7,24	11.125,00
03-08-21	FIA RVA EMB IV	Venda	LCAM3	25,94	4.582,00	118.846,78	25,82	26,48	27,14	21.973,00
04-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	AMER3	47,79	800,00	38.232,00	47,75	48,27	49,33	16.467,00
04-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	AMER3	48,36	4.600,00	222.466,87	47,75	48,27	49,33	16.467,00
04-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	AMER3	48,39	300,00	14.515,93	47,75	48,27	49,33	16.467,00
04-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	87,08	300,00	26.124,00	85,75	86,80	88,28	5.601,00
04-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	BRAP4	76,66	400,00	30.663,81	75,50	76,71	77,25	13.960,00
04-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	BRDT3	28,05	1.900,00	53.302,50	27,80	28,12	28,55	30.982,00
04-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CPFE3	25,66	700,00	17.963,32	25,32	25,68	25,91	9.752,00
04-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ELET6	40,23	800,00	32.181,03	39,81	40,26	40,73	6.770,00
04-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	GMAT3	7,56	500,00	3.780,00	7,07	7,38	7,56	10.665,00
04-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	GNDI3	79,17	400,00	31.667,29	77,92	78,90	80,81	17.473,00
04-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	14,28	2.600,00	37.131,33	14,06	14,28	14,56	27.122,00
04-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	PETR3	26,69	400,00	10.675,88	26,44	26,84	27,59	33.731,00
04-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	PETR3	26,69	1.800,00	48.038,88	26,44	26,84	27,59	33.731,00
04-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	17,36	100,00	1.736,00	17,21	17,36	17,70	26.855,00
04-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	17,36	300,00	5.209,37	17,21	17,36	17,70	26.855,00
04-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	17,61	200,00	3.521,76	17,38	17,55	18,14	1.470,00
04-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	SULA11	29,07	400,00	11.628,58	28,62	29,00	29,84	23.047,00
04-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	SULA11	28,92	500,00	14.458,31	28,62	29,00	29,84	23.047,00
04-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	SULA11	29,05	700,00	20.338,01	28,62	29,00	29,84	23.047,00
04-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	TEND3	21,84	400,00	8.736,07	21,60	21,89	22,33	3.352,00
04-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	VALE3	112,64	200,00	22.527,25	111,62	112,66	113,25	55.405,00
04-08-21	FIA RVA EMB IV	Venda	B3SA3	15,84	21.665,00	343.167,24	15,71	15,84	16,04	50.089,00
04-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	CESP6	23,37	2.618,00	61.170,53	23,15	23,36	23,54	7.129,00
04-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	CLSA3	29,22	1.890,00	55.223,65	28,20	29,07	29,98	3.998,00
04-08-21	FIA RVA EMB IV	Venda	PETR4	26,09	22.973,00	599.396,15	25,95	26,28	26,77	122.189,00
05-08-21	FIA RVA EMB II	Venda	PETR4	28,33	108.400,00	3.071.351,00	28,06	28,56	28,98	330.239,00
05-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	27,59	700,00	19.313,19	27,21	27,63	28,44	5.910,00
05-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	AMER3	47,70	1.900,00	90.636,99	47,10	48,09	49,51	13.298,00
05-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	86,81	400,00	34.724,51	86,41	87,74	88,84	7.636,00
05-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	87,00	100,00	8.700,00	86,41	87,74	88,84	7.636,00
05-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	86,97	100,00	8.697,16	86,41	87,74	88,84	7.636,00
05-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	B3SA3	15,85	800,00	12.677,32	15,71	15,91	16,28	41.156,00
05-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	BBSF3	21,37	200,00	4.273,00	21,23	21,46	21,89	20.419,00
05-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	BKBR3	10,37	400,00	4.148,92	10,29	10,40	10,52	8.422,00
05-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	BMGB4	4,44	800,00	3.548,00	4,41	4,46	4,54	2.921,00
05-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	BRDT3	27,89	600,00	16.731,78	27,70	28,22	28,69	27.734,00
05-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	BRDT3	28,12	900,00	25.309,95	27,70	28,22	28,69	27.734,00
05-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	BRML3	10,05	2.500,00	25.135,91	9,90	10,04	10,24	21.213,00
05-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CESP6	23,34	600,00	14.003,44	23,17	23,45	23,79	6.410,00
05-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CPFE3	25,31	600,00	15.183,12	24,97	25,64	26,20	10.271,00
05-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CRFB3	18,75	400,00	7.498,66	18,63	18,83	19,11	11.364,00
05-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	CYRE3	19,71	6.900,00	135.972,99	19,57	19,86	20,48	20.112,00
05-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ELET6	39,85	1.800,00	71.725,86	39,33	39,95	40,88	8.881,00
05-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	42,56	100,00	4.256,11	42,17	42,82	43,58	8.027,00
05-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	23,84	800,00	19.074,58	23,58	23,85	24,55	22.271,00
05-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ESPA3	18,98	100,00	1.898,28	18,54	18,93	19,13	4.999,00
05-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	GMAT3	7,44	800,00	5.951,11	7,38	7,46	7,61	9.669,00
05-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	14,44	400,00	5.775,54	14,27	14,49	14,82	21.933,00
05-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	HBSA3	5,16	1.500,00	7.745,41	5,09	5,18	5,27	5.754,00
05-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	HYPE3	36,48	300,00	10.943,46	36,21	36,64	37,25	9.435,00
05-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	11,27	800,00	9.012,11	11,18	11,32	11,46	25.921,00
05-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	30,05	200,00	6.010,27	29,70	30,15	30,57	76.561,00
05-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	IREN3	41,29	300,00	12.387,39	40,56	41,40	41,93	34.628,00
05-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	MULT3	23,41	200,00	4.682,67	22,96	23,59	24,24	21.977,00
05-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	54,54	400,00	21.817,54	54,08	54,96	56,30	17.988,00
05-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	OMGE3	34,89	200,00	6.977,68	34,55	34,99	35,98	4.345,00
05-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	PAR3	19,64	300,00	5.891,17	19,48	19,67	20,06	2.109,00
05-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	PETR3	29,26	900,00	26.333,21	28,54	29,28	29,90	98.902,00
05-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	POWE3	13,51	200,00	2.702,00	13,46	13,58	13,85	1.075,00
05-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	17,44	700,00	12.207,72	17,25	17,63	18,22	32.394,00
05-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	20,08	600,00	12.047,77	19,96	20,17	20,60	14.765,00
05-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	17,22	200,00	3.444,36	17,09	17,39	17,70	1.329,00
05-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	58,15	1.000,00	58.150,00	57,71	58,29	59,78	43.277,00
05-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	SULA11	29,00	900,00	26.100,30	28,79	29,18	29,93	15.367,00
05-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	SULA11	29,01	100,00	2.900,56	28,79	29,18	29,93	15.367,00
05-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	54,46	900,00	49.010,09	53,83	54,35	55,25	23.561,00
05-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ITCSA3	6,75	500,00	3.374,00	6,63	6,76	6,91	1.500,00
05-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	TEND3	21,09	400,00	8.436,68	21,03	21,40	22,14	4.045,00
05-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	TEND3	21,38	300,00	6.415,20	21,03	21,40	22,14	4.045,00
05-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	TIMS3	11,26	300,00	3.379,20	11,19	11,30	11,48	9.969,00



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL
Mês de Referência: 01 DE AGOSTO DE 2021 À 31 DE AGOSTO DE 2021



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
05-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	VALE3	109,02	300,00	32.706,47	107,90	108,95	109,99	75.956,00
05-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	VALE3	109,10	200,00	21.820,31	107,90	108,95	109,99	75.956,00
05-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	CLSA3	28,98	1.797,00	52.075,25	28,37	28,94	29,13	1.670,00
05-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	ESPA3	18,99	2.051,00	38.941,28	18,54	18,93	19,13	4.999,00
05-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	GNDI3	80,48	622,00	50.061,47	79,18	80,46	82,49	15.742,00
05-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	24,17	2.462,00	59.498,27	22,96	23,59	24,24	21.977,00
05-08-21	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	Venda	IBOVI131	832,13	158,00	131.477,06		508,32		
06-08-21	FIA RVA EMB II	Compra	BBAS3	31,82	15.500,00	493.283,01	30,90	31,58	31,90	37.073,00
06-08-21	FIA RVA EMB II	Compra	ITUB4	30,95	76.100,00	2.355.419,00	29,95	30,64	31,04	65.779,00
06-08-21	FIA RVA EMB II	Venda	RDOR3	69,81	29.000,00	2.024.599,05	68,79	69,50	70,55	8.260,00
06-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ALSO3	27,61	500,00	13.807,14	27,32	27,60	27,83	4.018,00
06-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	AMER3	47,05	100,00	4.704,93	46,50	47,05	48,48	13.305,00
06-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	AMER3	46,50	200,00	9.300,00	46,50	47,05	48,48	13.305,00
06-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	AMER3	47,01	500,00	23.505,45	46,50	47,05	48,48	13.305,00
06-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	B3SA3	15,97	1.224,00	19.551,32	15,59	15,88	16,08	32.629,00
06-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	31,80	196,00	6.233,01	30,90	31,58	31,90	37.073,00
06-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	BRAP4	72,31	123,00	8.894,22	71,82	72,30	73,50	10.731,00
06-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	BRDT3	28,04	1.009,00	28.291,39	27,80	28,03	28,27	26.666,00
06-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	BRML3	10,08	1.400,00	14.115,51	9,93	10,09	10,23	20.387,00
06-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	BRML3	10,06	1.100,00	11.066,00	9,93	10,09	10,23	20.387,00
06-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CESP6	23,50	822,00	19.313,71	23,25	23,45	23,68	9.150,00
06-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	CPFE3	25,04	700,00	17.529,17	24,85	25,05	25,25	8.442,00
06-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	CPFE3	24,90	300,00	7.470,00	24,85	25,05	25,25	8.442,00
06-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CRFB3	19,10	664,00	12.681,80	18,71	19,06	19,23	15.268,00
06-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	CYRE3	20,12	900,00	18.109,22	19,60	20,01	20,23	19.253,00
06-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	CYRE3	20,05	2.131,00	42.726,55	19,60	20,01	20,23	19.253,00
06-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ELET6	40,79	800,00	32.633,17	39,66	40,75	41,36	4.758,00
06-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	42,30	300,00	12.690,00	42,12	42,35	42,72	6.145,00
06-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	42,24	300,00	12.673,22	42,12	42,35	42,72	6.145,00
06-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	23,79	3.700,00	88.011,70	23,51	23,82	24,10	31.962,00
06-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ESPA3	18,74	100,00	1.873,84	18,61	18,84	19,04	2.207,00
06-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	GMAT3	7,45	977,00	7.278,16	7,36	7,42	7,54	8.386,00
06-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	14,28	520,00	7.424,77	14,19	14,28	14,43	19.082,00
06-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	HBSA3	5,14	1.839,00	9.455,47	5,05	5,13	5,21	5.210,00
06-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	HYPE3	36,45	680,00	24.787,80	36,20	36,43	36,67	10.585,00
06-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	11,48	1.500,00	17.226,60	11,25	11,45	11,53	27.017,00
06-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	11,46	14.500,00	166.170,00	11,25	11,45	11,53	27.017,00
06-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	30,93	240,00	7.423,42	29,95	30,64	31,04	65.779,00
06-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	30,94	500,00	15.471,04	29,95	30,64	31,04	65.779,00
06-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	30,92	5.300,00	163.876,00	29,95	30,64	31,04	65.779,00
06-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	JBSS3	32,75	196,00	6.418,46	32,15	32,60	32,93	23.223,00
06-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	LRN3	41,38	303,00	12.539,06	40,88	41,34	41,87	28.201,00
06-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	NTOC3	54,82	475,00	26.039,75	54,02	54,69	55,19	14.824,00
06-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	OMGE3	35,50	203,00	7.207,39	34,72	35,49	35,78	4.303,00
06-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	PETR3	29,00	1.062,00	30.795,02	28,80	29,02	29,39	32.785,00
06-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	PRIO3	17,47	686,00	11.983,99	17,09	17,39	17,67	17.893,00
06-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	20,19	814,00	16.434,40	19,93	20,15	20,30	12.624,00
06-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	58,36	500,00	29.179,12	57,80	58,18	59,20	31.628,00
06-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	58,11	1.000,00	58.109,78	57,80	58,18	59,20	31.628,00
06-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	SEER3	15,68	499,00	7.826,12	15,31	15,59	15,77	1.871,00
06-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	17,52	600,00	10.512,87	16,71	17,50	18,07	10.112,00
06-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	17,22	700,00	12.054,00	16,71	17,50	18,07	10.112,00
06-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	54,26	1.124,00	60.983,90	54,07	54,42	55,25	12.442,00
06-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	TEND3	21,33	500,00	10.665,97	20,79	21,33	21,74	5.793,00
06-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	TEND3	21,21	800,00	16.967,18	20,79	21,33	21,74	5.793,00
06-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	VALE3	110,12	323,00	35.569,75	109,50	110,21	110,89	53.102,00
06-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	BRML3	10,09	10.944,00	110.473,15	9,93	10,09	10,23	20.387,00
06-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	CESP6	23,45	2.488,00	58.348,38	23,25	23,45	23,68	9.150,00
06-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	7,44	17.142,00	127.487,52	7,36	7,42	7,54	8.386,00
06-08-21	FIA RVA EMB IV	Venda	VALE3	110,21	5.466,00	602.387,68	109,50	110,21	110,89	53.102,00
06-08-21	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	PVBI11	95,17	8.480,00	807.068,54	94,69	95,28	95,74	3.979,00
09-08-21	FIA RVA EMB II	Compra	BBDC4	23,96	42.100,00	1.008.916,00	23,60	23,91	24,07	62.352,00
09-08-21	FIA RVA EMB II	Compra	ITUB4	31,24	66.200,00	2.067.910,00	30,77	31,25	31,43	69.706,00
09-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ALSO3	28,01	300,00	8.403,56	27,50	28,05	28,34	5.550,00
09-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	90,34	500,00	45.169,58	87,16	89,89	91,04	8.492,00
09-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	90,00	300,00	27.000,00	87,16	89,89	91,04	8.492,00
09-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	BRDT3	28,43	1.600,00	45.494,76	28,00	28,35	28,67	29.249,00
09-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	BRML3	10,09	900,00	9.081,00	10,03	10,13	10,26	15.977,00
09-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	BRML3	10,14	2.700,00	27.375,22	10,03	10,13	10,26	15.977,00
09-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CESP6	23,65	300,00	7.094,80	23,44	23,64	23,85	6.708,00
09-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	CPFE3	25,22	200,00	5.043,78	24,93	25,30	25,52	10.287,00
09-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CRFB3	19,00	1.300,00	24.698,79	18,90	19,04	19,38	13.269,00
09-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	CYRE3	20,35	1.800,00	36.630,00	19,95	20,38	20,61	19.250,00
09-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ELET6	40,57	1.300,00	52.742,42	40,15	40,55	41,20	5.710,00
09-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ELET6	40,46	200,00	8.091,73	40,15	40,55	41,20	5.710,00



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL
Mês de Referência: 01 DE AGOSTO DE 2021 À 31 DE AGOSTO DE 2021



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
09-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ESPA3	18,76	7.200,00	135.040,00	18,46	18,72	18,96	3.647,00
09-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	HBSA3	5,02	200,00	1.004,00	4,98	5,04	5,17	6.956,00
09-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	HYPE3	36,67	1.800,00	65.997,16	36,24	36,67	36,97	8.657,00
09-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	JBSS3	32,94	4.100,00	135.059,46	32,46	33,06	33,71	29.599,00
09-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	54,25	1.200,00	65.102,49	53,90	54,34	55,23	17.200,00
09-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	58,92	1.500,00	88.377,54	57,85	58,83	59,44	25.722,00
09-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	SULA11	29,07	400,00	11.628,00	28,98	29,18	29,55	12.998,00
09-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	BRML3	10,14	13.400,00	135.834,67	10,03	10,13	10,26	15.977,00
09-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	CLSA3	28,69	5.706,00	163.719,95	27,69	28,65	29,16	2.076,00
09-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	GNDI3	78,78	1.200,00	94.530,07	78,22	78,72	80,15	9.747,00
09-08-21	FIA RVA EMB IV	Venda	PETR4	28,02	21.745,00	609.186,53	27,67	28,02	28,21	118.853,00
09-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	PRIO3	17,29	9.573,00	165.548,28	16,81	17,25	17,75	26.386,00
09-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	RAI13	20,18	12.100,00	244.214,24	19,97	20,16	20,38	18.606,00
09-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	17,62	10.254,00	180.699,73	16,96	17,62	17,87	20.994,00
09-08-21	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	PVBI11	95,10	1.946,00	185.059,39	95,00	95,44	95,80	3.393,00
09-08-21	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	XPIN13	99,98	20.000,00	1.999.600,00	98,04	98,96	99,44	1.060,00
09-08-21	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	Compra	ONCO3	19,75	25.872,00	510.972,00	-	19,75	-	-
10-08-21	FIA RVA EMB II	Compra	ASA13	91,83	10.200,00	936.621,00	89,72	91,84	92,65	8.616,00
10-08-21	FIA RVA EMB II	Compra	JBSS3	32,65	21.500,00	701.963,00	32,49	32,66	33,12	22.574,00
10-08-21	FIA RVA EMB II	Compra	NTCO3	53,81	24.100,00	1.296.897,00	53,30	53,78	54,48	15.909,00
10-08-21	FIA RVA EMB II	Venda	RDOR3	69,90	33.100,00	2.313.631,00	69,57	70,02	70,68	10.148,00
10-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ALSO3	27,41	600,00	16.448,31	27,34	27,60	28,18	4.193,00
10-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	AMER3	45,53	1.500,00	68.296,65	44,94	45,63	46,75	12.408,00
10-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	BRDT3	28,64	2.500,00	71.593,91	28,42	28,70	29,02	31.942,00
10-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	BRML3	9,91	2.600,00	25.753,68	9,85	9,96	10,23	20.640,00
10-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CESP6	23,22	500,00	11.610,23	22,99	23,25	23,65	11.092,00
10-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CRFB3	18,87	900,00	16.982,18	18,65	18,86	19,00	18.551,00
10-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	CYRE3	20,10	4.400,00	88.418,00	19,96	20,15	20,48	15.588,00
10-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ELET6	40,41	700,00	28.286,66	39,72	40,19	40,80	5.785,00
10-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ELET6	40,43	100,00	4.042,88	39,72	40,19	40,80	5.785,00
10-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ESPA3	18,59	4.700,00	87.376,50	18,26	18,56	18,80	3.920,00
10-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	GMAT3	7,34	2.300,00	16.883,72	7,25	7,34	7,42	11.117,00
10-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	13,96	1.100,00	15.351,42	13,85	13,96	14,31	18.981,00
10-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	13,96	3.100,00	43.277,59	13,85	13,96	14,31	18.981,00
10-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	13,96	200,00	2.792,25	13,85	13,96	14,31	18.981,00
10-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	HYPE3	36,45	1.900,00	69.257,90	36,20	36,46	36,82	9.635,00
10-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	JBSS3	32,62	5.300,00	172.883,39	32,49	32,66	33,12	22.574,00
10-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	53,82	1.300,00	69.963,41	53,30	53,78	54,48	15.909,00
10-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	57,52	2.200,00	126.546,09	57,11	57,81	58,97	25.548,00
10-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	TEND3	21,27	200,00	4.254,33	21,15	21,40	21,88	5.422,00
10-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	TEND3	21,65	800,00	17.321,28	21,15	21,40	21,88	5.422,00
10-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	BPAC11	31,53	3.500,00	110.343,79	30,86	31,79	32,65	54.845,00
10-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	CLSA3	29,09	1.200,00	34.904,76	28,90	29,04	29,41	1.476,00
10-08-21	FIA RVA EMB IV	Venda	ELET3	40,32	5.600,00	225.804,66	39,84	40,24	40,79	12.766,00
10-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	MATD3	17,40	2.100,00	36.532,17	17,20	17,38	17,53	2.267,00
10-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	PRIO3	18,40	12.837,00	236.220,10	17,70	18,42	18,78	29.491,00
10-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	RAI13	19,79	1.800,00	35.614,78	19,53	19,77	20,17	23.831,00
10-08-21	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	PVBI11	95,44	890,00	84.944,50	94,96	95,26	95,70	3.120,00
10-08-21	FIM EMB V A INVEST NO EXT	Compra	SPY	442,62	450,00	199.179,00	-	442,68	-	-
10-08-21	FIM EMB V A INVEST NO EXT	Compra	VTU US	140,22	1.450,00	203.319,00	-	141,19	-	-
10-08-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Compra	MGLU3	20,31	6.500,00	132.015,00	20,13	20,39	20,76	47.468,00
10-08-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	VALE3	110,07	100,00	11.007,00	108,84	110,08	110,74	64.739,00
10-08-21	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	Compra	BPACH132	0,20	2.000,00	400,00	-	0,20	-	-
10-08-21	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	Venda	IBOVI131	440,00	7,00	3.080,00	-	401,25	-	-
11-08-21	FIA RVA EMB II	Compra	BBD4	23,71	75.000,00	1.777.899,85	23,10	23,53	23,84	46.894,00
11-08-21	FIA RVA EMB II	Venda	BIDI11	72,16	24.800,00	1.789.525,75	70,80	72,31	74,89	17.339,00
11-08-21	FIA RVA EMB II	Venda	GOLLA	19,51	104.700,00	2.042.900,32	19,42	19,53	19,78	9.925,00
11-08-21	FIA RVA EMB II	Venda	GOLLA	19,51	63.000,00	1.229.135,67	19,42	19,53	19,78	9.925,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ALSO3	27,34	300,00	8.201,20	26,54	27,24	27,59	4.523,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ALSO3	27,34	200,00	5.468,00	26,54	27,24	27,59	4.523,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	AMER3	45,24	500,00	22.619,67	44,67	45,24	45,80	13.428,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	AMER3	45,11	900,00	40.602,73	44,67	45,24	45,80	13.428,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ASA13	90,69	300,00	27.208,00	90,20	90,72	92,20	5.960,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	B3SA3	15,18	3.600,00	54.647,17	15,05	15,24	15,57	76.634,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	BBAAS3	30,55	200,00	6.110,00	30,23	30,58	30,84	34.770,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	BBRK3	2,03	700,00	1.423,00	2,00	2,05	2,13	2.087,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	BBS3	21,73	400,00	8.692,00	21,45	21,67	21,87	19.577,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	BKBR3	9,59	700,00	6.713,00	9,55	9,64	9,86	5.219,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	BMGB4	4,49	1.500,00	6.729,00	4,41	4,47	4,53	2.457,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	BRAP4	71,20	200,00	14.239,97	70,93	71,30	71,90	7.340,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	BRDT3	27,68	1.600,00	44.288,80	26,65	27,43	27,81	60.877,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	BRML3	9,90	8.200,00	81.166,03	9,78	9,89	9,99	13.761,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CCPR3	10,51	700,00	7.359,80	10,40	10,48	10,62	1.848,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CESP6	23,00	2.400,00	55.204,53	22,74	22,96	23,13	9.346,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CESP6	22,95	1.500,00	34.419,64	22,74	22,96	23,13	9.346,00



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL
Mês de Referência: 01 DE AGOSTO DE 2021 À 31 DE AGOSTO DE 2021



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
11-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CESP6	23,03	1.500,00	34.545,83	22,74	22,96	23,13	9.346,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	CPFE3	24,55	900,00	22.095,00	24,39	24,54	24,86	8.853,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	CPFE3	24,40	1.700,00	41.480,00	24,39	24,54	24,86	8.853,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	CPFE3	24,64	900,00	22.173,16	24,39	24,54	24,86	8.853,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CRFB3	18,96	1.000,00	18.957,23	18,71	18,91	19,10	12.646,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CRFB3	19,00	900,00	17.100,83	18,71	18,91	19,10	12.646,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	CYRE3	19,79	2.200,00	43.539,90	19,57	19,77	20,12	16.450,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ELET6	39,73	900,00	35.757,33	39,32	39,75	40,08	6.692,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	41,41	200,00	8.282,00	40,92	41,45	41,92	6.967,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	24,32	3.500,00	85.109,50	23,86	24,20	24,45	19.752,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ESPA3	17,75	2.000,00	35.500,00	17,58	17,89	18,31	3.209,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	EUCA4	9,59	600,00	5.754,00	9,47	9,63	9,98	396,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	GMAT3	7,38	2.500,00	18.462,05	7,28	7,37	7,44	6.039,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	GNDI3	76,88	900,00	69.195,08	75,46	76,66	78,09	26.286,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	13,96	1.100,00	15.356,00	13,65	13,86	14,11	26.960,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	HBSA3	4,66	10.100,00	47.066,00	4,65	4,69	4,97	7.606,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	HBSA3	4,73	1.800,00	8.522,13	4,65	4,69	4,97	7.606,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	HYPE3	36,57	1.200,00	43.888,30	35,63	36,21	36,74	11.657,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	HYPE3	36,60	1.000,00	36.598,30	35,63	36,21	36,74	11.657,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	IGTA3	38,77	2.000,00	77.546,62	38,08	38,72	39,37	10.123,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	IGTA3	39,06	200,00	7.812,67	38,08	38,72	39,37	10.123,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	IGTA3	38,23	100,00	3.822,96	38,08	38,72	39,37	10.123,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	11,64	8.600,00	100.115,71	11,36	11,57	11,74	37.782,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	30,95	800,00	24.760,28	30,14	30,82	31,29	58.451,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	JBS53	32,62	504,00	16.441,87	32,02	32,62	33,01	24.108,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	40,82	700,00	28.574,79	40,12	40,66	41,13	20.530,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	MDNE3	8,25	700,00	5.774,00	8,09	8,24	8,38	1.211,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	MULT3	23,02	200,00	4.603,00	22,73	22,97	23,17	12.791,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	52,75	800,00	42.196,23	52,37	52,81	53,42	16.702,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	OMGE3	34,43	500,00	17.213,33	33,96	34,49	34,95	2.840,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	PARD3	19,31	800,00	15.450,00	19,11	19,30	19,76	1.576,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	PETR3	29,30	2.600,00	76.192,11	28,61	29,16	29,60	27.490,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	POWE3	13,04	400,00	5.215,00	12,78	13,05	13,29	1.683,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	PRIO3	18,37	600,00	11.024,00	18,25	18,39	18,65	17.359,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	QUAL3	20,87	400,00	8.347,22	20,50	21,27	23,74	49.760,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	19,79	1.300,00	25.725,08	19,43	19,66	19,88	15.876,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	17,97	800,00	14.377,60	17,16	17,91	18,23	1.230,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	56,78	800,00	45.426,69	56,36	57,24	57,91	27.284,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	SEER3	15,64	600,00	9.386,00	15,52	15,75	16,18	3.709,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	17,99	1.600,00	28.781,34	17,12	17,68	18,15	4.848,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	17,98	1.100,00	19.780,55	17,12	17,68	18,15	4.848,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	SULA11	28,25	600,00	16.949,74	27,82	28,21	28,67	12.836,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	56,67	1.000,00	56.665,00	55,85	56,46	57,08	24.134,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	TCSA3	6,54	800,00	5.233,00	6,51	6,58	6,67	1.425,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	TEND3	20,94	1.400,00	29.318,62	20,84	20,99	21,35	4.327,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	TIMS3	11,47	500,00	5.737,00	11,18	11,39	11,56	16.782,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	VALE3	109,59	600,00	65.753,67	109,26	109,77	110,50	41.697,00
11-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	WEST3	9,56	200,00	1.911,00	9,41	9,55	9,94	983,00
11-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	CESP6	22,96	1.567,00	35.986,03	22,74	22,96	23,13	9.346,00
11-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	CLSA3	28,79	1.007,00	28.993,79	28,50	28,77	29,67	2.713,00
11-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	GNDI3	77,58	1.508,00	116.991,94	75,46	76,66	78,09	26.286,00
12-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	26,65	900,00	23.986,00	26,47	26,72	27,33	3.927,00
12-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	AMER3	46,99	1.900,00	89.285,00	45,11	46,74	47,99	21.794,00
12-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	B3SA3	14,07	1.900,00	26.730,40	13,85	14,17	14,68	121.429,00
12-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	B3SA3	14,14	3.600,00	50.892,11	13,85	14,17	14,68	121.429,00
12-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	B3SA3	14,01	25.100,00	351.770,47	13,85	14,17	14,68	121.429,00
12-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	BRML3	9,82	500,00	4.908,41	9,67	9,76	9,85	17.435,00
12-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CESP6	22,91	700,00	16.034,94	22,80	22,92	23,10	4.945,00
12-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	CPFE3	24,47	600,00	14.684,69	24,26	24,47	24,71	6.022,00
12-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CRFB3	18,98	600,00	11.387,91	18,73	18,97	19,15	14.504,00
12-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CRFB3	19,01	400,00	7.604,79	18,73	18,97	19,15	14.504,00
12-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	39,67	1.700,00	67.444,70	38,92	39,57	40,19	13.460,00
12-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ELET6	39,43	2.300,00	90.692,23	39,00	39,65	40,42	7.000,00
12-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ESPA3	17,68	200,00	3.535,64	17,32	17,70	18,08	3.940,00
12-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ESPA3	17,70	300,00	5.308,93	17,32	17,70	18,08	3.940,00
12-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	GMAT3	7,38	1.300,00	9.592,33	7,29	7,36	7,42	6.850,00
12-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	GMAT3	7,37	1.100,00	8.102,10	7,29	7,36	7,42	6.850,00
12-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	GNDI3	82,68	100,00	8.268,00	76,65	81,39	82,82	26.590,00
12-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	HGTX3	38,87	200,00	7.773,00	37,59	38,64	39,61	11.563,00
12-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	HYPE3	36,44	1.200,00	43.724,60	36,10	36,39	36,93	14.546,00
12-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	HYPE3	36,36	100,00	3.635,72	36,10	36,39	36,93	14.546,00
12-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	HYPE3	36,26	1.100,00	39.886,61	36,10	36,39	36,93	14.546,00
12-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	HYPE3	36,33	1.500,00	54.493,23	36,10	36,39	36,93	14.546,00
12-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	IGTA3	38,31	300,00	11.493,77	37,66	38,12	38,76	8.343,00
12-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	IGTA3	38,15	3.400,00	129.710,00	37,66	38,12	38,76	8.343,00



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL
Mês de Referência: 01 DE AGOSTO DE 2021 À 31 DE AGOSTO DE 2021



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
12-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	IGTA3	38,21	900,00	34.389,00	37,66	38,12	38,76	8.343,00
12-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	LREN3	40,33	200,00	8.066,00	39,91	40,44	41,02	28.257,00
12-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	LREN3	40,36	1.000,00	40.361,52	39,91	40,44	41,02	28.257,00
12-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	52,69	900,00	47.423,00	52,00	52,60	53,02	23.693,00
12-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	19,55	1.400,00	27.375,00	19,42	19,58	19,82	17.524,00
12-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	58,50	2.100,00	122.859,00	56,32	58,14	58,89	33.684,00
12-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	18,39	300,00	5.517,00	17,97	18,58	19,23	10.073,00
12-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	18,23	400,00	7.292,00	17,97	18,58	19,23	10.073,00
12-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	18,46	200,00	3.692,97	17,97	18,58	19,23	10.073,00
12-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	18,50	3.600,00	66.598,08	17,97	18,58	19,23	10.073,00
12-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	18,22	900,00	16.398,00	17,97	18,58	19,23	10.073,00
12-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	SULA11	27,90	600,00	16.742,99	27,64	28,78	29,27	28.327,00
12-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	SULA11	28,20	400,00	11.280,00	27,64	28,78	29,27	28.327,00
12-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	SULA11	28,50	1.300,00	37.049,00	27,64	28,78	29,27	28.327,00
12-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	55,50	100,00	5.550,00	55,00	55,75	57,08	27.278,00
12-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	TEND3	20,67	400,00	8.269,95	20,44	20,64	20,89	4.664,00
12-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	VALE3	109,38	200,00	21.875,00	108,83	109,42	109,98	62.936,00
12-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	MAATD3	18,00	1.856,00	33.416,65	17,09	17,93	18,35	4.423,00
12-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	15,23	5.402,00	82.279,64	15,10	15,45	16,14	51.906,00
13-08-21	FIA RVA EMB II	Venda	AMER3	43,88	42.462,00	1.863.023,50	41,42	43,38	47,49	31.832,00
13-08-21	FIA RVA EMB II	Compra	INTB3	27,44	33.000,00	905.566,31	27,02	27,83	28,60	6.752,00
13-08-21	FIA RVA EMB II	Compra	LAME4	6,11	151.300,00	924.767,00	5,89	6,09	6,65	32.581,00
13-08-21	FIA RVA EMB II	Venda	SBSP3	33,49	60.000,00	2.009.170,00	33,19	33,56	34,49	16.325,00
13-08-21	FIA RVA EMB II	Compra	TIMS3	11,63	248.900,00	2.894.113,00	11,49	11,64	11,74	14.404,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	26,41	2.200,00	58.105,08	26,08	26,50	26,80	5.645,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	AMER3	43,02	2.600,00	111.862,23	41,42	43,38	47,49	31.832,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	17,70	2.200,00	38.947,49	17,34	17,72	18,12	18.059,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	B3SA3	14,10	3.900,00	55.009,44	13,67	14,27	14,72	97.139,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	29,44	900,00	26.491,50	29,19	29,39	30,03	43.129,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	20,65	1.000,00	20.650,50	20,53	20,67	20,99	23.449,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	BKBR3	9,41	1.000,00	9.411,64	9,33	9,47	9,70	7.752,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	BMGB4	4,25	2.000,00	8.507,92	4,22	4,30	4,44	4.435,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	BRAP4	69,81	600,00	41.886,15	69,23	69,79	70,13	9.988,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	BRDT3	27,07	4.900,00	132.665,05	26,59	27,02	27,25	44.315,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	BRML3	9,57	11.900,00	113.828,06	9,43	9,56	9,74	24.600,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	BRML3	9,60	9.100,00	87.320,17	9,43	9,56	9,74	24.600,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CCPR3	10,14	900,00	9.123,58	10,06	10,15	10,53	2.214,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CESP6	23,05	4.200,00	96.800,48	22,80	23,03	23,19	7.181,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CPEF3	26,17	7.100,00	185.839,90	24,66	25,88	26,45	16.734,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CRFB3	18,75	3.100,00	58.117,66	18,64	18,77	19,00	17.374,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CYRE3	19,24	1.300,00	25.006,57	18,97	19,39	20,06	24.254,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	38,64	2.500,00	96.590,24	38,20	38,70	39,32	15.921,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	38,84	500,00	19.422,43	38,20	38,70	39,32	15.921,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ELET6	38,65	2.100,00	81.158,82	38,21	38,69	39,24	7.655,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	43,03	800,00	34.423,01	41,24	42,91	43,45	15.886,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	43,03	800,00	34.426,09	41,24	42,91	43,45	15.886,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	24,15	6.600,00	159.397,51	23,93	24,15	24,37	15.980,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ESPA3	17,42	900,00	15.681,54	17,24	17,46	18,06	3.874,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	GMAT3	7,14	7.600,00	54.275,61	7,09	7,16	7,41	12.884,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	GNDI3	85,31	400,00	34.125,18	82,63	85,47	86,75	31.470,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	15,48	3.100,00	47.995,57	15,01	15,44	15,74	43.767,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	15,43	5.600,00	86.384,00	15,01	15,44	15,74	43.767,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	HBSA3	4,53	5.800,00	26.249,78	4,44	4,52	4,71	6.618,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	HGTX3	40,43	300,00	12.127,68	38,59	40,35	41,02	16.157,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	HYPE3	36,43	100,00	3.642,60	35,96	36,40	36,73	19.484,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	HYPE3	36,43	300,00	10.927,62	35,96	36,40	36,73	19.484,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	HYPE3	36,34	2.800,00	101.763,87	35,96	36,40	36,73	19.484,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	IGTA3	37,47	500,00	18.734,29	37,12	37,58	38,51	5.902,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	11,41	8.000,00	91.243,12	11,27	11,41	11,52	44.038,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	30,51	900,00	27.455,86	30,12	30,57	30,94	68.060,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	40,87	2.100,00	85.833,07	39,52	40,69	41,57	40.549,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	MDNE3	8,33	1.200,00	9.997,01	8,09	8,35	8,48	1.731,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	MULT3	22,39	400,00	8.956,91	22,22	22,45	22,90	11.045,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	54,27	100,00	5.426,63	53,15	54,42	54,97	38.322,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	OMGE3	34,08	1.400,00	47.713,90	33,81	34,21	34,42	2.639,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	PARD3	19,00	1.900,00	36.095,57	18,85	19,07	19,46	1.615,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	PETR3	29,82	4.000,00	119.270,22	29,37	29,77	30,05	27.174,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	POWE3	13,66	400,00	5.464,21	13,48	13,70	14,08	1.186,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	17,32	2.100,00	36.363,49	17,20	17,39	18,01	22.403,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	QUAL3	19,05	600,00	11.429,64	18,70	19,22	20,18	20.136,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	19,08	4.800,00	91.566,93	18,89	19,08	19,37	36.887,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	17,34	1.100,00	19.077,93	17,16	17,47	17,99	959,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	57,25	3.500,00	200.385,28	56,73	57,33	58,31	30.715,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	SEER3	14,21	1.500,00	21.311,72	13,95	14,45	15,39	6.598,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	19,76	1.400,00	27.664,65	19,15	19,76	20,29	20.944,00



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL
Mês de Referência: 01 DE AGOSTO DE 2021 À 31 DE AGOSTO DE 2021



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	SULA11	29,14	6.000,00	174.831,66	28,44	29,16	29,70	20.099,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	56,74	2.900,00	164.550,00	55,22	56,64	57,78	28.177,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	TCSA3	6,29	1.200,00	7.551,88	6,20	6,35	6,61	1.813,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	TEND3	20,78	3.500,00	72.722,70	20,56	20,84	21,17	7.678,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	TIMS3	11,63	800,00	9.303,86	11,49	11,64	11,74	14.404,00
13-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	VALE3	108,49	1.200,00	130.182,25	107,96	108,56	109,90	43.662,00
13-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	CLSA3	27,85	809,00	22.530,61	27,66	27,95	29,10	1.194,00
13-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	GNDI3	86,08	3.695,00	318.067,53	82,63	85,47	86,75	31.470,00
13-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	MATD3	18,97	607,00	11.514,88	18,02	18,94	19,32	2.900,00
13-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	RAIL3	19,01	6.057,00	115.149,25	18,89	19,08	19,37	36.887,00
13-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	15,52	7.897,00	122.596,98	15,17	15,47	15,74	28.437,00
16-08-21	FIA RVA EMB II	Venda	AMER3	43,42	24.100,00	1.046.397,00	40,80	41,81	44,35	27.516,00
16-08-21	FIA RVA EMB II	Venda	BIDI11	65,08	9.900,00	644.313,94	63,41	64,72	66,10	22.419,00
16-08-21	FIA RVA EMB II	Compra	INTB3	26,68	27.100,00	723.143,66	25,20	26,25	28,11	18.377,00
16-08-21	FIA RVA EMB II	Venda	PNVL3	17,69	30.600,00	541.321,00	17,50	17,70	18,01	3.289,00
16-08-21	FIA RVA EMB II	Compra	UGPA3	15,86	52.100,00	826.179,24	15,41	15,79	16,32	29.848,00
16-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	BRDT3	26,74	200,00	5.348,00	26,20	26,65	27,31	45.500,00
16-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	BRML3	9,45	8.700,00	82.187,08	9,36	9,46	9,62	24.130,00
16-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	BRML3	9,56	2.600,00	24.856,00	9,36	9,46	9,62	24.130,00
16-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	BRML3	9,39	1.100,00	10.329,00	9,36	9,46	9,62	24.130,00
16-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	BRML3	9,56	300,00	2.867,00	9,36	9,46	9,62	24.130,00
16-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CESP6	23,13	900,00	20.818,37	22,96	23,16	23,36	9.428,00
16-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CPFE3	26,95	1.900,00	51.198,09	26,23	26,92	27,50	22.468,00
16-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CPFE3	26,98	500,00	13.490,10	26,23	26,92	27,50	22.468,00
16-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	CYRE3	19,09	200,00	3.817,40	18,49	18,92	19,29	29.709,00
16-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	37,85	1.000,00	37.853,26	37,59	37,93	39,10	26.052,00
16-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	43,43	400,00	17.372,28	42,55	43,40	43,68	12.625,00
16-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ESPA3	16,15	1.500,00	24.224,59	15,91	16,32	17,28	9.898,00
16-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ESPA3	16,53	1.400,00	23.141,13	15,91	16,32	17,28	9.898,00
16-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ESPA3	16,45	1.100,00	18.099,31	15,91	16,32	17,28	9.898,00
16-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	14,98	400,00	5.990,00	14,79	15,07	15,46	22.805,00
16-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	HBSA3	4,10	3.900,00	15.990,00	4,09	4,14	4,45	13.508,00
16-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	HYPE3	35,35	200,00	7.070,00	35,10	35,58	36,61	13.200,00
16-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	HYPE3	35,33	1.200,00	42.392,29	35,10	35,58	36,61	13.200,00
16-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	30,65	2.100,00	64.362,33	30,27	30,61	31,16	90.969,00
16-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	LREN3	39,33	2.000,00	78.663,31	39,00	39,51	41,15	42.926,00
16-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	LREN3	39,58	600,00	23.749,09	39,00	39,51	41,15	42.926,00
16-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	MDNE3	7,81	200,00	1.562,75	7,67	7,84	8,30	2.091,00
16-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	53,31	2.700,00	143.932,68	52,71	53,36	54,60	31.743,00
16-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	55,92	200,00	11.183,99	55,52	56,21	57,46	29.436,00
16-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	57,47	100,00	5.747,00	56,44	57,60	58,05	34.818,00
16-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	TCSA3	6,27	200,00	1.253,05	6,10	6,24	6,37	2.718,00
16-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	6,99	5.094,00	35.631,58	6,95	7,00	7,17	14.597,00
16-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	GNDI3	83,23	704,00	58.594,33	81,77	83,26	85,16	20.293,00
16-08-21	FIA RVA EMB IV	Venda	PETRA	28,64	20.923,00	599.224,20	28,24	28,70	29,24	140.055,00
16-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	RAIL3	18,62	3.081,00	57.379,71	18,34	18,64	19,08	25.845,00
16-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	15,76	7.585,00	119.520,70	15,41	15,79	16,32	29.848,00
16-08-21	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	Venda	IBOV1131	195,00	9,00	1.755,00	170,03	170,03		
17-08-21	FIA RVA EMB II	Compra	INTB3	25,25	44.300,00	1.118.419,82	24,21	25,22	25,93	15.905,00
17-08-21	FIA RVA EMB II	Venda	PNVL3	17,53	1.200,00	21.040,00	16,84	17,19	17,58	6.858,00
17-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ALSO3	25,00	300,00	7.500,98	24,58	25,09	26,04	8.427,00
17-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ALSO3	25,10	100,00	2.510,00	24,58	25,09	26,04	8.427,00
17-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ALSO3	25,04	1.700,00	42.573,77	24,58	25,09	26,04	8.427,00
17-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	B3SA3	13,74	3.000,00	41.207,46	13,54	13,78	14,11	68.103,00
17-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	BRML3	9,28	5.600,00	51.942,57	9,09	9,23	9,42	24.113,00
17-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	BRML3	9,25	1.600,00	14.802,40	9,09	9,23	9,42	24.113,00
17-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CESP6	22,81	1.100,00	25.092,19	22,52	22,77	23,07	17.655,00
17-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CPFE3	26,81	2.000,00	53.618,87	26,34	26,81	27,17	17.175,00
17-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	CYRE3	18,31	2.100,00	38.446,22	18,05	18,36	18,96	27.198,00
17-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	38,12	300,00	11.437,00	37,45	38,18	39,02	28.027,00
17-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	38,12	300,00	11.436,28	37,45	38,18	39,02	28.027,00
17-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ELET6	37,74	200,00	7.548,00	37,62	38,13	39,04	10.665,00
17-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	43,23	800,00	34.583,14	42,65	43,28	43,87	14.108,00
17-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	43,32	700,00	30.326,39	42,65	43,28	43,87	14.108,00
17-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	23,85	200,00	4.770,71	23,25	23,63	24,10	31.397,00
17-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ESPA3	15,39	2.800,00	43.087,13	15,16	15,55	16,07	12.730,00
17-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ESPA3	15,70	2.900,00	45.527,87	15,16	15,55	16,07	12.730,00
17-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	HYPE3	33,83	500,00	16.917,39	33,42	34,23	35,65	26.186,00
17-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	IGTA3	35,28	600,00	21.168,66	34,76	35,48	36,68	13.204,00
17-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	30,21	3.800,00	114.781,00	29,74	30,13	30,58	94.937,00
17-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	MULT3	21,28	3.100,00	65.969,95	20,94	21,33	21,91	25.550,00
17-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	51,98	300,00	15.594,19	51,49	52,18	53,40	39.420,00
17-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	PETR3	28,03	3.500,00	98.114,27	27,34	27,80	28,45	41.735,00
17-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	16,47	700,00	11.525,55	16,22	16,49	16,85	31.451,00
17-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	18,26	900,00	16.436,99	18,04	18,34	18,62	27.746,00



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL
Mês de Referência: 01 DE AGOSTO DE 2021 À 31 DE AGOSTO DE 2021



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
17-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	15,60	1.000,00	15.600,00	14,81	15,44	16,16	10.543,00
17-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	54,39	1.200,00	65.272,02	52,93	54,16	56,08	46.238,00
17-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	18,23	3.500,00	63.789,63	17,63	18,23	18,67	12.749,00
17-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	SULA11	28,34	900,00	25.510,34	28,04	28,39	28,98	15.862,00
17-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	TCSA3	6,07	900,00	5.465,90	5,92	6,09	6,35	4.180,00
17-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	TEND3	20,08	1.200,00	24.095,03	19,65	20,07	20,63	7.911,00
17-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	VALE3	108,86	500,00	54.432,19	105,66	106,89	109,32	68.107,00
17-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	WEST3	7,01	700,00	4.907,46	6,82	7,03	7,78	3.098,00
17-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	WEST3	6,99	5.000,00	34.950,82	6,82	7,03	7,78	3.098,00
17-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	ESPA3	15,60	5.434,00	84.770,40	15,16	15,55	16,07	12.730,00
17-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	6,96	7.900,00	54.988,92	6,83	6,95	7,07	15.732,00
17-08-21	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	Compra	IBOV1131	140,00	174,00	24.360,00		172,17		
18-08-21	FIA RVA EMB II	Venda	PNVL3	17,50	400,00	7.000,00	17,06	17,22	17,54	6.088,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ALSO3	25,05	500,00	12.525,16	24,68	24,94	25,31	9.099,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ALSO3	25,03	2.200,00	55.055,55	24,68	24,94	25,31	9.099,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	AMER3	40,73	1.100,00	44.805,00	38,88	40,18	42,32	31.701,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ASA13	16,85	1.100,00	18.533,90	16,41	16,69	17,10	27.983,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	B3SA3	13,75	2.100,00	28.865,37	13,45	13,79	14,16	84.668,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	29,79	400,00	11.917,19	29,27	29,69	30,09	44.595,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	19,79	400,00	7.916,20	19,62	19,82	20,03	26.011,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	BRAP4	67,33	300,00	20.199,00	66,91	67,50	68,66	13.894,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	BRDT3	26,20	2.000,00	52.401,20	25,91	26,19	26,62	45.507,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	BRML3	9,28	3.200,00	29.700,03	9,16	9,28	9,40	52.709,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	CESP6	22,70	1.900,00	43.136,00	22,36	22,58	22,81	11.134,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CPEF3	26,84	300,00	8.051,61	26,37	26,73	27,10	15.530,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CPEF3	26,92	600,00	16.152,00	26,37	26,73	27,10	15.530,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	CRFB3	18,16	1.300,00	23.611,10	17,84	18,04	18,28	20.888,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	CYRE3	18,36	700,00	12.851,20	18,11	18,41	18,77	28.902,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	CYRE3	18,51	500,00	9.252,50	18,11	18,41	18,77	28.902,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	CYRE3	18,15	500,00	9.075,00	18,11	18,41	18,77	28.902,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	CYRE3	18,34	8.900,00	163.230,97	18,11	18,41	18,77	28.902,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ELET6	38,04	900,00	34.240,41	37,11	37,69	38,51	13.005,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	42,53	700,00	29.770,49	42,04	42,52	42,98	11.166,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	23,41	2.900,00	67.900,81	23,13	23,38	23,67	33.524,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ESPA3	16,37	500,00	8.183,69	15,20	15,70	16,80	5.997,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	GMAT3	7,01	2.500,00	17.533,26	6,90	7,00	7,07	18.227,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	GNDI3	80,59	200,00	16.117,50	78,55	80,03	81,97	22.943,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	14,69	1.200,00	17.623,40	14,37	14,60	14,81	31.692,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	HBSA3	4,48	2.100,00	9.410,50	4,18	4,40	4,65	12.349,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	HYPE3	34,37	1.100,00	37.805,84	33,51	34,23	35,09	25.502,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	11,35	4.600,00	52.187,73	11,12	11,27	11,50	68.497,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	30,60	3.100,00	94.855,30	30,01	30,56	31,12	86.365,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	LREN3	39,15	700,00	27.406,17	38,38	39,06	39,88	37.035,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	LREN3	39,26	900,00	35.334,40	38,38	39,06	39,88	37.035,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	MULT3	21,48	1.500,00	32.221,64	21,16	21,46	21,78	21.402,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	52,64	1.100,00	57.909,22	51,90	52,40	53,34	39.565,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	OMGE3	33,20	600,00	19.917,31	32,45	33,00	33,44	2.783,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	PARD3	21,53	300,00	6.458,38	20,50	21,21	21,91	3.727,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	PETR3	27,81	2.100,00	58.404,15	27,39	27,68	28,08	37.033,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	PRIO3	17,59	800,00	14.075,72	16,32	17,13	17,97	44.116,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	QUAL3	20,12	300,00	6.036,00	19,41	19,90	20,29	25.989,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	18,20	2.800,00	50.957,39	18,05	18,22	18,55	34.715,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	18,23	2.900,00	52.877,38	18,05	18,22	18,55	34.715,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	18,25	2.100,00	38.334,45	18,05	18,22	18,55	34.715,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	15,54	600,00	9.325,78	15,06	15,29	15,79	5.101,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	55,56	2.100,00	116.681,25	53,42	54,93	56,18	45.815,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	55,70	100,00	5.569,82	53,42	54,93	56,18	45.815,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	SEER3	13,84	700,00	9.689,85	13,38	13,70	14,00	6.687,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	18,33	1.300,00	23.827,35	17,87	18,33	19,01	10.628,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	SULA11	28,55	1.900,00	54.248,11	28,13	28,40	28,95	18.573,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	56,44	1.100,00	62.083,44	56,10	56,84	57,84	32.546,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	TCSA3	6,10	1.600,00	9.762,73	5,95	6,09	6,22	3.644,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	TEND3	20,39	2.400,00	48.924,97	19,69	20,13	20,65	9.816,00
18-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	TEND3	20,21	700,00	14.150,01	19,69	20,13	20,65	9.816,00
18-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	ESPA3	15,55	8.187,00	127.319,70	15,20	15,70	16,80	5.997,00
18-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	MATD3	19,48	3.059,00	59.596,16	19,23	19,63	20,20	2.352,00
18-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	PRIO3	17,61	6.474,00	113.976,44	16,32	17,13	17,97	44.116,00
18-08-21	FIM EMB II A	Venda	IBOV1124	2.066,00	35,00	72.310,00		1.631,75		
18-08-21	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	XPIN14	99,98	20.000,00	1.999.600,00	95,50	95,79	96,30	1.592,00
18-08-21	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	Compra	LAME3	5,15	141.782,00	730.106,41	4,94	5,15	5,40	17.555,00
19-08-21	FIA RVA EMB II	Compra	BBAS3	29,74	36.100,00	1.073.628,59	29,12	29,66	29,91	29.711,00
19-08-21	FIA RVA EMB II	Venda	BIDI11	62,05	26.200,00	1.625.663,20	60,01	62,37	66,00	21.892,00
19-08-21	FIA RVA EMB II	Compra	C3NA3	37,27	10.200,00	380.169,11	36,60	37,17	37,93	38.798,00
19-08-21	FIA RVA EMB II	Venda	PNVL3	17,92	53.900,00	965.875,00	16,90	17,68	18,38	8.141,00
19-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	25,63	100,00	2.563,00	24,26	25,49	25,90	7.662,00



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL
Mês de Referência: 01 DE AGOSTO DE 2021 À 31 DE AGOSTO DE 2021



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
19-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	25,85	200,00	5.170,05	24,26	25,49	25,90	7.662,00
19-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	AMER3	39,61	400,00	15.845,27	38,45	39,96	41,32	27.631,00
19-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	BRML3	9,29	3.300,00	30.649,62	9,10	9,28	9,40	23.545,00
19-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CPFE3	27,48	600,00	16.485,00	26,26	27,15	27,69	12.416,00
19-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CPFE3	26,99	900,00	24.291,00	26,26	27,15	27,69	12.416,00
19-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	CYRE3	18,28	400,00	7.311,98	17,90	18,26	18,51	20.974,00
19-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	43,29	700,00	30.302,36	41,79	43,26	43,91	12.451,00
19-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	24,34	1.300,00	31.641,35	22,89	24,09	24,49	28.151,00
19-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	GMAT3	7,44	300,00	2.232,00	6,92	7,23	7,44	9.943,00
19-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	30,20	2.700,00	81.536,05	29,65	30,07	30,83	82.891,00
19-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	MDNE3	7,69	400,00	3.074,34	7,30	7,60	7,88	2.572,00
19-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	PARD3	21,77	1.300,00	28.306,35	20,54	21,63	22,30	3.152,00
19-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	17,78	4.600,00	81.774,94	17,50	17,87	18,26	39.753,00
19-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	18,10	3.400,00	61.527,97	17,90	18,29	18,76	11.641,00
19-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	18,03	2.500,00	45.082,70	17,90	18,29	18,76	11.641,00
19-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	18,40	1.800,00	33.117,02	17,90	18,29	18,76	11.641,00
19-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	SULA11	28,47	1.300,00	37.015,38	27,64	28,35	28,73	14.389,00
19-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ITCSA3	5,99	700,00	4.196,05	5,91	6,00	6,14	2.405,00
19-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	CESP6	22,63	2.926,00	66.225,01	22,23	22,79	23,27	13.176,00
19-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	ESPA3	17,33	5.865,00	101.635,56	15,56	17,04	17,38	5.255,00
19-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	MATD3	20,14	824,00	16.598,02	19,64	20,37	20,99	2.031,00
19-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	PRI03	17,94	6.629,00	118.946,66	16,65	17,62	18,31	36.984,00
19-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	RAIL3	18,13	5.731,00	103.887,09	17,50	17,87	18,26	39.753,00
20-08-21	FIA RVA EMB II	Compra	TIMS3	12,02	123.700,00	1.486.282,74	11,79	12,01	12,20	14.914,00
20-08-21	FIA RVA EMB II	Venda	YDUQ3	25,52	66.100,00	1.686.634,00	24,21	25,41	26,20	17.765,00
20-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	25,36	300,00	7.608,00	25,31	25,69	25,93	5.815,00
20-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	25,77	200,00	5.154,61	25,31	25,69	25,93	5.815,00
20-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	25,72	500,00	12.860,22	25,31	25,69	25,93	5.815,00
20-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	BRML3	9,34	2.300,00	21.482,40	9,20	9,40	9,53	23.256,00
20-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	BRML3	9,49	1.200,00	11.385,96	9,20	9,40	9,53	23.256,00
20-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CPFE3	27,90	1.200,00	33.482,35	27,14	27,88	28,15	12.076,00
20-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	CYRE3	18,56	300,00	5.567,30	18,15	18,49	18,84	18.475,00
20-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	38,22	400,00	15.286,63	37,55	38,03	38,43	10.824,00
20-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	38,13	400,00	15.251,13	37,55	38,03	38,43	10.824,00
20-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	43,90	400,00	17.560,00	43,02	43,91	44,52	9.103,00
20-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	44,22	400,00	17.687,74	43,02	43,91	44,52	9.103,00
20-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	25,15	3.300,00	82.989,83	24,00	24,96	25,53	26.300,00
20-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	24,70	700,00	17.290,00	24,00	24,96	25,53	26.300,00
20-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	MDNE3	7,89	300,00	2.366,98	7,60	7,89	8,18	2.631,00
20-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	MULT3	21,70	400,00	8.678,91	21,14	21,50	21,78	24.926,00
20-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	PARD3	23,24	400,00	9.294,20	22,05	22,97	23,38	2.894,00
20-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	PARD3	23,28	300,00	6.985,48	22,05	22,97	23,38	2.894,00
20-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	18,73	900,00	16.858,64	17,95	18,74	19,16	10.889,00
20-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	SULA11	29,17	800,00	23.333,13	28,04	29,21	29,77	15.233,00
20-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	56,25	300,00	16.875,00	55,50	56,69	57,22	37.405,00
20-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	56,84	1.000,00	56.844,28	55,50	56,69	57,22	37.405,00
20-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	TEND3	20,15	500,00	10.073,68	19,58	20,17	20,38	4.506,00
20-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	25,75	100,00	2.574,62	24,21	25,41	26,20	17.765,00
20-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	ESPA3	17,20	1.914,00	32.915,28	16,74	17,13	17,38	2.970,00
20-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	GNDI3	83,75	961,00	80.482,23	80,75	84,20	85,51	15.240,00
20-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	15,51	1.370,00	21.243,83	14,70	15,40	15,71	29.203,00
20-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	MATD3	21,10	641,00	13.524,37	20,43	21,06	21,29	1.950,00
23-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	AMER3	39,20	300,00	11.760,00	39,10	39,88	41,77	19.963,00
23-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	CYRE3	18,23	200,00	3.646,16	18,06	18,26	18,80	18.901,00
23-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	37,63	700,00	26.342,15	37,30	37,60	38,13	20.560,00
23-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	37,59	900,00	33.834,70	37,30	37,60	38,13	20.560,00
23-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	43,66	700,00	30.562,34	43,26	43,71	44,41	6.858,00
23-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	43,88	100,00	4.387,93	43,26	43,71	44,41	6.858,00
23-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	IGTA3	35,90	500,00	17.951,05	35,40	35,88	36,86	7.534,00
23-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	IGTA3	35,87	200,00	7.174,00	35,40	35,88	36,86	7.534,00
23-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	MDNE3	7,91	200,00	1.582,22	7,77	7,94	8,34	1.540,00
23-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	MULT3	21,26	1.400,00	29.764,21	21,16	21,32	21,88	18.126,00
23-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	PARD3	23,05	200,00	4.609,62	22,18	22,75	23,60	3.685,00
23-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	SULA11	29,30	600,00	17.580,87	28,94	29,32	29,95	17.469,00
23-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ITCSA3	6,01	300,00	1.803,65	5,96	6,03	6,20	2.100,00
23-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	ESPA3	16,95	137,00	2.321,66	16,72	16,98	17,49	4.677,00
23-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	PRI03	18,75	6.547,00	122.754,36	18,23	18,69	18,88	33.925,00
23-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	RAIL3	18,35	3.350,00	61.460,27	18,05	18,35	18,49	22.791,00
23-08-21	FIM EMB III I IMOBILIÁRIO	Venda	WISC13	106,19	16,00	1.699,04	101,79	102,31	105,40	7.101,00
24-08-21	FIA RVA EMB II	Compra	BBAS3	30,37	42.100,00	1.278.372,00	30,12	30,53	30,76	27.844,00
24-08-21	FIA RVA EMB II	Compra	ITSA4	11,43	297.800,00	3.403.545,52	11,25	11,42	11,49	24.669,00
24-08-21	FIA RVA EMB II	Compra	LAME4	5,52	93.700,00	517.645,00	5,30	5,65	5,91	35.094,00
24-08-21	FIA RVA EMB II	Venda	YDUQ3	27,82	55.900,00	1.555.242,00	26,73	27,82	28,29	8.768,00
24-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	BRML3	9,49	1.000,00	9.491,44	9,40	9,49	9,58	21.967,00
24-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	BRML3	9,50	1.100,00	10.446,33	9,40	9,49	9,58	21.967,00



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL
Mês de Referência: 01 DE AGOSTO DE 2021 À 31 DE AGOSTO DE 2021



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
19-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	25,85	200,00	5.170,05	24,26	25,49	25,90	7.662,00
24-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CPFE3	28,69	1.000,00	28.692,66	27,71	28,45	28,80	11.789,00
24-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	CYRE3	19,51	300,00	5.854,30	18,43	19,85	20,51	37.258,00
24-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	45,05	200,00	9.010,00	43,76	44,64	45,17	8.893,00
24-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	25,52	400,00	10.206,88	24,74	25,35	25,85	24.159,00
24-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	25,60	500,00	12.800,09	24,74	25,35	25,85	24.159,00
24-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	25,46	200,00	5.092,00	24,74	25,35	25,85	24.159,00
24-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	MDNE3	8,05	100,00	804,94	7,85	8,13	8,32	1.748,00
24-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	PRIO3	19,21	200,00	3.841,73	18,75	19,15	19,42	27.134,00
24-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	16,30	200,00	3.260,03	15,94	16,34	16,61	2.226,00
24-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	TCSA3	6,11	700,00	4.280,37	5,99	6,14	6,30	3.890,00
24-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	TEND3	20,56	500,00	10.277,59	19,69	20,55	20,95	12.310,00
24-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	ESPA3	17,68	2.573,00	45.484,94	16,77	17,65	17,94	4.045,00
24-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	NTCO3	52,84	2.447,00	129.295,83	52,22	52,89	53,44	19.132,00
24-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	PETR4	27,44	11.585,00	317.911,70	27,24	27,43	27,63	59.301,00
24-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	PRIO3	19,28	6.778,00	130.677,14	18,75	19,15	19,42	27.134,00
24-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	RAIL3	18,96	7.626,00	144.578,11	18,50	18,83	19,03	20.559,00
24-08-21	FIM EMB V A INVEST NO EXT	Compra	SPY	447,79	615,00	275.390,85		447,97		
24-08-21	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	Venda	LAME3	5,66	138.574,00	784.758,42	5,14	5,51	5,74	8.915,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	25,63	1.500,00	38.442,73	25,47	25,74	26,27	4.079,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	AMER3	41,54	1.100,00	45.699,04	40,83	42,02	44,00	21.559,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	17,93	900,00	16.139,76	17,61	17,91	18,04	13.554,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	B3SA3	13,80	2.000,00	27.590,43	13,70	13,82	13,99	38.086,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	30,29	300,00	9.087,15	30,13	30,32	30,51	20.811,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	BBRK3	2,26	600,00	1.358,23	2,21	2,29	2,38	1.341,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	20,07	300,00	6.021,88	19,90	20,06	20,26	17.451,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	BRAP4	64,10	200,00	12.820,87	63,73	64,07	64,71	6.014,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	BRDT3	26,40	1.900,00	50.167,90	26,28	26,50	26,89	32.178,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	BRML3	9,34	23.300,00	217.693,85	9,28	9,37	9,53	19.642,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CESP6	23,73	2.600,00	61.698,55	23,59	23,77	23,99	6.994,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CESP6	23,76	400,00	9.505,46	23,59	23,77	23,99	6.994,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CPFE3	28,78	100,00	2.878,00	28,50	28,93	29,16	13.331,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CPFE3	28,78	400,00	11.510,41	28,50	28,93	29,16	13.331,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CPFE3	28,80	1.000,00	28.798,14	28,50	28,93	29,16	13.331,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CRFB3	18,65	1.100,00	20.510,74	18,52	18,68	18,90	13.417,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	38,86	600,00	23.315,71	38,61	38,89	39,13	9.757,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	38,86	500,00	19.431,48	38,61	38,89	39,13	9.757,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ELET6	39,18	800,00	31.340,54	38,95	39,20	39,64	5.724,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	44,70	200,00	8.940,00	44,48	44,83	45,18	10.821,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	44,83	400,00	17.932,10	44,48	44,83	45,18	10.821,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	25,43	2.500,00	63.564,71	25,16	25,51	26,01	20.516,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	25,70	200,00	5.140,00	25,16	25,51	26,01	20.516,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ESPA3	17,58	500,00	8.792,00	17,41	17,73	18,09	4.565,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	EUCA4	10,01	400,00	4.002,11	9,90	10,01	10,24	257,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	GMAT3	7,65	2.200,00	16.828,35	7,60	7,65	7,71	11.549,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	GNDI3	82,05	200,00	16.409,56	81,15	82,31	83,27	12.730,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	15,10	1.100,00	16.611,96	14,92	15,11	15,30	30.727,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	HBSA3	4,77	1.900,00	9.063,47	4,71	4,75	4,83	5.236,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	HYPE3	34,82	1.000,00	34.817,97	34,57	34,82	35,03	11.396,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	IGTA3	36,52	100,00	3.652,06	36,14	36,66	37,15	7.520,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	11,42	4.100,00	46.825,59	11,31	11,41	11,49	26.229,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	30,98	100,00	3.098,00	30,52	30,82	31,05	42.860,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	IREN3	38,80	800,00	31.042,47	38,47	39,01	39,77	19.311,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	MULT3	21,57	1.100,00	23.724,59	21,33	21,59	21,89	18.105,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	53,37	1.100,00	58.707,07	52,59	53,38	54,07	19.653,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	OMGE3	34,21	500,00	17.106,11	33,94	34,22	34,65	4.802,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	PARD3	22,99	200,00	4.598,76	22,70	22,95	23,11	1.629,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	PETR3	28,27	1.800,00	50.888,37	28,10	28,32	28,47	21.112,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	PRIO3	18,91	700,00	13.235,64	18,73	18,97	19,29	24.310,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	QUAL3	21,13	200,00	4.226,29	20,38	21,12	21,75	11.957,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	18,72	1.900,00	35.569,94	18,50	18,74	18,94	19.468,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	16,57	500,00	8.284,03	16,18	16,55	16,85	1.283,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	56,44	1.300,00	73.367,92	55,76	56,57	57,53	22.540,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	SEER3	14,60	600,00	8.758,83	14,45	14,74	15,17	4.066,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	18,90	100,00	1.890,04	18,50	18,69	18,95	5.363,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	SULA11	29,90	1.800,00	53.818,58	29,73	29,97	30,49	15.742,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	61,96	700,00	43.375,17	58,58	61,05	62,40	35.581,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	61,28	1.000,00	61.276,95	58,58	61,05	62,40	35.581,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	61,62	1.300,00	80.108,67	58,58	61,05	62,40	35.581,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	TCSA3	6,09	100,00	609,10	6,01	6,12	6,30	2.419,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	TEND3	20,65	1.500,00	30.976,96	20,50	20,79	21,13	3.919,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	VALE3	12,23	100,00	1.223,00	12,08	12,20	12,26	9.954,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	VALE3	99,54	400,00	39.816,96	98,55	99,45	100,46	52.528,00
25-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	27,36	200,00	5.471,11	26,80	27,29	28,20	11.336,00
26-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	25,24	200,00	5.048,64	25,01	25,22	25,80	5.170,00
26-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	25,22	500,00	12.609,10	25,01	25,22	25,80	5.170,00



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL
Mês de Referência: 01 DE AGOSTO DE 2021 À 31 DE AGOSTO DE 2021



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
26-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	BRML3	9,10	1.800,00	16.385,59	9,05	9,16	9,45	43.023,00
26-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CESP6	23,61	900,00	21.247,32	23,47	23,62	23,80	7.768,00
26-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CESP6	23,59	800,00	18.874,62	23,47	23,62	23,80	7.768,00
26-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CPFE3	28,92	600,00	17.350,05	28,73	28,94	29,20	8.046,00
26-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CPFE3	29,01	1.600,00	46.422,95	28,73	28,94	29,20	8.046,00
26-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	CYRE3	20,36	500,00	10.177,51	19,94	20,31	21,06	27.834,00
26-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	39,17	200,00	7.833,03	38,61	39,02	39,57	14.467,00
26-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	39,09	300,00	11.728,33	38,61	39,02	39,57	14.467,00
26-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	39,00	1.100,00	42.898,21	38,61	39,02	39,57	14.467,00
26-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	25,53	3.900,00	99.585,66	25,30	25,47	25,71	16.890,00
26-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	IGTA3	35,15	500,00	17.575,00	35,15	35,78	37,15	13.744,00
26-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	MDNE3	8,07	200,00	1.613,44	7,82	8,06	8,30	1.260,00
26-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	MULT3	21,15	3.000,00	63.462,55	21,01	21,19	21,81	17.511,00
26-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	MULT3	21,17	600,00	12.704,58	21,01	21,19	21,81	17.511,00
26-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	56,10	300,00	16.831,40	55,83	56,16	57,55	19.117,00
26-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	61,98	500,00	30.989,78	61,41	62,08	62,91	31.719,00
26-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	TCSA3	6,02	1.500,00	9.028,08	5,92	6,02	6,19	5.119,00
26-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	BRDT3	26,80	13.883,00	372.059,73	26,35	26,68	26,95	33.575,00
26-08-21	FIA RVA EMB IV	Venda	UGPA3	14,82	3.878,00	57.460,35	14,63	14,85	15,44	25.976,00
27-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	25,26	400,00	10.104,62	24,86	25,28	25,55	5.150,00
27-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	BRDT3	27,31	3.000,00	81.922,62	26,53	27,16	27,49	28.586,00
27-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	BRML3	9,22	1.800,00	16.590,83	9,04	9,23	9,37	18.618,00
27-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CESP6	23,57	500,00	11.782,98	23,38	23,57	23,69	4.735,00
27-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CESP6	23,60	1.500,00	35.406,70	23,38	23,57	23,69	4.735,00
27-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CPFE3	28,67	1.400,00	40.140,54	28,16	28,63	29,00	9.822,00
27-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	CYRE3	20,69	900,00	18.617,46	19,98	20,63	21,31	17.578,00
27-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	38,73	1.200,00	46.476,64	38,33	38,67	38,90	8.831,00
27-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	44,38	600,00	26.625,22	43,37	44,21	44,66	9.553,00
27-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	25,23	1.400,00	35.317,40	24,99	25,24	25,62	11.455,00
27-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ESPA3	18,07	900,00	16.264,34	17,78	18,12	18,47	4.777,00
27-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ESPA3	18,15	600,00	10.890,00	17,78	18,12	18,47	4.777,00
27-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	IREN3	38,36	700,00	26.851,54	37,53	38,21	38,54	18.788,00
27-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	MDNE3	8,36	200,00	1.672,90	8,08	8,38	8,65	1.148,00
27-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	MDNE3	8,40	1.100,00	9.240,00	8,08	8,38	8,65	1.148,00
27-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	MULT3	21,39	4.400,00	94.118,07	20,96	21,36	21,61	12.982,00
27-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	PARD3	23,79	300,00	7.138,42	23,30	23,77	24,04	2.720,00
27-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	61,92	700,00	43.347,49	60,46	61,75	62,34	27.826,00
27-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	TCSA3	5,93	1.100,00	6.527,27	5,85	5,93	6,06	4.059,00
27-08-21	FIA RVA EMB IV	Compra	BRDT3	27,24	12.224,00	333.005,95	26,53	27,16	27,49	28.586,00
27-08-21	FIA RVA EMB IV	Venda	UGPA3	14,86	3.943,00	58.603,03	14,55	14,77	15,04	20.534,00
30-08-21	FIA RVA EMB II	Venda	MULT3	21,18	106.500,00	2.255.983,12	21,04	21,21	21,45	11.661,00
30-08-21	FIA RVA EMB II	Compra	PETRA	28,48	94.500,00	2.691.582,85	28,26	28,45	28,71	78.068,00
30-08-21	FIA RVA EMB II	Compra	PRIO3	19,39	6.100,00	118.269,88	19,10	19,42	19,90	32.868,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	25,28	900,00	22.755,26	24,97	25,21	25,56	4.282,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	AMER3	43,30	900,00	38.973,00	40,89	42,67	43,60	19.507,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	17,25	700,00	12.076,40	16,96	17,27	17,62	13.396,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	B3SA3	13,69	2.800,00	38.326,96	13,60	13,68	13,81	39.359,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	30,24	200,00	6.048,00	30,14	30,33	30,59	16.558,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	BBS3	19,36	300,00	5.808,75	19,29	19,42	19,78	18.770,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	BKBR3	9,53	300,00	2.859,00	9,42	9,58	9,81	3.948,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	BMGB4	4,15	700,00	2.907,10	4,02	4,15	4,26	4.951,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	BRAP4	64,13	200,00	12.825,00	63,60	64,06	64,81	5.015,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	BRDT3	26,95	1.500,00	40.424,25	26,80	27,06	27,36	28.923,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	BRML3	9,13	5.300,00	48.362,86	9,09	9,14	9,26	14.950,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	BRML3	9,13	2.700,00	24.652,22	9,09	9,14	9,26	14.950,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	CCPR3	10,42	400,00	4.167,98	10,17	10,32	10,52	1.676,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CESP6	23,51	300,00	7.053,78	23,39	23,52	23,64	3.885,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CESP6	23,54	3.500,00	82.384,34	23,39	23,52	23,64	3.885,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CPFE3	29,01	200,00	5.802,53	28,70	29,00	29,12	6.939,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CPFE3	29,01	500,00	14.503,77	28,70	29,00	29,12	6.939,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	CRFB3	18,68	900,00	16.814,08	18,50	18,63	18,73	6.961,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	CYRE3	20,54	300,00	6.161,45	20,35	20,55	21,28	16.907,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	CYRE3	20,45	300,00	6.135,00	20,35	20,55	21,28	16.907,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	38,03	2.200,00	83.656,26	37,71	38,02	38,78	12.501,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ELET6	38,40	700,00	26.879,20	38,05	38,38	39,16	6.257,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	44,55	100,00	4.454,50	43,76	44,25	44,60	6.054,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	25,28	1.000,00	25.275,89	24,98	25,21	25,38	13.908,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ESPA3	18,06	1.200,00	21.674,75	17,57	18,02	18,34	4.276,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ESPA3	18,03	900,00	16.227,24	17,57	18,02	18,34	4.276,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	EUCA4	9,90	200,00	1.979,00	9,65	9,86	10,07	197,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	GMAT3	7,49	1.900,00	14.222,22	7,37	7,45	7,52	5.365,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	GNDI3	80,49	100,00	8.049,00	79,81	80,35	81,36	8.712,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	14,83	900,00	13.350,46	14,74	14,81	14,97	20.085,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	HBSA3	4,71	1.600,00	7.533,82	4,66	4,73	4,80	4.035,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	HGTX3	38,35	100,00	3.835,00	37,67	38,17	38,58	4.721,00



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL
Mês de Referência: 01 DE AGOSTO DE 2021 À 31 DE AGOSTO DE 2021



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	HYPE3	34,32	900,00	30.891,75	33,95	34,18	34,41	11.034,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	IGTA3	34,87	100,00	3.487,00	34,69	34,97	35,58	8.141,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	11,31	3.500,00	39.585,73	11,25	11,31	11,39	28.743,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	30,54	100,00	3.053,50	30,34	30,55	30,80	42.159,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	LREN3	38,02	700,00	26.612,60	37,64	37,98	38,38	16.282,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	LREN3	37,97	600,00	22.784,06	37,64	37,98	38,38	16.282,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	LREN3	38,04	400,00	15.214,60	37,64	37,98	38,38	16.282,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	MDNE3	8,27	100,00	826,59	8,14	8,26	8,56	780,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	MULT3	21,20	200,00	4.239,00	21,04	21,21	21,45	11.661,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	MULT3	21,26	1.000,00	21.255,96	21,04	21,21	21,45	11.661,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	MULT3	21,18	1.600,00	33.881,57	21,04	21,21	21,45	11.661,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	52,56	900,00	47.304,68	51,95	52,41	52,87	13.771,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	OMGE3	33,29	500,00	16.646,43	33,08	33,31	33,98	2.822,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	OMGE3	33,29	200,00	6.658,25	33,08	33,31	33,98	2.822,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	PARD3	24,15	200,00	4.830,40	23,78	24,70	25,38	5.036,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	PARD3	24,20	500,00	12.100,00	23,78	24,70	25,38	5.036,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	PETR3	28,74	1.500,00	43.108,56	28,66	28,84	29,26	30.182,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	POWE3	14,39	100,00	1.439,00	14,24	14,60	15,20	1.173,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	19,32	700,00	13.522,44	19,10	19,42	19,90	32.868,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	QUAL3	21,56	200,00	4.311,32	21,32	21,55	21,71	8.290,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	18,75	1.700,00	31.873,58	18,55	18,79	19,04	23.373,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	17,73	400,00	7.090,00	17,41	17,67	17,88	1.417,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	56,75	1.200,00	68.096,46	56,48	56,92	57,90	13.289,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	SEER3	13,75	500,00	6.874,30	13,69	13,83	14,18	2.778,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	18,15	500,00	9.075,00	17,91	18,15	18,43	5.410,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	SULA11	29,70	1.500,00	44.556,00	28,98	29,54	29,91	15.607,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	61,67	1.000,00	61.666,92	61,15	61,58	61,96	16.904,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	TCSA3	5,90	1.000,00	5.903,82	5,80	5,90	6,03	3.857,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	TCSA3	5,95	400,00	2.378,00	5,80	5,90	6,03	3.857,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	TEND3	20,56	400,00	8.224,40	20,37	20,57	20,81	3.567,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	TEND3	20,64	1.300,00	26.837,06	20,37	20,57	20,81	3.567,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	TIMS3	12,20	200,00	2.439,31	12,03	12,13	12,23	11.031,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	VALE3	100,26	400,00	40.104,00	99,95	100,54	101,64	49.207,00
30-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	WEST3	7,28	100,00	727,50	7,20	7,34	7,68	2.994,00
30-08-21	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	Venda	ANIM3	9,86	6.453,00	63.656,26	9,64	9,92	10,13	10.060,00
30-08-21	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	Venda	COGN3	3,28	32.898,00	107.944,92	3,25	3,29	3,37	18.759,00
30-08-21	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	Venda	GNDI3	80,38	4.803,00	386.083,87	79,81	80,35	81,36	8.712,00
30-08-21	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	Venda	LAME3	5,90	586,00	3.456,17	5,67	5,86	5,95	9.205,00
30-08-21	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	Venda	MGLU3	18,90	12.565,00	237.499,86	18,49	18,84	19,10	49.560,00
30-08-21	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	Venda	OIBR3	1,12	173.749,00	195.415,50	1,12	1,13	1,16	18.708,00
30-08-21	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	Venda	ONCO3	17,00	3.640,00	61.895,29	16,90	17,04	17,35	1.454,00
30-08-21	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	Venda	SUZB3	61,61	4.867,00	299.869,98	61,15	61,58	61,96	16.904,00
30-08-21	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	Venda	YDUQ3	26,47	4.231,00	111.993,72	26,35	26,58	27,27	8.905,00
31-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	16,81	400,00	6.724,00	16,81	16,98	17,45	14.768,00
31-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	B3SA3	13,90	1.800,00	25.016,06	13,68	13,96	14,07	56.984,00
31-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	BRDT3	27,19	600,00	16.314,00	26,62	27,03	27,49	30.422,00
31-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	BRML3	9,03	400,00	3.613,05	8,99	9,07	9,25	21.940,00
31-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	BRML3	9,06	3.300,00	29.897,73	8,99	9,07	9,25	21.940,00
31-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CESP6	23,32	100,00	2.332,18	23,24	23,41	23,77	6.624,00
31-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CESP6	23,53	800,00	18.820,00	23,24	23,41	23,77	6.624,00
31-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CESP6	23,42	800,00	18.733,49	23,24	23,41	23,77	6.624,00
31-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CPFE3	28,90	900,00	26.009,71	28,75	28,95	29,17	14.063,00
31-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	CPFE3	29,00	500,00	14.499,81	28,75	28,95	29,17	14.063,00
31-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	CYRE3	20,43	300,00	6.128,51	20,01	20,45	21,09	23.200,00
31-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	37,45	200,00	7.490,00	37,34	37,62	38,16	14.077,00
31-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	37,85	600,00	22.710,33	37,34	37,62	38,16	14.077,00
31-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	44,44	600,00	26.661,07	44,06	44,38	44,91	10.155,00
31-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	25,45	700,00	17.815,00	24,90	25,27	25,55	15.695,00
31-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ESPA3	17,99	500,00	8.992,78	17,62	18,03	18,28	3.554,00
31-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	HYPE3	35,57	600,00	21.342,00	34,12	35,05	35,57	22.805,00
31-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	30,92	1.600,00	49.474,58	30,53	30,92	31,27	71.872,00
31-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	30,79	300,00	9.238,25	30,53	30,92	31,27	71.872,00
31-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	LREN3	37,86	300,00	11.356,87	37,28	37,98	38,83	22.593,00
31-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	MDNE3	8,25	300,00	2.476,16	8,08	8,33	8,70	1.842,00
31-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	MULT3	21,05	200,00	4.209,21	20,93	21,22	21,82	22.874,00
31-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	MULT3	21,07	1.600,00	33.713,59	20,93	21,22	21,82	22.874,00
31-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	OMGE3	33,26	300,00	9.977,48	32,81	33,18	33,79	6.384,00
31-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	PARD3	26,26	1.400,00	36.760,70	24,97	26,00	26,39	6.852,00
31-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	PARD3	26,20	200,00	5.239,70	24,97	26,00	26,39	6.852,00
31-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	PETR3	27,89	300,00	8.365,73	27,73	28,06	28,78	38.757,00
31-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	PETR3	28,24	3.200,00	90.357,20	27,73	28,06	28,78	38.757,00
31-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	55,46	400,00	22.182,40	54,84	55,56	56,89	31.706,00
31-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	55,21	900,00	49.686,65	54,84	55,56	56,89	31.706,00
31-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	SULA11	29,19	400,00	11.676,21	29,08	29,76	30,87	18.603,00
31-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	SULA11	29,12	200,00	5.824,00	29,08	29,76	30,87	18.603,00



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL
Mês de Referência: 01 DE AGOSTO DE 2021 À 31 DE AGOSTO DE 2021



Bradesco

DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
31-08-21	FIA RVA EMB III	Compra	SULA11	29,12	600,00	17.473,90	29,08	29,76	30,87	18.603,00
31-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	61,05	1.500,00	91.569,62	60,34	60,98	61,67	22.691,00
31-08-21	FIA RVA EMB III	Venda	TCSA3	5,88	600,00	3.528,70	5,82	5,88	6,01	2.905,00
31-08-21	FIA RVA EMB IV	Venda	ELET3	37,54	2.898,00	108.776,43	37,34	37,62	38,16	14.077,00
31-08-21	FIA RVA EMB IV	Venda	ELET6	37,72	452,00	17.048,68	37,56	37,90	38,52	7.219,00
31-08-21	FIA RVA EMB IV	Venda	PETRA	27,46	22.084,00	606.470,84	26,99	27,53	28,23	139.214,00
31-08-21	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	Venda	ANIM3	9,72	6.537,00	63.526,57	9,65	9,79	10,21	7.840,00
31-08-21	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	Venda	COGN3	3,24	32.071,00	103.910,04	3,19	3,25	3,34	22.577,00
31-08-21	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	Venda	GNDI3	80,18	4.816,00	386.150,73	79,09	80,01	81,65	17.143,00
31-08-21	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	Venda	MGLU3	18,33	12.968,00	237.726,78	18,14	18,40	19,06	55.446,00
31-08-21	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	Venda	OIBR3	1,11	11.798,00	13.095,78	1,08	1,10	1,14	12.948,00
31-08-21	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	Venda	ONCO3	16,93	4.412,00	74.698,69	16,52	16,92	17,34	1.807,00
31-08-21	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	Venda	SUZB3	60,93	5.058,00	308.162,19	60,34	60,98	61,67	22.691,00
31-08-21	FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO EMB IV A	Venda	YDUQ3	25,83	4.225,00	109.116,96	25,38	25,92	27,00	11.940,00

7. RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS

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

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

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



8. GLOSSÁRIO

Administrador

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

Carteira

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

Dados Gerais

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

Vide também glossário de *Value at Risk*, Patrimônio Líquido e *Expected Tail Loss*.

Duration

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

Vide também glossário de Valor Presente.

ETL (Expected Tail Loss)

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

Fundo de Investimento

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

Índice de Referência (Benchmark)

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



LDI (Liability Driven Investments)

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

Parâmetros do Cálculo do VaR (Value at Risk)

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

Patrimônio de Cobertura

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

Patrimônio Líquido (PL)

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

Rating

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

Stress Testing

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

Tracking Error

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



Túnel de Preços

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

Valor Presente

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

Value at Risk (VaR)

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