



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO



Fevereiro/2023





1. INTRODUÇÃO

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

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

2. RISCO DE MERCADO

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

2.1. Relatório Detalhado Risco



Data: 28/02/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS
CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais			
PL:	4.167.032.761,33	VAR / PL:	1,9077%
VAR:	79.496.079,91	ETL / PL:	2,3924%
ETL:	99.691.291,36	VAR / CDI:	0,0215%
Limite Fundo:	0,00%	Status:	ENQUADRADO
Duration DC:	1.695,75	Benchmark:	
Duration DU:	1.166,47		

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	199.903.736,68	Cenário Baixa - 10000 (+):	341.972.254,21	CENARIO BRADESCO 1 (+):	542.167.474,11	CENARIO BRADESCO 2 (+):	62.829.841,92
Cenário Alta - 09999 (-):	(178.380.465,24)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(258.938.576,17)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(240.970.666,12)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(396.575.528,70)
Cenário Alta - 09999:	21.523.271,44	Cenário Baixa - 10000:	83.033.678,04	CENARIO BRADESCO 1:	301.196.807,99	CENARIO BRADESCO 2:	(333.745.686,78)

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
VALE3	49.014.633,60	9.329.118,06	-2.556.556,49	-3,22%	12.253.658,40	-12.253.658,40	7.185.545,29	-7.244.362,85
VAMO22	1.066.396,08	275,82	233,54	0,00%	-939,31	762,57	1.449,93	-2.062,53
VAMO33	7.267.842,60	173.043,22	151.436,25	0,19%	-462.278,44	382.735,74	380.329,00	-481.599,41
VAMO34	6.661.161,31	157.850,45	137.606,75	0,17%	-418.540,74	351.834,22	348.234,27	-439.992,96
VBBR3	6.266.951,91	778.309,51	524.220,70	0,66%	1.566.737,98	-1.566.737,98	918.735,15	-926.255,49
VCCS11	1.296.240,47	1.915,89	1.589,47	0,00%	-5.687,76	4.825,00	8.695,14	-11.412,95
VECS11	1.708.037,22	240,71	196,31	0,00%	-856,43	692,06	1.360,05	-1.962,77
VERDECS2	276.188,43	103.404,01	-19.076,24	-0,02%	0,00	0,00	0,00	0,00
VIA3	153.099,18	34.691,11	17.194,10	0,02%	68.896,70	-68.894,63	22.444,34	-22.628,06
VIMT13	6.632.846,05	176.818,79	147.896,61	0,19%	-458.729,07	386.896,27	394.765,45	-488.446,17
VIVT3	828.253,80	66.175,41	40.082,67	0,05%	124.235,94	-124.240,20	121.422,01	-122.415,91
VIXL14	2.170.002,76	454,28	378,70	0,00%	-1.609,65	1.303,53	2.535,81	-3.636,99
VRDN12	4.562.579,02	112.374,28	96.985,88	0,12%	-295.640,58	247.246,46	248.363,62	-310.949,54
VVEO15	1.727.853,41	891,67	769,80	0,00%	-2.765,26	2.272,34	4.159,75	-5.772,70
VVEO16	1.098.437,03	626,37	540,38	0,00%	-1.924,77	1.586,87	2.897,59	-3.996,63
WDOH23	3.880,01	0,00	0,00	0,00%	124.692,80	-124.775,20	152.349,26	-153.593,33
WDOJ23	-5.664,67	50.135,04	22.069,22	0,03%	-93.115,77	94.722,40	-120.354,95	120.954,28
WEGE3	8.136.273,20	407.661,00	139.743,87	0,18%	2.034.068,30	-2.034.068,30	1.192.777,65	-1.202.541,18
WINJ23	10.335,00	83.749,71	-47.456,24	-0,06%	-203.812,36	203.437,43	-159.943,64	160.606,65
XPIN11	3.031.829,10	170.207,23	126.412,57	0,16%	1.515.914,05	-1.515.914,05	444.466,00	-448.104,19
XPPR11	2.742.937,80	243.209,18	164.044,84	0,21%	1.371.468,90	-1.371.468,90	402.114,68	-405.406,21
YDUQ3	1.222.900,05	198.831,42	89.595,80	0,11%	476.931,02	-305.725,01	179.277,15	-180.744,63
Total Var:	4.242.976.244,61	149.264.713,30	79.496.079,91	99,97%	21.523.271,44	83.033.678,05	301.196.807,98	-333.745.686,78



Data: 28/02/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: EMBRAERPREV RENDA FIXA
CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais					
PL:	2.545.497.711,77	VAR / PL:	1,8358%	Limite Fundo:	0,00%
VAR:	48.730.793,92	ETL / PL:	2,3022%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	58.602.300,87	VAR / CDI:	0,0206%	Benchmark:	
				Dutacion DC:	2.506,33
				Dutacion DU:	1.724,05

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (+):	230.807.982,88	CENARIO BRADESCO 1 (+):	174.863.545,51
Cenário Alta - 09999 (-):	(121.424.801,91)	Cenário Baixa - 10000 (-):	-	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-
Cenário Alta - 09999:	(121.424.801,91)	Cenário Baixa - 10000:	230.807.982,88	CENARIO BRADESCO 1:	174.863.545,51
				CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	(194.736.760,70)
				CENARIO BRADESCO 2:	(194.736.760,70)

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

Produto	MtM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
CAIXA	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
FI RF EMB II	2.365.614.792,62	45.366.415,22	45.359.598,90	97,07%	-117.480.672,36	227.067.761,16	171.801.048,93	-190.737.338,56
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	143.109.821,71	1.580.693,77	1.371.195,02	2,93%	-3.944.129,85	3.740.221,73	3.062.496,59	-3.999.422,14
Total Var:	2.508.724.614,33	46.947.108,98	46.730.793,92	100,00%	-121.424.801,91	230.807.982,88	174.863.545,51	-194.736.760,70

Relatório de Risco de Mercado



Data: 28/02/2023

FUNDO: EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL
CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais					
PL:	532.771.138,48	VAR / PL:	7,3957%	Limite Fundo:	0,00%
VAR:	39.402.285,25	ETL / PL:	9,2745%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	49.412.055,34	VAR / CDI:	0,0832%	Benchmark:	
				Dutacion DC:	1,16
				Dutacion DU:	1,11

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	127.455.392,43	Cenário Baixa - 10000 (+):	-	CENARIO BRADESCO 1 (+):	68.342.625,68
Cenário Alta - 09999 (-):	-	Cenário Baixa - 10000 (-):	(126.335.060,79)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-
Cenário Alta - 09999:	127.455.392,43	Cenário Baixa - 10000:	(126.335.060,79)	CENARIO BRADESCO 1:	68.342.625,68
				CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	(68.901.133,78)
				CENARIO BRADESCO 2:	(68.901.133,78)

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

Produto	MtM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
CAIXA	25.000.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
FIA RVA EMB II	210.606.511,59	16.664.104,44	16.418.354,41	41,67%	55.258.701,08	-55.965.135,34	31.544.571,35	-31.799.122,84
FIA RVA EMB III	87.910.229,14	7.642.246,27	7.155.510,50	18,16%	23.348.898,04	-23.037.724,91	11.430.111,87	-11.527.499,43
FIA RVA EMB IV	77.938.712,07	7.486.229,07	7.085.322,54	17,98%	24.353.590,56	-22.446.852,58	11.419.739,03	-11.513.215,75
FIC FIA EMB VIII ETF	23.515.052,85	1.764.112,94	1.666.421,98	4,23%	0,00	0,00	0,00	0,00
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB	95.867.786,75	7.238.712,16	7.076.675,82	17,96%	24.494.212,76	-24.885.347,97	13.948.203,43	-14.061.295,77
Total Var:	520.838.292,39	40.795.404,89	39.402.285,25	100,00%	127.455.392,44	-126.335.060,79	68.342.625,68	-68.901.133,78



Data: 28/02/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO:		FI RF EMB II						
CNPJ:		11005764000196						
Dados Gerais								
PL:	2.393.499.622,03	VAR / PL:	1,8554%					
VAR:	45.366.414,17	ETL / PL:	2,3769%					
ETL:	56.891.313,61	VAR / CDI:	0,0213%					
Limite Fundo:		Status:	ENQUADRADO					
0,00% Dutation DC:	2.603,48	Benchmark:						
Dutation DU:	1.790,88							
Cenários de STRESS								
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (+):	227.067.755,92					
Cenário Alta - 09999 (-):	(117.480.669,65)	Cenário Baixa - 10000 (-):	-					
Cenário Alta - 09999:	(117.480.669,65)	Cenário Baixa - 10000:	227.067.755,92					
CENARIO BRADESCO 1 (+):	171.801.044,96	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-					
CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(190.737.334,16)					
CENARIO BRADESCO 1:	171.801.044,96	CENARIO BRADESCO 2:	(190.737.334,16)					
Parâmetros do Cálculo								
Modelo:	Var paramétrico	Modelo Volatilidade:	EWMA					
Int. Confiança:	95	Lâmbda:	0,94					
Horizonte:	21							
Produto	MtM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
CSMG3	12.869.731,84	93.885,40	73.046,04	0,16%	0,00	0,00	0,00	0,00
ELET42	13.319.579,20	263.060,23	231.668,20	0,51%	0,00	0,00	0,00	0,00
ENTV12	12.616.972,29	263.410,61	233.460,82	0,51%	-14.985,50	15.281,11	69.943,75	-106.452,36
GASPI7	51.224.364,86	511.407,13	395.615,53	0,87%	0,00	0,00	0,00	0,00
IGSN15	2.454.640,29	56.303,86	49.371,84	0,11%	-208.019,25	214.713,12	147.186,22	-196.347,35
NEOE16	6.762.033,98	136.007,88	119.921,82	0,26%	0,00	0,00	0,00	0,00
NTNB20240815 - 760199_VENCIMENTO	119.028.204,70	1.070.974,50	653.137,70	1,44%	-686.619,38	544.020,71	524.196,00	-676.202,65
NTNB20260815 - 760199_VENCIMENTO	40.637.808,03	592.283,66	486.598,68	1,07%	-692.705,35	565.656,14	547.509,95	-700.874,02
NTNB20300815 - 760199_VENCIMENTO	24.730.523,96	411.237,46	386.628,09	0,85%	-1.739.362,62	2.099.242,49	1.696.247,93	-2.204.791,02
NTNB20350515 - 760199_VENCIMENTO	220.402.203,27	4.623.511,35	4.458.056,11	9,83%	-148.022,31	124.703,92	123.605,68	-155.267,10
NTNB20400815 - 760199_VENCIMENTO	26.613.393,04	702.978,65	700.795,91	1,54%	-359.406,19	282.266,59	274.827,37	-354.061,31
NTNB20450515 - 760199_VENCIMENTO	205.143.329,17	6.047.887,66	6.037.028,32	13,31%	-2.187.860,03	2.264.692,18	1.515.147,75	-2.025.148,83
NTNB20500815 - 760199_VENCIMENTO	637.516.056,09	20.798.955,55	20.754.817,48	45,75%	-1.298.143,63	1.512.548,34	1.126.693,29	-1.477.957,58
NTNB20550515 - 760199_VENCIMENTO	203.178.578,74	6.861.806,94	6.839.039,68	15,08%	-1.314.459,87	1.708.518,09	1.394.287,58	-1.758.866,77
FETR45	17.992.786,53	94.159,17	67.570,39	0,15%	-14.699.620,78	22.653.359,30	18.491.305,35	-22.303.323,06
SBSPC2	9.069.562,12	70.970,04	54.899,94	0,12%	-2.154.205,73	3.579.102,66	2.895.205,18	-3.347.792,38
BBTOPIND	223.762.399,01	3.914.638,45	3.824.757,61	8,43%	-16.482.021,00	33.685.571,14	25.221.588,67	-28.219.297,82
CAIXA	5.000,00	0,00	0,00	0,00%	-57.003.845,73	116.909.185,11	88.068.770,43	-95.611.943,11
COMPROMISSADA_PRE	538.370.576,81	0,00	0,00	0,00%	-18.089.750,78	40.528.805,66	29.444.391,10	-31.250.888,60
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-83.005,90	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-246.544,14	208.349,83	145.470,09	-195.045,29
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-155.097,40	171.739,54	114.668,61	-153.074,93
Total Var:	2.365.614.738,03	46.513.478,54	45.366.414,17	99,99%	-117.480.669,65	227.067.755,92	171.801.044,96	-190.737.334,16

Relatório de Risco de Mercado



Data: 28/02/2023

FUNDO:		FI RF EMB V CREDITO PRIVADO						
CNPJ:		20726178000121						
Dados Gerais								
PL:	151.998.089,74	VAR / PL:	1,0399%					
VAR:	1.580.693,76	ETL / PL:	1,3041%					
ETL:	1.982.253,75	VAR / CDI:	0,0117%					
Limite Fundo:		Status:	ENQUADRADO					
0,00% Dutation DC:	898,72	Benchmark:						
Dutation DU:	618,07							
Cenários de STRESS								
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (+):	3.740.221,72					
Cenário Alta - 09999 (-):	(3.944.129,55)	Cenário Baixa - 10000 (-):	-					
Cenário Alta - 09999:	(3.944.129,55)	Cenário Baixa - 10000:	3.740.221,72					
CENARIO BRADESCO 1 (+):	3.062.496,59	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-					
CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(3.999.422,14)					
CENARIO BRADESCO 1:	3.062.496,59	CENARIO BRADESCO 2:	(3.999.422,14)					
Parâmetros do Cálculo								
Modelo:	Var paramétrico	Modelo Volatilidade:	EWMA					
Int. Confiança:	95	Lâmbda:	0,94					
Horizonte:	21							
Produto	MtM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
17H0164854	8.468.013,32	98.092,35	97.490,44	6,17%	-219.899,72	205.941,44	163.471,61	-215.207,64
AEGP23	14.426.621,59	138.605,19	135.031,38	8,54%	-306.196,03	299.503,13	217.257,14	-289.081,30
CCRDD1	6.096.834,72	49.053,27	43.403,02	2,75%	0,00	0,00	0,00	0,00
CMOT33	1.304.817,12	10.225,84	9.917,60	0,63%	-87.004,67	97.884,39	63.127,50	-84.459,03
ENJG21	1.841.546,75	21.957,81	21.802,77	1,38%	-22.325,26	24.739,18	16.517,05	-22.048,79
ENMI21	1.146.736,61	14.169,06	14.071,80	0,89%	0,00	0,00	0,00	0,00
ENTV12	16.586.061,49	346.275,20	336.674,28	21,30%	0,00	0,00	0,00	0,00
ERDV17_VENCIMENTO	12.665.408,23	114.547,84	111.304,53	7,04%	-48.847,82	45.399,53	33.728,93	-47.110,44
ERDV36	4.063.592,44	33.742,76	29.740,98	1,88%	-31.337,19	28.159,10	23.105,23	-30.447,03
GASPI7	10.598.144,45	105.808,37	82.854,71	5,24%	-910.618,90	743.602,13	719.747,45	-921.357,31
GEP2A4	7.580.633,77	25.218,54	9.188,60	0,58%	-253.204,55	255.673,50	181.976,90	-242.288,06
GRRB24_VENCIMENTO	14.773.415,38	295.607,37	290.818,94	18,40%	-58.428,37	67.019,18	42.984,46	-57.509,28
LFSN16000GM	7.758.814,89	85.752,51	82.825,25	5,24%	-359.868,13	434.326,03	350.947,85	-456.163,66
LFSN18000DC5	2.831.259,92	38.519,73	37.708,81	2,39%	-41.384,95	43.331,76	23.528,96	-31.813,42
OMGE31	12.396.211,70	172.060,68	169.341,07	10,71%	-783.563,67	610.073,96	596.146,15	-768.463,40
RDCO34	5.606.993,01	16.546,35	4.125,68	0,26%	-151.458,34	195.126,70	128.522,74	-171.067,75
SBSPC2	6.950.554,97	54.388,65	52.747,64	3,34%	-69.265,86	83.441,83	59.081,86	-78.249,75
TAE33	8.041.910,69	57.607,93	51.646,27	3,27%	-351.701,58	348.307,73	270.009,21	-356.366,44
CAIXA	1.000,25	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-28.743,62	0,00	0,00	0,00%	-19.392,29	2.563,41	3.600,53	-4.892,45
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-118.860,53	131.614,42	87.871,51	-117.310,60
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-110.971,70	122.514,31	78.865,52	-105.595,79
Total Var:	143.109.821,69	1.678.179,45	1.580.693,76	100,01%	-3.944.129,55	3.740.221,72	3.062.496,59	-3.999.422,14



Data: 28/02/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIM EMB I A
CNPJ: 20725946000122

Dados Gerais		Limite Fundo:		ENQUADRADO		0,00% Dutation DC:		79,58	
PL:	382.282.286,68	VAR / PL:	0,1713%	Status:		Dutation DU:			55,03
VAR:	654.722,53	ETL / PL:	0,2148%	Benchmark:					
ETL:	821.048,47	VAR / CDI:	0,0019%						

Cenários de STRESS										
Cenário Alta - 09999 (+):	25.745.429,77	Cenário Baixa - 10000 (-):	85.156.166,25	CENARIO BRADESCO 1 (+):	231.112.673,21	CENARIO BRADESCO 2 (+):	56.192.639,99			
Cenário Alta - 09999 (-):	(28.886.368,14)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(86.354.959,97)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(234.737.690,41)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(59.091.695,59)			
Cenário Alta - 09999:	(3.140.938,37)	Cenário Baixa - 10000:	(1.198.793,72)	CENARIO BRADESCO 1:	(3.625.017,20)	CENARIO BRADESCO 2:	(2.899.055,60)			

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
ANHB10	754.117,33	83,42	42,05	0,01%	-284,71	231,51	446,01	-635,20
BCBF14	276.510,35	34,87	12,93	0,00%	-130,54	105,28	210,79	-304,92
CAIXA	9.000,03	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CBAN22	2.217.901,87	11.596,05	11.143,79	1,70%	-23.568,62	22.633,59	39.554,15	-42.221,60
CGBBP13	2.305.782,25	1.830,04	1.315,31	0,20%	-5.984,43	4.678,26	8.509,76	-11.428,97
COMPROMISSADA PRE	195.672.603,91	0,00	0,00	0,00%	-5.446,53	5.553,97	25.421,29	-38.690,47
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-64.653,96	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DI1F24	957,99	11.828,81	-399,00	-0,06%	59.078,90	-47.867,67	-102.632,46	151.049,34
DI1F25	7.981,24	78.997,90	-40.196,09	-6,14%	233.220,57	-187.092,74	-338.921,70	480.685,64
DI1F27	-93.559,08	933.097,07	747.670,82	114,20%	-2.594.869,85	2.204.422,91	3.867.632,00	-5.070.156,57
DI1F31	12.974,17	117.705,77	-102.012,25	-15,58%	326.862,01	-299.749,72	-556.272,01	619.075,44
DI1H23	-202,90	20,90	1,03	0,00%	-8.207,13	8.369,03	-38.306,21	-58.300,93
DI1J23	-697,35	2.748,55	747,55	0,11%	140.842,55	-143.004,42	-633.235,70	960.142,66
DI1N23	-0,54	67,68	8,63	0,00%	809,60	-770,23	-2.126,04	3.191,59
DI1N24	3.698,46	53.305,78	-16.495,90	-2,52%	180.082,82	-143.130,31	-276.897,45	400.093,12
DI1Y23	5.867,70	75.396,93	5.530,56	0,84%	532.666,67	-452.084,72	-1.047.177,34	1.555.915,10
DOLH23	-3.989,01	0,00	0,00	0,00%	-124.692,80	124.775,20	-152.349,26	153.593,33
DOLL23	7.080,83	62.668,79	-39.831,28	-6,08%	116.394,72	-118.403,00	150.443,69	-161.192,86
ELET13	2.134.937,90	736,28	389,50	0,06%	-2.387,18	1.934,52	3.636,54	-5.156,31
EQT1L13	1.503.995,68	54,99	7,18	0,00%	-263,81	214,01	466,40	-686,07
ETEN13	1.376.909,54	9,78	-1,03	0,00%	-87,25	75,37	181,21	-270,20
GRRB14	1.066.692,37	146,98	75,10	0,01%	-485,73	394,75	746,56	-1.060,70
IDIF24C382500	1.813.549,08	1.231.172,87	-41.529,10	-6,34%	12.261.032,72	-1.781.438,00	-1.813.540,50	37.071.054,57
IDIF24C382600	-274.482,00	187.268,40	6.316,81	0,96%	-1.905.378,11	269.586,45	274.480,58	-5.818.516,68
IDIF24C382700	-1.414.632,96	964.620,97	32.537,95	4,97%	-9.999.375,47	1.388.523,64	1.414.624,22	-30.865.532,71
IDIF24P381200	1.180.556,62	847.813,03	28.597,86	4,37%	-1.177.695,78	6.364.936,93	16.039.768,70	-1.180.556,52
IDIF24P381300	-1.266.591,04	884.576,58	-29.837,94	-4,56%	1.262.992,07	-6.454.055,33	-16.134.866,94	1.266.591,04
IDIF24P381600	-1.529.609,18	992.444,58	-33.476,47	-5,11%	1.523.248,13	-6.715.612,15	-16.415.244,97	1.529.609,18
IDIF24P381700	1.622.320,48	1.027.935,30	34.673,62	5,30%	-1.614.742,28	6.798.157,23	16.503.665,79	-1.622.320,48
IDIF24P381800	1.720.944,94	1.063.134,16	35.860,93	5,48%	-1.711.817,68	6.875.451,71	16.586.173,93	-1.720.944,94
IDIF24P381900	-1.826.383,24	1.097.784,47	-37.029,73	-5,66%	1.815.237,44	-6.946.633,44	-16.661.868,75	1.826.383,24
IDIF24P382400	-2.351.440,52	1.265.535,55	-42.688,20	-6,52%	2.328.311,98	-7.302.027,02	-17.042.473,03	2.351.440,52
IDIF24P382500	2.470.643,56	1.296.805,41	43.742,97	6,68%	-2.443.445,66	7.360.047,46	17.104.403,02	-2.470.643,56
IDIJ23P348000	24,60	18,14	-4,93	0,00%	-24,60	436.193,31	2.480.407,60	-24,60
IDIJ23P348100	-556.596,01	71.921,82	19.561,35	2,99%	556.596,01	-3.942.148,31	-17.481.894,26	556.596,01
IDIJ23P348200	1.454.850,00	51.175,92	-13.918,86	-2,13%	-1.454.595,63	2.663.106,54	11.792.526,30	-1.454.850,00
IDIN23C359100	-23.016,96	24.549,18	-3.131,25	-0,48%	-862.689,43	23.016,96	23.016,96	-3.634.097,06
IDIN23C359200	17.644,80	16.621,53	2.120,08	0,32%	806.260,00	-17.644,80	-17.644,80	3.578.439,39
IDIN23P358900	532.101,00	627.361,20	-80.022,58	-12,22%	-532.101,00	24.122.162,62	71.079.394,76	-532.101,00
IDIN23P359000	-1.016.522,67	1.192.650,25	152.122,75	23,23%	1.016.522,67	-27.473.018,86	-77.950.278,57	1.016.522,67
IDIN23P359100	-2.073.860,49	1.417.723,33	180.830,86	27,62%	2.073.860,49	-22.842.785,23	-64.112.702,39	2.073.860,49
IDIN23P359200	3.859.433,22	1.763.859,91	-224.980,65	-34,36%	-3.859.433,21	24.943.937,47	69.734.254,89	-3.859.433,22
IDIN23P359300	148.503,60	51.467,83	-6.564,73	-1,00%	-148.503,46	677.547,15	1.888.104,13	-148.503,60
IDIN23P359400	-386.726,65	108.543,67	13.844,76	2,11%	386.717,65	-1.362.718,85	-3.786.943,06	386.726,65
IDIN23P359500	238.376,11	56.271,94	-7.177,50	-1,10%	-238.335,83	683.260,40	1.894.491,23	-238.376,11
IVIA35	1.337.505,41	80,88	24,51	0,00%	-327,41	267,24	556,43	-810,89
LF0021006S0	1.126.653,33	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002100HDP	1.338.963,81	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002100HDQ	2.386.848,53	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002100SJ	2.557.858,62	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF00220018H	1.141.618,49	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFSC1900089	3.329.350,16	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20230301 - 210100	18.025.120,49	15,83	3,03	0,00%	-156,82	157,88	1,92	-2,93
LFT20230901 - 210100	2.574.980,06	173,93	-24,59	0,00%	-2.988,29	3.339,88	9,78	-14,89
NTNB20500815 - 760199_NEGOCIACAO	22.957,83	749,00	309,79	0,05%	-2.052,79	4.210,06	3.171,48	-3.443,12
OMGE13	1.100.467,20	905,10	651,44	0,10%	-2.745,73	2.298,57	4.161,88	-5.590,90
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PRLG14	2.281.893,52	9,58	-0,09	0,00%	-58,48	49,61	115,83	-171,74
VAMO22	1.066.396,08	275,82	137,74	0,02%	-939,31	762,57	1.449,93	-2.062,53
WDOH23	3.880,01	0,00	0,00	0,00%	124.692,80	-124.775,20	152.349,26	-153.593,33
WDOJ23	-9.913,17	87.736,31	55.763,80	8,52%	-162.952,60	165.764,20	-210.621,17	211.670,00
Total Var:	247.817.884,38	17.681.553,09	654.722,53	99,99%	-3.140.938,36	-1.198.793,72	-3.625.017,20	-2.899.055,60



Data: 28/02/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIM EMB II A
CNPJ: 20725957000102

Dados Gerais					
PL:	180.990.758,62	VAR / PL:	0,3273%	Limite Fundo:	0,00%
VAR:	592.387,74	ETL / PL:	0,4105%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	742.878,13	VAR / CDI:	0,0037%	Benchmark:	
				Dutacion DC:	515,69
				Dutacion DU:	354,75

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	1.607.711,31	Cenário Baixa - 10000 (+):	3.025.859,59	CENARIO BRADESCO 1 (+):	3.610.024,17
Cenário Alta - 09999 (-):	(3.005.538,89)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(1.397.309,42)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(1.882.292,43)
Cenário Alta - 09999:	(1.397.827,57)	Cenário Baixa - 10000:	1.628.550,17	CENARIO BRADESCO 1:	1.727.731,74
				CENARIO BRADESCO 2 (+):	2.536.630,80
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	(4.770.518,82)
				CENARIO BRADESCO 2:	(2.233.888,02)

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
AEQP13	553.952,08	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CAIXA	9.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA PRE	3.389.594,16	0,00	0,00	0,00%	-94,35	96,21	440,37	-670,23
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	3.684,59	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPGT14	144.872,07	19,85	-15,80	0,00%	207,21	-188,84	-487,81	745,57
CPGT16	291.249,66	104,48	-92,50	-0,02%	396,88	-321,24	-659,63	979,81
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DI1F24	456,19	5.632,77	-4.826,00	-0,81%	28.132,81	-22.794,13	-48.872,60	71.928,26
DI1F25	-6.669,25	66.011,94	57.004,12	9,62%	-194.882,94	156.337,77	283.208,55	-401.668,83
DI1F26	-317,57	3.194,89	2.489,62	0,42%	-8.949,48	7.404,62	12.972,44	-17.695,41
DI1F27	-4.610,71	45.984,25	31.785,43	5,37%	-127.878,60	108.636,86	190.601,99	-249.863,98
DI1F29	-491,59	4.396,66	2.347,58	0,40%	-12.320,78	10.907,13	19.733,06	-23.824,56
DI1F33	-424,51	4.412,08	1.705,63	0,29%	-12.036,78	11.411,41	21.612,22	-22.192,24
DI1J23	1,02	4,02	1,56	0,00%	-205,81	208,97	925,33	-1.403,03
DI1J24	-165,58	2.372,74	2.072,07	0,35%	-9.585,81	7.544,46	15.180,56	-22.136,96
DI1J25	-121,34	1.235,26	1.042,25	0,18%	-3.561,71	2.865,20	5.118,73	-7.193,34
DI1N23	-8,05	1.015,13	-789,12	-0,13%	12.144,03	-11.553,38	-31.890,66	47.873,88
DI1N24	144,10	2.076,85	-1.837,01	-0,31%	7.016,21	-5.576,51	-10.788,21	15.588,04
DI1N25	27.632,24	257.422,31	-211.395,21	-35,69%	735.837,53	-596.709,18	-1.058.382,49	1.473.672,54
DI1N26	14.035,71	137.859,01	-101.354,34	-17,11%	385.080,99	-321.594,07	-565.708,87	756.705,28
DI1V23	-10,08	129,55	108,00	0,02%	-915,24	776,78	1.799,27	-2.673,39
DI1V24	-213,75	2.705,08	2.382,80	0,40%	-8.334,99	6.633,76	12.423,81	-17.782,74
ERDV18	1.407.000,65	12,62	10,53	0,00%	-91,20	78,33	194,14	-289,14
INDJ23	-18.525,00	150.117,40	51.439,30	8,68%	365.324,05	-364.651,99	286.691,43	-287.879,84
LFSC18002GT	426.808,79	0,00	0,00	0,00%	1.805,13	-1.392,88	-2.799,30	4.295,86
LFSC1900089	3.329.350,16	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFSC19000HY	415.002,39	0,00	0,00	0,00%	1.929,65	-1.485,41	-2.759,21	4.234,91
LFT20230301 - 210100	38.625.258,19	33,92	-16,14	0,00%	-336,03	338,31	4,12	-6,27
LFT20230901 - 210100	15.025.008,65	1.014,89	-155,77	-0,03%	-17.436,67	19.486,18	57,08	-86,90
LFT20240301 - 210100	7.956.560,83	798,25	-11,60	0,00%	-23.085,60	28.920,93	62,87	-95,71
LFT20240901 - 210100	16.736.385,46	2.412,58	-69,26	-0,01%	-74.002,50	99.176,31	315,62	-480,51
LFT20250901 - 210100	9.106.751,39	1.149,21	276,50	0,05%	-59.196,08	100.610,93	2.254,52	-3.431,37
LFT20260901 - 210100	1.706.974,05	1.020,38	550,95	0,09%	-12.466,40	29.631,51	1.383,58	-2.104,31
LTN20230701 - 100000	3.103.213,54	1.301,55	697,09	0,12%	-13.133,97	12.459,23	34.437,35	-51.697,05
LTN20240101 - 100000	2.251.605,63	7.039,87	5.671,16	0,96%	-35.129,60	28.529,07	61.099,33	-89.922,48
LTN20250701 - 100000	14.984.643,48	262.418,62	215.426,66	36,37%	-744.943,87	643.710,08	1.107.342,32	-1.541.121,15
LTN20260701 - 100000	5.326.621,12	136.416,02	102.778,28	17,35%	-372.323,27	352.471,66	584.166,64	-780.335,21
NTNB20240815 - 760199 - NEGOCIACAO	12.270.156,51	110.402,61	98.701,74	16,66%	-225.538,01	233.458,34	156.190,71	-208.764,75
NTNB20250515 - 760199 - NEGOCIACAO	16.006.891,02	183.562,15	176.623,28	29,82%	-365.696,22	383.652,93	280.147,71	-372.146,25
NTNB20260815 - 760199 - NEGOCIACAO	4.425.457,29	64.499,69	63.700,08	10,75%	-141.367,84	164.716,51	122.696,90	-160.949,58
NTNB20270515 - 760199 - NEGOCIACAO	6.799.397,10	102.260,48	100.113,17	16,90%	-245.252,35	289.748,76	222.615,77	-289.936,34
NTNB20280815 - 760199 - NEGOCIACAO	2.218.748,90	33.943,01	32.037,68	5,41%	-92.962,41	122.607,92	96.081,54	-123.451,54
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
WDOJ23	4.248,50	37.601,28	-7.317,30	-1,24%	69.836,83	-71.041,80	90.266,21	-90.715,71
WINJ23	10.335,00	83.749,71	-28.697,72	-4,84%	-203.812,36	203.437,43	-159.943,64	160.606,65
Total Var:	166.639.483,02	1.714.331,11	592.387,74	100,02%	-1.397.827,57	1.628.550,17	1.727.731,74	-2.233.888,02



Data: 28/02/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIM EMB VI A CRED PRIV CNPJ: 4183766000109

Table with columns: PL, VAR, ETL, VAR/PL, ETL/PL, VAR/CDI, Limite Fundo, Status, ENQUADRADO, 0,00% Dutation DC, Dutation DU, 1.109,18, 762,76

Table with columns: Cenário Alta - 09999 (+), Cenário Baixa - 10000 (+), CENÁRIO BRADESCO 1 (+), CENÁRIO BRADESCO 2 (+), Cenário Alta - 09999 (-), Cenário Baixa - 10000 (-), CENÁRIO BRADESCO 1 (-), CENÁRIO BRADESCO 2 (-), Cenário Alta - 09999, Cenário Baixa - 10000, CENÁRIO BRADESCO 1, CENÁRIO BRADESCO 2

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

Main table with columns: Produto, MIM, VAR Tot., Comp. VAR, Comp. VAR (%), Cenário Alta - 09999, Cenário Baixa - 10000, CENÁRIO BRADESCO 1, CENÁRIO BRADESCO 2. Lists various financial products and their risk metrics.



Data: 28/02/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIM EMB VI A CRED PRIV
CNPJ: 4183766000109

Dados Gerais			
PL:	232.089,343,57	VAR / PL:	1,0534%
VAR:	2.444.938,38	ETL / PL:	1,3211%
ETL:	3.066.051,37	VAR / CDI:	0,0118%
Limite Fundo:		Status:	ENQUADRADO
Benchmark:		Dutacion DC:	0,00%
		Dutacion DU:	1,109,18
			762,76

Cenários de STRESS			
Cenário Alta - 09999 (+):	1.416.755,79	Cenário Baixa - 10000 (+):	6.263.929,80
Cenário Alta - 09999 (-):	(5.648.099,21)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(1.085.332,57)
Cenário Alta - 09999:	(4.231.343,42)	Cenário Baixa - 10000:	5.178.597,23
CENARIO BRADESCO 1 (+):	36.988.067,70	CENARIO BRADESCO 2 (+):	4.003.542,21
CENARIO BRADESCO 1 (-):	(4.027.529,18)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(38.028.356,25)
CENARIO BRADESCO 1:	32.960.538,52	CENARIO BRADESCO 2:	(34.024.814,04)

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

Produto	MIM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
VERDECS2	99.987,77	37.435,08	-15.537,12	-0,64%	0,00	0,00	0,00	0,00
VIXL14	2.170.002,76	454,28	364,65	0,01%	-1.609,65	1.303,53	2.535,81	-3.636,99
VVEO15	1.727.853,41	891,67	652,88	0,03%	-2.765,26	2.272,34	4.159,75	-5.772,70
VVEO16	1.098.437,03	626,37	449,29	0,02%	-1.924,77	1.586,87	2.897,59	-3.996,63
Total Var:	156.199.208,77	3.665.201,99	2.444.938,38	99,97%	-4.231.343,42	5.178.597,23	32.960.538,52	-34.024.814,04



Data: 28/02/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO:		FIM EMB VII A CRED PRIV		CNPJ:		41687175000104		
Dados Gerais								
PL:	259.630.780,33	VAR / PL:	2,7368%	Limite Fundo:	0,00%	Duration DC:	2.032,49	
VAR:	7.105.685,19	ETL / PL:	3,4321%	Status:	ENQUADRADO	Duration DU:	1.398,11	
ETL:	8.910.815,90	VAR / CDI:	0,0308%	Benchmark:				
Cenários de STRESS								
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (+):	15.702.947,02	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	15.612.257,82	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	-	
Cenário Alta - 09999 (-):	(18.553.219,50)	Cenário Baixa - 10000 (-):	-	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	-	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(19.444.764,95)	
Cenário Alta - 09999:	(18.553.219,50)	Cenário Baixa - 10000:	15.702.947,02	CENÁRIO BRADESCO 1:	15.612.257,82	CENÁRIO BRADESCO 2:	(19.444.764,95)	
Parâmetros do Cálculo								
Modelo:	Var paramétrico	Modelo Volatilidade:	Lambda:	EWMA				
Int. Confiança:	95			0,94				
Horizonte:	21							
Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
ANEM11	11.745.457,57	314.657,34	311.894,28	4,39%	-805.089,50	679.918,81	701.476,84	-856.670,51
ANET11	2.497.352,74	31.869,82	29.423,88	0,41%	-78.383,23	66.080,16	57.842,89	-75.461,49
BRKP28	4.963.683,35	148.669,47	147.058,04	2,07%	-383.039,92	326.469,77	336.342,57	-416.112,31
BRST11	6.495.319,87	102.108,72	92.317,39	1,30%	-232.100,25	205.918,29	175.352,05	-229.499,57
BTOW15	7.709.715,91	190.667,19	190.607,46	2,68%	-503.761,25	427.198,99	422.405,99	-532.980,82
CAEC21	8.384.328,89	157.073,94	148.914,56	2,10%	-402.232,70	316.502,04	301.234,37	-390.054,21
CAIXA	998,84	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CART13	5.248.935,51	130.778,36	130.729,70	1,84%	-343.096,52	287.722,56	289.320,46	-361.754,01
CSAN32	9.053.398,41	232.341,08	232.197,43	3,27%	-615.864,36	510.788,01	517.590,06	-648.417,44
CBAN72	2.202.041,91	58.784,24	58.693,70	0,83%	-155.349,51	129.103,35	131.529,96	-164.372,33
CJEN13	4.363.068,84	107.024,88	106.994,34	1,51%	-279.663,32	235.413,13	236.090,54	-294.793,22
CNRD11	9.316.373,60	259.074,10	258.162,32	3,63%	-672.453,70	565.280,72	578.360,80	-716.725,06
COMPROMISSADA_PRE	9.419.525,34	0,00	0,00	0,00%	-262,19	267,36	1.223,76	-1.862,53
CONTAS A PAGAR_RECEBER	-122.139,69	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CONX12	9.305.051,49	175.038,44	167.440,61	2,36%	-451.973,70	358.288,80	340.632,87	-440.315,94
CREDZM24	1.686.803,82	81.073,14	-23.438,50	-0,33%	0,00	0,00	0,00	0,00
CRMG15	4.535.670,09	80.268,94	78.635,05	1,11%	-207.733,87	175.228,71	163.828,49	-210.164,12
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
EGIEA0	3.242.413,79	137.334,01	132.440,98	1,86%	-320.160,11	292.157,57	303.093,47	-351.287,21
ENGIA5	2.007.878,86	49.216,43	49.199,83	0,69%	-130.505,46	109.681,07	109.027,69	-137.602,77
ERDV17	3.864.524,78	33.142,51	27.760,63	0,39%	-73.260,52	73.974,87	52.651,98	-70.102,01
ERDV38	5.627.846,74	74.413,43	64.235,11	0,90%	-146.817,66	153.755,53	115.436,67	-152.585,70
GASP19	2.829.228,96	70.992,86	70.966,85	1,00%	-189.360,51	157.514,53	157.243,99	-198.627,25
GBSP11	7.531.549,51	285.954,87	277.927,49	3,91%	-690.329,54	600.376,35	632.894,17	-747.305,09
GRRB24	7.783.713,15	155.747,53	150.500,37	2,12%	-412.838,51	321.431,48	314.093,29	-404.882,59
HARG11	3.934.470,06	107.001,73	106.476,13	1,50%	-275.114,21	233.179,34	238.432,45	-293.680,39
HBSA21	4.333.698,00	106.330,53	106.294,52	1,50%	-281.952,43	236.960,57	235.577,84	-297.311,05
IPIL11	8.483.511,51	182.466,94	182.198,57	2,56%	-476.510,37	403.886,94	394.936,02	-496.699,22
IRBR12	10.811.769,74	170.061,57	150.232,13	2,11%	-368.458,18	330.524,36	273.975,65	-360.114,24
ITPO14	8.627.269,56	284.753,05	282.121,30	3,97%	-730.653,78	613.159,86	638.929,60	-785.771,25
LAMEA6	8.029.702,42	191.685,71	191.616,92	2,70%	-506.423,93	430.341,60	422.897,63	-534.580,18
LCAMD1	4.643.406,64	111.226,11	111.223,54	1,57%	-296.038,12	247.173,54	245.791,70	-310.540,66
LIGHD7	5.618.094,46	87.126,31	76.711,42	1,08%	-185.369,59	170.760,68	138.979,50	-182.917,66
LORTA7	5.852.130,36	143.795,90	143.745,04	2,02%	-381.963,86	320.374,36	318.460,11	-402.229,14
LITE15	3.514.204,17	95.095,81	94.656,44	1,33%	-243.379,30	206.684,22	210.760,66	-259.021,82
MGSP12	5.856.857,60	167.870,67	166.666,43	2,35%	-429.338,51	362.183,63	373.540,02	-456.991,58
MOVIS7	8.081.383,31	189.138,49	189.040,49	2,66%	-503.204,06	420.141,86	416.593,84	-526.734,49
MTRJ19	2.538.528,10	47.958,03	47.212,86	0,66%	-124.416,12	105.111,07	99.173,64	-126.851,33
NTEN11	6.544.607,14	115.309,90	110.781,37	1,56%	-291.921,76	244.653,58	225.704,67	-291.480,78
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PASN12	7.101.991,67	107.724,24	102.882,91	1,45%	-274.296,24	231.699,64	209.188,87	-270.749,02
PEJA11	6.373.763,94	145.331,98	144.894,83	2,04%	-386.692,39	319.742,83	315.558,43	-400.020,54
QUAT12	4.419.098,11	60.770,38	52.479,07	0,74%	-120.103,31	123.419,83	93.650,62	-123.795,50
RAHD11	11.646.036,51	351.534,79	348.366,94	4,90%	-891.740,29	753.623,90	781.216,98	-950.449,91
RDVE11	3.680.944,01	98.200,82	98.085,02	1,38%	-252.500,44	214.597,56	216.429,48	-287.883,31
RMSA12	5.628.882,92	243.707,97	236.278,57	3,33%	-592.595,29	503.988,00	540.544,21	-642.546,80
RSAN44	5.137.239,69	97.140,14	94.489,83	1,33%	-246.899,70	209.945,05	195.219,42	-250.928,55
TCIH11	10.995.970,92	359.929,76	355.575,36	5,00%	-906.865,65	762.285,74	798.628,04	-964.429,92
TNHL12	2.523.616,46	77.002,47	76.315,58	1,07%	-194.734,84	164.528,92	170.514,15	-206.634,18
UHSM11	1.786.216,04	63.702,90	62.190,24	0,88%	-159.197,70	134.773,87	142.936,37	-173.351,57
UNEG11	1.751.427,57	60.986,32	59.674,16	0,84%	-152.413,98	128.521,18	136.177,56	-164.406,26
UTPS11	3.910.641,14	53.271,54	48.668,99	0,68%	-128.167,43	110.033,40	94.891,07	-124.056,78
UTPS21	4.051.027,59	119.542,11	118.511,69	1,67%	-307.617,96	259.895,08	268.398,79	-330.639,20
UTPS22	2.569.490,88	79.334,91	78.459,99	1,10%	-203.451,70	171.850,65	178.404,71	-219.341,23
VAMO33	5.880.131,56	140.002,60	139.883,28	1,97%	-374.011,68	309.656,75	307.709,55	-389.643,54
VAMO34	6.061.161,31	157.850,45	157.786,54	2,22%	-418.540,74	351.834,22	348.234,27	-439.992,96
VERDECS2	176.200,67	65.988,93	-18.954,06	-0,27%	0,00	0,00	0,00	0,00
VIMT13	6.632.846,05	176.818,79	176.107,91	2,48%	-458.729,07	386.896,27	394.765,45	-488.446,17
VRDN12	4.562.579,02	112.374,28	112.349,64	1,58%	-295.640,58	247.246,46	248.363,62	-310.949,54
Total Var:	311.851.641,41	7.447.287,39	7.105.685,19	100,00%	-18.553.219,50	15.702.947,02	15.612.257,81	-19.444.764,95



Data: 28/02/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIM EMB III A IMOBILIÁRIO
CNPJ: 3271199000162

Dados Gerais						
PL:	82.285.792,38	VAR / PL:	3,1468%	Limite Fundo:		0,00%
VAR:	2.539.380,89	ETL / PL:	3,9462%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DC:
ETL:	3.247.188,10	VAR / CDI:	0,0354%	Benchmark:		Dutacion DU:
						1,00
						1,00

Cenários de STRESS						
Cenário Alta - 09999 (+):	43.380.329,35	Cenário Baixa - 10000 (+):	6,16	CENARIO BRADESCO 1 (+):	11.040.192,40	CENARIO BRADESCO 2 (+):
Cenário Alta - 09999 (-):	(6,04)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(43.380.329,35)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):
Cenário Alta - 09999:	43.380.323,31	Cenário Baixa - 10000:	(43.380.323,19)	CENARIO BRADESCO 1:	11.040.192,40	CENARIO BRADESCO 2:
						(11.130.576,82)
						(11.130.576,82)

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

Produto	MIM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
AIEC11	3.441.378,96	123.467,13	29.881,16	1,15%	1.720.689,48	-1.720.689,48	504.506,16	-508.635,81
BMLC11	2.968.958,40	113.470,62	24.546,75	0,95%	2.968.958,40	-2.968.958,40	435.249,30	-438.812,05
BPML11	958.642,18	36.080,14	11.520,20	0,44%	958.642,18	-958.642,18	140.536,94	-141.687,31
BTLG11	2.609.228,70	75.836,20	10.270,31	0,40%	1.304.614,35	-1.304.614,35	382.512,93	-385.644,00
CAXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CEOC11	778.999,30	45.065,41	37.332,74	1,44%	389.499,65	-389.499,65	114.201,30	-115.136,10
CNES11	472.258,38	34.799,88	-3.777,52	-0,15%	236.129,19	-236.129,19	69.233,08	-69.799,79
COMPROMISSADA PRE	217.091,41	0,00	0,00	0,00%	6,16	6,16	28,20	-42,93
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	4.219.173,78	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
FVPO11	1.040.120,55	59.698,08	44.337,23	1,71%	520.060,28	-520.060,28	152.481,67	-153.729,82
GALG11	2.477.692,80	87.422,21	-45.031,53	-1,74%	1.238.846,40	-1.238.846,40	363.229,76	-366.203,00
GTLG11	1.397.646,60	29.770,78	-10.636,93	-0,41%	1.397.646,60	-1.397.646,60	204.894,99	-206.572,17
HBRH11	2.621.593,89	239.324,35	168.099,00	6,49%	2.621.593,89	-2.621.593,89	384.325,66	-387.471,58
HSLG11	2.941.969,09	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
HSM11	7.746.475,22	712.119,96	523.983,67	20,24%	3.873.237,61	-3.873.237,61	1.135.633,27	-1.144.929,04
MALL11	3.015.513,09	121.661,49	63.444,14	2,45%	1.507.756,55	-1.507.756,55	442.074,22	-445.692,84
MAXR11	1.158.562,69	142.730,92	-3.544,19	-0,14%	579.281,35	-579.281,35	169.845,29	-171.235,57
NEWL11	940.246,00	45.415,29	38.430,56	1,48%	470.123,00	-470.123,00	137.840,06	-138.968,36
NEWU11	757.392,00	162.829,17	85.276,22	3,29%	757.392,00	-757.392,00	111.033,67	-111.942,54
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PATC11	9.212.029,80	374.824,78	308.482,09	11,91%	4.606.014,90	-4.606.014,90	1.350.483,57	-1.351.538,00
QAGR11	7.124.829,95	398.909,05	202.585,05	7,82%	3.562.414,98	-3.562.414,98	1.044.500,07	-1.053.049,87
RBR11	2.748.347,89	260.675,93	38.115,14	1,47%	2.748.347,89	-2.748.347,89	402.907,80	-406.205,82
RCRB11	4.940.524,29	265.370,95	194.003,20	7,49%	0,00	0,00	0,00	0,00
RNGO11	125.162,64	3.028,35	839,32	0,03%	62.581,32	-62.581,32	18.348,84	-18.499,04
TEPP11	6.143.297,00	467.666,46	377.154,48	14,57%	3.071.648,50	-3.071.648,50	900.607,34	-907.979,30
TRXF11	11.794.935,80	198.344,43	165.606,40	6,40%	5.897.467,90	-5.897.467,90	1.729.137,59	-1.743.291,51
XPIN11	3.031.828,10	170.207,23	152.625,70	5,89%	1.515.914,05	-1.515.914,05	444.466,00	-448.104,19
XPPR11	2.742.937,80	243.209,18	175.837,70	6,79%	1.371.468,90	-1.371.468,90	402.114,68	-405.406,21
Total Var:	87.627.836,31	4.411.927,99	2.589.380,89	99,97%	43.380.323,31	-43.380.323,19	11.040.192,40	-11.130.576,82



Data: 28/02/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIA RVA EMB II CNPJ: 13294268000125

Dados Gerais					
PL:	214.308.001,65	VAR / PL:	7,7758%	Limite Fundo:	0,00%
VAR:	16.664.104,43	ETL / PL:	9,7511%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	20.897.459,24	VAR / CDI:	0,0874%	Benchmark:	Dutacion DC: 1,00 Dutacion DU: 1,00

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	55.258.701,06	Cenário Baixa - 10000 (-):	-	CENARIO BRADESCO 1 (+):	31.544.571,34
Cenário Alta - 09999 (-):	-	Cenário Baixa - 10000 (-):	(55.965.135,31)	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
Cenário Alta - 09999:	55.258.701,06	Cenário Baixa - 10000:	(55.965.135,31)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	(31.799.122,82)
				CENARIO BRADESCO 1:	31.544.571,34
				CENARIO BRADESCO 2:	(31.799.122,82)

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
ABEV3	6.119.296,95	344.035,09	-128.656,05	-0,77%	856.701,57	-1.835.789,09	897.088,93	-904.432,09
ARZ2	2.163.400,00	371.197,88	294.099,37	1,76%	649.020,00	-649.020,00	317.154,44	-319.750,52
B3SA3	8.696.670,95	1.536.907,52	1.242.457,22	7,46%	2.174.167,74	-2.174.167,74	1.274.931,96	-1.285.367,97
BBAS3	7.532.070,00	1.223.262,25	756.965,13	4,54%	1.883.017,50	-1.883.017,50	1.104.201,46	-1.113.239,95
BBD4	8.335.622,40	987.475,02	641.027,72	3,85%	2.083.905,60	-2.083.905,60	1.222.002,24	-1.232.004,99
BBS3	2.904.429,00	204.417,53	145.344,55	0,87%	580.885,80	-580.885,80	425.789,29	-429.274,61
BEEF3	1.358.467,00	399.542,95	309.027,99	1,85%	339.616,75	-339.616,75	199.151,26	-200.781,42
BPA11	2.819.920,00	258.925,24	87.745,66	0,53%	845.976,00	-986.972,00	413.400,27	-416.784,16
CADA	10.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CIEL3	2.517.600,00	340.097,85	161.963,69	0,97%	755.280,00	-629.400,00	369.080,16	-372.101,28
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	1.656.171,33	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPFE3	2.162.706,00	174.243,41	153.208,56	0,92%	432.541,20	-432.541,20	317.052,70	-319.647,95
CSAN3	1.533.952,00	172.150,81	113.227,76	0,68%	383.488,00	-383.488,00	224.877,36	-226.718,11
CSMG3	618.570,00	45.534,05	-15.198,03	-0,09%	136.085,40	-167.013,90	90.682,36	-91.424,65
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
EGIE3	3.998.704,00	202.355,94	97.800,32	0,59%	719.766,72	-719.766,72	586.210,01	-591.008,45
ELET3	3.257.723,04	431.558,55	302.358,47	1,81%	977.316,91	-977.326,40	477.582,20	-481.491,47
ELET6	2.733.720,00	341.528,63	264.432,41	1,59%	820.116,00	-820.123,60	400.763,35	-404.043,82
ENEV3	2.136.267,00	227.076,05	197.762,49	1,19%	790.418,79	-1.089.496,17	313.176,74	-315.740,26
ENG11	1.984.797,00	125.408,10	87.460,02	0,52%	337.410,36	-436.655,34	290.971,24	-293.353,00
EQT13	3.435.593,00	278.384,51	250.660,22	1,50%	687.118,60	-687.118,60	503.657,93	-507.780,65
GGBR4	4.437.650,00	947.152,07	453.675,60	2,72%	1.109.412,50	-1.109.412,50	650.559,49	-655.884,67
GMAT3	3.378.360,00	631.544,48	582.915,88	3,50%	608.044,90	-540.597,50	495.267,58	-499.321,61
HAPV3	3.331.526,12	1.007.734,06	41.487,19	0,25%	799.566,27	-799.566,27	488.401,73	-492.399,56
HYPE3	3.307.010,00	263.852,78	178.397,87	1,07%	760.604,36	-694.472,10	484.807,67	-488.776,08
INDJ23	-58.500,00	474.054,94	468.382,32	2,81%	1.153.654,89	-1.151.532,59	905.341,37	-909.094,25
INTB3	2.150.247,00	242.742,67	221.701,30	1,33%	1.075.123,50	-752.586,45	315.226,21	-317.806,51
ITSA4	4.101.354,66	254.008,86	177.474,86	1,07%	779.257,39	-779.257,39	601.258,59	-606.180,22
ITUB4	14.783.399,91	1.425.359,85	746.144,34	4,48%	2.956.679,98	-2.808.845,98	2.167.246,43	-2.184.986,51
JBSS3	3.411.982,00	489.088,34	297.508,85	1,79%	1.194.193,70	-1.194.193,70	500.196,56	-504.290,94
LREN3	4.281.107,50	697.311,39	550.811,35	3,31%	856.221,50	-856.221,50	627.610,36	-632.747,69
MGLU3	1.225.267,00	608.064,23	476.055,54	2,86%	367.580,10	-367.580,10	179.624,14	-161.094,46
MULT3	3.123.597,00	469.808,73	146.911,96	0,88%	937.079,10	-790.899,25	457.919,32	-461.667,64
NTCO3	2.080.456,00	567.018,84	170.793,50	1,02%	520.114,00	-416.091,20	304.994,85	-307.491,40
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PETR3	5.474.000,00	903.344,18	480.785,14	2,89%	1.368.500,00	-1.642.200,00	802.488,40	-809.057,20
PETR4	15.647.765,16	2.828.621,27	1.561.634,96	9,37%	3.911.941,29	-4.694.329,55	2.293.962,37	-2.312.739,69
PETZ3	621.780,00	163.160,64	37.967,32	0,23%	155.445,00	-155.445,00	91.152,95	-91.899,08
PRIO3	4.913.460,00	928.043,74	724.108,16	4,35%	2.948.076,00	-2.948.076,00	720.313,24	-726.209,39
RADL3	4.259.304,00	360.698,16	322.203,64	1,93%	851.860,80	-851.860,80	624.413,97	-629.525,13
RENT3	5.732.117,00	996.933,66	711.278,11	4,27%	1.891.598,61	-1.490.350,42	840.328,35	-847.206,89
RRRP3	1.838.705,00	579.759,18	530.407,49	3,18%	1.103.223,00	-1.103.223,00	269.554,15	-271.760,60
SBSF3	3.053.250,00	161.573,83	99.379,42	0,24%	763.312,50	-763.312,50	447.606,45	-451.270,35
STBP3	2.667.330,00	435.356,93	367.547,95	2,21%	933.565,50	-933.565,50	391.030,58	-394.231,37
SUZB3	5.151.146,00	397.399,49	-86.620,74	-0,52%	1.287.786,50	-1.030.229,20	755.158,00	-761.339,38
TMS3	2.756.048,00	272.410,38	-143.118,01	-0,86%	881.935,36	-633.891,04	404.036,64	-407.343,89
TOTS3	2.990.520,07	423.389,57	356.969,52	2,14%	598.104,01	-598.104,01	438.410,24	-441.998,87
VALE3	34.434.725,40	6.554.075,69	2.313.395,40	13,88%	8.608.681,35	-8.608.681,35	5.048.130,74	-5.089.452,41
WEGE3	5.537.224,00	277.437,86	-25.782,02	-0,15%	1.384.306,00	-1.384.306,00	811.757,04	-818.401,71
Total Var:	210.606.511,49	31.022.046,78	16.664.104,43	100,02%	55.258.701,06	-55.965.135,31	31.544.571,34	-31.799.122,83



Data: 28/02/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIA RVA EMB III
CNPJ: 38452593000108

Dados Gerais			
PL:	87.909.697,32	VAR / PL:	8,6933%
VAR:	7.642.246,27	ETL / PL:	10,9017%
ETL:	9.583.685,14	VAR / CDI:	0,0978%
Limite Fundo:		Status:	ENQUADRADO
Benchmark:		Dutacion DC:	0,00%
		Dutacion DU:	1,00

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	24.221.935,44	Cenário Baixa - 10000 (+):	888.111,22	CENARIO BRADESCO 1 (+):	12.558.439,54	CENARIO BRADESCO 2 (+):	1.133.946,41
Cenário Alta - 09999 (-):	(873.047,40)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(23.925.836,13)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(1.128.327,67)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(12.661.445,84)
Cenário Alta - 09999:	23.348.888,04	Cenário Baixa - 10000:	(23.037.724,91)	CENARIO BRADESCO 1:	11.430.111,87	CENARIO BRADESCO 2:	(11.527.499,43)

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

Produto	MIM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
ALPA4	363.998,00	81.855,14	31.933,18	0,42%	90.999,50	-90.999,50	53.362,11	-53.798,90
ALSO3	4.450.262,32	622.142,76	583.300,18	7,63%	1.557.591,81	-1.112.565,58	652.408,46	-657.748,77
AURE3	4.352.576,40	216.742,68	129.236,58	1,69%	1.088.144,10	-1.349.298,68	638.087,70	-643.310,79
B3SA3	246.870,00	43.627,77	22.477,63	0,29%	61.717,50	-61.717,50	36.191,14	-36.487,39
BBAS3	2.075.450,00	337.067,98	280.168,71	3,67%	518.862,50	-518.862,50	304.260,97	-306.751,51
BPAC11	5.350.980,00	487.532,21	234.884,70	3,07%	1.605.294,00	-1.872.843,00	784.453,67	-790.874,84
CADXA	999,99	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CLS3A	140.968,00	32.408,07	673,60	0,01%	70.484,00	-70.484,00	20.665,91	-20.835,07
COMPROMISSADA PRE	3.126.905,81	0,00	0,00	0,00%	-87,03	88,75	406,20	-616,23
CONTAS A PAGAR RECEBER	-858.235,44	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DOLJ23	-53.106,25	470.015,96	285.981,57	3,74%	-872.960,38	888.022,48	-1.128.327,67	1.133.946,41
ELET3	5.895.215,04	780.953,58	248.839,41	3,26%	1.768.564,51	-1.768.581,69	864.238,53	-871.312,78
ENEV3	5.115.633,66	543.770,00	414.811,81	5,43%	1.892.784,45	-2.608.973,17	749.951,90	-756.090,66
ENJU3	142.672,00	45.630,80	21.666,62	0,28%	64.202,40	-38.521,44	20.915,72	-21.086,92
EQL3L	9.461.765,53	766.682,47	638.190,74	8,35%	1.892.353,11	-1.892.353,11	1.387.094,83	-1.398.448,95
EUCA4	73.000,00	23.486,31	16.770,51	0,22%	58.400,00	-58.400,73	10.701,80	-10.789,40
HAPV3	1.647.830,00	498.442,56	237.083,68	3,10%	395.479,20	-395.479,20	241.571,88	-243.549,27
IGTH1	5.495.654,31	681.149,47	567.531,17	7,43%	1.099.130,86	-1.099.130,86	805.662,92	-812.257,71
ITSA4	394.217,00	24.415,01	19.655,31	0,26%	74.901,23	-74.901,23	57.792,21	-58.265,27
ITUB4	4.452.793,00	429.321,56	340.087,69	4,45%	890.558,60	-846.036,67	652.779,45	-659.122,81
LREN3	4.366.449,90	711.212,05	679.854,93	8,89%	873.289,98	-873.289,98	640.121,56	-645.361,30
LWSA3	184.353,00	27.636,09	19.229,25	0,25%	73.737,43	-73.744,97	27.026,15	-27.247,37
MRVE3	69.030,00	6.213,35	3.083,99	0,04%	20.709,00	-20.709,00	10.119,80	-10.202,63
NINJ3	271.440,00	44.977,41	19.283,29	0,25%	162.864,00	-162.864,00	39.793,10	-40.118,83
NTCO3	1.034.483,00	281.943,65	193.467,20	2,53%	258.620,75	-206.896,60	151.655,21	-152.896,59
ONCO3	874.000,00	236.716,91	177.955,65	2,33%	305.900,00	-305.900,00	128.128,40	-129.177,20
OUTRAS DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PETZ3	2.100.765,00	551.259,54	368.542,46	4,82%	525.191,25	-525.191,25	307.972,15	-310.493,07
PRIO3	522.350,00	98.660,34	51.946,92	0,68%	313.410,00	-313.410,00	76.576,51	-77.203,33
RAIZ4	832.832,00	72.780,47	39.977,44	0,52%	291.491,20	-291.491,20	122.093,17	-123.092,57
RDO3R	1.864.128,00	257.792,31	209.207,12	2,74%	559.238,40	-559.245,70	273.281,17	-275.518,12
RECV3	2.719.120,60	477.784,12	35.966,88	1,26%	1.631.472,36	-1.631.472,36	398.623,08	-401.886,03
RENT3	5.941.147,83	1.033.288,44	952.884,09	12,47%	1.960.578,78	-1.544.898,44	870.972,27	-878.101,65
RENT9	32.073,22	5.616,00	5.146,36	0,07%	0,00	0,00	0,00	0,00
SOMA3	2.483.098,14	401.312,23	383.761,71	5,02%	744.929,44	-744.957,72	364.022,19	-367.001,91
SUZB3	8.033.496,24	619.766,42	-184.259,09	-2,41%	2.008.374,06	-1.606.699,25	1.177.710,55	-1.187.350,74
TEND3	297.946,00	58.360,63	42.124,31	0,55%	104.281,10	-104.281,10	43.678,88	-44.036,42
VBBR3	3.289.236,84	408.499,12	365.178,17	4,78%	822.309,21	-822.309,21	482.202,12	-486.149,21
YDUQ3	1.118.130,00	181.796,85	145.802,51	1,91%	436.070,70	-279.532,50	163.917,86	-165.259,61
Total Var:	87.910.229,14	11.560.860,26	7.642.246,27	100,00%	23.348.888,04	-23.037.724,91	11.430.111,87	-11.527.499,42



Data: 28/02/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIA RVA EMB IV
CNPJ: 38452613000132

Dados Gerais							
PL:	86.170.241,40	VAR / PL:	8,6877%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	1,00
VAR:	7.486.229,07	ETL / PL:	10,8948%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1,00
ETL:	9.388.033,28	VAR / CDI:	0,0977%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	24.353.590,56	Cenário Baixa - 10000	-	CENARIO BRADESCO 1	11.419.739,03	CENARIO BRADESCO	-
Cenário Alta - 09999 (-):	-	Cenário Baixa - 10000	(22.446.852,58)	CENARIO BRADESCO 1	-	CENARIO BRADESCO	(11.513.215,75)
Cenário Alta - 09999:	24.353.590,56	Cenário Baixa - 10000	(22.446.852,58)	CENARIO BRADESCO 1:	11.419.739,03	CENARIO BRADESCO	(11.513.215,75)

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO	ICENARIO BRADESCO 2
ALSO3	4.132.933,00	577.780,40	523.373,90	6,99%	1.446.526,55	-1.033.233,25	605.887,98	-610.847,50
AURE3	5.583.018,80	278.014,29	174.334,12	2,33%	1.395.754,70	-1.730.735,83	818.470,56	-825.170,18
B3SA3	4.118.973,20	727.920,02	400.236,14	5,35%	1.029.743,30	-1.029.743,30	603.841,47	-608.784,24
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CONTAS_A PAGAR_RECEBER	40.447,20	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ENEV3	831.406,77	88.374,99	64.464,03	0,86%	307.620,51	-424.017,45	121.884,23	-122.881,92
EQTL3	12.253.877,81	992.926,03	870.144,57	11,62%	2.450.775,56	-2.450.775,56	1.796.418,49	-1.811.123,14
GGPS3	5.243.082,20	614.431,58	586.069,84	7,83%	2.359.386,99	-2.359.386,99	768.635,85	-774.927,55
GMAT3	5.239.836,36	979.525,48	738.431,59	9,86%	943.077,64	-838.466,72	768.160,01	-774.447,81
HAPV3	2.686.928,25	812.753,38	362.101,16	4,84%	644.862,78	-644.862,78	393.903,68	-397.128,00
ITUB4	5.512.054,22	531.451,55	393.666,58	5,26%	1.102.410,84	-1.047.290,30	808.067,15	-814.681,61
MATD3	1.437.232,80	460.791,23	329.997,99	4,41%	431.169,84	-431.169,84	210.698,33	-212.423,01
MULT3	3.825.235,92	575.339,66	387.605,52	5,18%	1.147.570,78	-956.308,98	560.779,59	-565.369,87
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PRIO3	6.535.104,00	1.234.336,36	785.354,81	10,49%	3.921.062,40	-3.921.062,40	958.046,25	-965.888,37
RAIL3	8.206.265,24	636.579,78	533.367,78	7,12%	3.692.819,36	-2.708.113,22	1.203.038,48	-1.212.886,00
RENT3	5.099.752,96	886.952,48	833.216,25	11,13%	1.682.918,48	-1.325.935,77	747.623,78	-753.743,49
UGPA3	5.042.812,98	449.903,56	257.445,80	3,44%	1.260.703,25	-1.008.562,60	739.276,38	-745.327,76
VBBR3	2.148.750,36	266.859,05	246.418,99	3,29%	537.187,59	-537.187,59	315.006,80	-317.585,30
Total Var:	77.938.712,07	10.113.939,83	7.486.229,07	100,00%	24.353.590,56	-22.446.852,58	11.419.739,03	-11.513.215,75



Data: 28/02/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI
CNPJ: 41901871000163

Dados Gerais								
PL:	95.868.145,61	VAR / PL:	7,5507%	Limite Fundo:		0,00%	Duration DC:	1,86
VAR:	7.238.712,16	ETL / PL:	9,4689%	Status:	ENQUADRADO		Duration DU:	1,60
ETL:	9.077.637,09	VAR / CDI:	0,0849%	Benchmark:				

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	24.494.769,72	Cenário Baixa - 10000 (+):	619,13	CENARIO BRADESCO 1 (+):	13.948.203,43	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
Cenário Alta - 09999 (-):	(556,96)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(24.885.967,10)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(14.061.295,77)
Cenário Alta - 09999:	24.494.212,76	Cenário Baixa - 10000:	(24.885.347,97)	CENARIO BRADESCO 1:	13.948.203,43	CENARIO BRADESCO 2:	(14.061.295,77)

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

Produto	MIM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
TIMS3	498.565,16	49.278,65	-26.402,00	-0,36%	159.540,85	-114.669,99	73.089,65	-73.687,93
TOTS3	716.198,76	101.397,44	84.152,77	1,16%	143.239,75	-143.239,75	104.994,74	-105.854,18
UGPA3	720.458,34	64.276,98	19.853,30	0,27%	180.114,59	-144.091,67	105.619,19	-106.483,74
USIM5	176.712,59	39.064,63	30.893,95	0,43%	68.917,91	-38.876,77	25.906,07	-26.118,12
VALE3	14.579.908,20	2.775.042,37	1.081.429,00	14,94%	3.644.977,05	-3.644.977,05	2.137.414,54	-2.154.910,43
VBR3	828.964,71	102.951,34	68.292,78	0,94%	207.241,18	-207.241,18	121.526,23	-122.520,98
VIIA3	153.099,18	34.691,11	25.397,76	0,35%	68.886,70	-68.894,63	22.444,34	-22.628,06
VIVT3	828.253,80	66.175,41	52.213,00	0,72%	124.235,94	-124.240,20	121.422,01	-122.415,91
WEGE3	2.599.049,20	130.223,13	-14.092,78	-0,19%	649.762,30	-649.762,30	381.020,61	-384.139,47
YDUQ3	104.770,05	17.034,57	15.103,26	0,21%	40.860,32	-26.192,51	15.359,29	-15.485,01
Total Var:	95.867.786,75	13.411.784,92	7.238.712,16	100,00%	24.494.212,76	-24.885.347,97	13.948.203,43	-14.061.295,77



3. RISCO DE CRÉDITO

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

3.1. Relatório de Risco de Crédito



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

28/02/2023

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS							INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	Título	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	25/05/15	15/04/13	15/04/23	RD COLIN	620.094,25	brAAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	27/05/15	15/04/13	15/04/23	RD COLIN	620.031,40	brAAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	27/05/15	15/04/13	15/04/23	RD COLIN	682.051,12	brAAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	01/06/15	15/04/13	15/04/23	RD COLIN	799.856,11	brAAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	12/08/15	16/07/13	16/07/23	DUKE GEP	1.506.088,12	-	Aaa.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	18/05/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	1.224.200,80	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	03/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	452.307,62	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	03/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	271.384,57	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	20/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	903.738,02	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	26/07/17	15/04/13	15/04/23	RD COLIN	1.464.848,45	brAAA+	A3.br	-
FI RF EMB II	DE252	25/08/17	25/08/17	15/08/24	PETR	18.047.752,40	AAA	Aaa.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	CRI	18/12/17	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	3.607.475,84	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	CRI	21/12/17	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	1.052.928,59	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	CRI	26/01/18	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	3.748.959,35	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB II	DE252	19/02/18	19/02/18	15/02/25	SABESP	9.095.173,28	brAAA	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	19/02/18	19/02/18	15/02/25	SABESP	5.644.548,58	brAAA	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DEBI	13/03/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	12.206.583,92	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB II	DE252	23/05/18	23/05/18	15/05/28	COMGAS	27.212.893,72	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DEBI	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	600.646,58	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DEBI	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	600.646,58	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DEBI	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	600.646,58	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DEBI	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	599.293,88	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DEBI	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	600.646,58	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	04/07/18	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	12.307.514,57	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	26/07/18	26/07/18	15/07/25	AEGEA SA	14.172.110,48	brA	Aa1.br	AA(bra)
FI RF EMB II	DE252	26/07/18	26/07/18	15/07/25	CSMG	12.801.647,94	-	Aa3.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	07/08/18	15/04/13	15/04/23	RD COLIN	459.083,87	brAAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	07/08/18	15/04/13	15/04/23	RD COLIN	260.561,12	brAAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	07/08/18	15/04/13	15/04/23	RD COLIN	688.625,81	brAAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	07/08/18	15/02/13	15/02/25	CEMIG	1.265.784,38	brA+	A1.br	AA-(bra)
FIM EMB II A	LFSC	14/11/18	14/11/18	15/03/24	BRADESCO	342.255,16	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB II A	LFSC	17/01/19	17/01/19	16/09/24	ITAUBUB	313.793,83	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB I A	LFSC	12/02/19	09/01/19	15/01/25	ITAUBUB	2.494.185,25	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB II A	LFSC	12/02/19	09/01/19	15/01/25	ITAUBUB	2.494.185,25	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	561.872,99	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	3.557.628,52	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	2.025.984,35	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	6.125.226,03	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	701.003,75	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	5.671.757,66	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	8.412.045,07	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	866.695,55	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	614.548,58	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	DE252	30/09/20	28/09/20	22/09/25	BCBF	269.982,65	-	-	AA+(bra)
FIM EMB II A	DE252	08/01/21	22/05/19	15/04/24	ECORODOV	1.381.780,36	-	-	AA(bra)
FIM EMB II A	DE252	20/01/21	26/07/18	15/07/23	AEGEA SA	360.960,70	-	Aa1.br	AA(bra)
FIM EMB II A	DE252	20/01/21	31/07/18	23/07/23	COPEL GT	88.618,32	-	-	AA+(bra)
FIM EMB II A	DE252	04/02/21	26/07/18	15/07/23	AEGEA SA	122.014,88	-	Aa1.br	AA(bra)
FIM EMB II A	DE252	05/02/21	31/07/18	23/07/23	COPEL GT	55.694,84	-	-	AA+(bra)
FIM EMB II A	DE252	05/02/21	26/07/18	15/07/23	AEGEA SA	167.770,47	-	Aa1.br	AA(bra)
FIM EMB II A	DE252	05/02/21	07/08/19	15/07/24	COPEL GT	286.983,76	-	-	AA+(bra)
FI RF EMB II	DEBI	12/02/21	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	5.952.844,16	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB II	DEBI	12/02/21	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	5.966.540,80	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB II	DEBI	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	4.142.366,84	brAAA	-	-
FI RF EMB II	DEBI	12/02/21	17/07/19	15/06/29	NEOENERG	596.997,08	brAAA+	-	-
FI RF EMB II	DEBI	12/02/21	17/07/19	15/06/29	NEOENERG	5.934.448,90	brAAA+	-	-
FI RF EMB II	DEBI	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	1.715.336,17	brAAA+	-	-
FI RF EMB II	DEBI	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	3.287.673,62	brAAA	-	-
FI RF EMB II	DEBI	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	3.517.482,48	brAAA	-	-
FI RF EMB II	DEBI	12/02/21	31/07/20	15/07/34	IGUA SAN	2.585.596,81	brAA	-	-
FI RF EMB II	DE252	12/02/21	23/05/18	15/05/28	COMGAS	23.701.552,59	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	14/05/21	16/07/13	16/07/23	DUKE GEP	6.048.780,71	-	Aaa.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	460.109,45	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	809.792,64	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	920.218,91	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	460.109,45	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	563.173,97	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	473.262,40	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	1.373.101,73	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	LFNS	14/05/21	26/10/16	27/01/25	BRADESCO	13.182.765,02	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	14/05/21	12/12/17	15/11/24	CCR	6.104.363,62	brAAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	14/05/21	14/12/17	15/11/24	ECORODOV	4.068.491,99	brAA	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	14/05/21	19/02/18	15/02/25	SABESP	1.325.633,77	brAAA	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DE252	14/05/21	23/05/18	15/05/28	COMGAS	10.534.023,37	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DEBI	14/05/21	28/06/18	15/06/27	JAGUARA	1.810.869,20	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	DEBI	14/05/21	28/06/18	15/06/27	ENERGMIR	1.126.811,68	-	-	AAA(bra)



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

28/02/2023

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS							INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	Título	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	LFSN	14/05/21	31/07/18	01/08/25	BRADESCO	4.273.026,23	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB I A	LF252	28/05/21	28/05/21	28/11/23	B.ALFA	1.166.845,24	-	Aa1.br	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	28/05/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	173.242,60	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	28/05/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	245.100,00	-	-	D
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	28/05/21	20/11/20	15/10/38	TAUBATE	3.113.852,87	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	28/05/21	22/12/20	15/12/26	IRB	2.544.305,90	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	28/05/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	120.000,00	-	-	D
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	28/05/21	28/04/21	15/03/28	BRISANET	3.222.814,90	brA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	28/05/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	994.278,75	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	28/05/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	56.250,00	-	-	D
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	28/05/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	1.313.953,38	brAAA	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	28/05/21	07/04/21	15/03/31	LOCALIZA	5.043.534,42	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	28/05/21	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	289.960,72	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	28/05/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	1.566.623,29	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	09/06/21	06/01/21	15/11/25	QUATA	1.642.455,65	-	-	A(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	10/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	653.163,91	-	-	A(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	28.166,47	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	436.842,70	-	-	AA
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	760.494,79	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	10/06/21	24/11/20	04/11/25	BCBF	515.196,75	-	-	AA+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	10/06/21	24/11/20	04/11/25	BCBF	515.196,75	-	-	AA+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	453.648,50	-	-	AA-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	922.049,79	-	-	AA-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	908.219,05	-	-	AA-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	1.774.221,66	-	-	AA
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	443.039,05	-	-	AA
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	190.123,70	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	475.812,22	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	10/06/21	24/11/20	04/11/25	BCBF	1.544.530,16	-	-	AA+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	LFSC	14/06/21	19/06/19	19/06/24	BNBBM	582.818,63	brAAA	AAbr	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	LFSC	14/06/21	12/06/19	12/06/24	BNBBM	884.351,62	brAAA	AAbr	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	15/06/21	06/07/20	29/06/24	SBF COME	489.585,43	brA+	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	15/06/21	06/07/20	29/06/24	SBF COME	1.172.246,79	brA+	-	A+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	15/06/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	60.900,00	-	-	D
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	16/06/21	14/07/20	13/07/23	ECORODOV	2.041.545,23	brAAA	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	16/06/21	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	2.019.253,33	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DEBI	17/06/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	731.563,74	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	17/06/21	18/03/21	15/02/26	CORSAN	758.173,93	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	18/06/21	18/06/21	15/12/30	MG050	519.847,30	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	21/06/21	23/09/20	15/04/28	PAMPASUL	1.171.750,89	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	25/06/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	36.750,00	-	-	D
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	25/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	1.425.609,60	-	-	A(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	25/06/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	190.500,00	-	-	D
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	25/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	77.917,93	-	-	A(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	25/06/21	25/06/21	20/06/26	OURO VER	1.458.740,91	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	30/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	2.885.849,39	-	-	A(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	01/07/21	06/12/19	15/10/26	LIGHT	3.154.027,40	BB-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	01/07/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	2.524.156,26	-	-	A(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	02/07/21	01/03/21	18/02/25	RENNER	1.098.810,07	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	02/07/21	01/03/21	18/02/25	RENNER	232.382,81	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	07/07/21	07/04/21	15/03/29	CAGECE	1.179.957,25	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	08/07/21	08/07/21	15/06/31	VAMOS	244.768,95	brAAA	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	08/07/21	07/04/21	15/03/29	CAGECE	2.689.179,80	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	08/07/21	08/07/21	15/06/31	VAMOS	4.856.526,84	brAAA	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	LFSN	12/07/21	12/07/21	12/07/26	BRADESCO	3.724.752,36	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	1.998.444,94	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	215.756,12	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	970.673,26	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	219.300,00	-	-	D
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	504.750,09	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	193.500,00	-	-	D
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	283.800,00	-	-	D
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	141.900,00	-	-	D
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	1.815.327,39	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	283.777,76	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	3.996.889,88	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	15/07/21	06/06/18	10/05/24	MULTIPLA	3.158.844,72	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	389.239,38	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	389.239,38	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	1.387.723,01	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	15/07/21	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	2.321.953,26	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	15/07/21	28/06/18	15/05/23	ELEKTRO	565.042,00	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	15/07/21	19/09/18	15/09/23	SONAE	1.595.303,57	-	-	AAA(bra)



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

28/02/2023

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS							INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	Título	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	16/07/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	2.696.625,23	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DEBI	19/07/21	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	613.284,51	brAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	19/07/21	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	1.850.915,91	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	19/07/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	242.700,00	-	-	D
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	21/07/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	1.920.877,63	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	21/07/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	703.870,60	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	DE252	21/07/21	11/06/18	15/05/25	INTERVIA	1.309.748,31	-	Aa2.br	-
FIM EMB I A	DE252	21/07/21	17/03/21	05/03/24	ENERG TR	1.357.329,07	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	DE252	21/07/21	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.116.214,72	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	DE252	21/07/21	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	1.020.732,56	-	-	AA-(bra)
FIM EMB I A	DE252	21/07/21	20/09/19	20/08/26	VAMOS	1.017.300,87	brAAA	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	23/07/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.559.541,89	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	29/07/21	07/11/19	15/10/24	BKBR	1.447.643,98	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	29/07/21	23/12/20	15/12/26	RD COLIN	2.124.855,19	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	30/07/21	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	1.026.944,21	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DEBI	04/08/21	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	1.015.534,86	brAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DEBI	06/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	1.127.646,56	brAA	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	11/08/21	11/08/21	15/08/31	CSAN	988.000,30	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	11/08/21	19/11/19	15/06/27	AUTOPIST	1.285.414,08	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DEBI	17/08/21	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	3.114.661,37	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DEBI	18/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	1.143.580,70	brAA	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	18/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	887.408,82	brAA	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	27/08/21	27/08/21	20/08/31	S LUIZ A	981.541,52	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	06/09/21	06/09/21	15/08/31	COMGAS	2.572.178,70	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	08/09/21	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	506.223,09	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	DE252	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	657.651,01	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	DE252	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	58.894,12	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	DE252	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	294.470,60	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	DE252	16/09/21	17/06/19	15/06/24	PROLAGOS	2.255.003,36	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	DE252	16/09/21	12/05/21	15/04/26	ELETROB	2.036.295,16	brAAA	-	-
FIM EMB I A	DE252	16/09/21	22/10/19	21/10/26	AUTOBAN	735.088,60	-	-	-
FIM EMB I A	DE252	17/09/21	04/10/18	01/10/24	EQUATENE	1.470.796,55	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	17/09/21	28/04/21	15/03/28	BRISANET	1.435.961,08	brA+	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	20/09/21	20/09/21	20/09/29	MOV_PART	1.079.188,32	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	20/09/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.039.694,59	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	20/09/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.039.694,59	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	20/09/21	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	1.050.778,97	brAAA	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	22/09/21	06/08/19	15/07/39	EDPM	1.875.374,94	brAAA	-	AA+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	751.884,95	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	751.884,95	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	249.950,94	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	249.950,94	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	761.323,89	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	761.323,89	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	978.307,47	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	380.034,82	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	380.034,82	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	23/09/21	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	4.021.652,67	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	23/09/21	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	4.075.655,10	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	24/09/21	05/04/21	15/03/24	CCPR	42.622,10	-	A.br	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	24/09/21	31/05/21	20/05/25	CEA MODA	1.667.473,91	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	LF252	24/09/21	09/09/21	11/09/23	PANAMERI	1.196.881,04	brAAA	AAAbr	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	27/09/21	28/12/20	15/01/26	LOCAMERI	1.831.742,31	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	27/09/21	17/03/21	05/03/24	ENERG TR	2.125.122,01	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	LF252	27/09/21	29/03/21	01/04/24	CNH	2.223.613,11	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	30/09/21	30/09/21	15/09/31	SIMPAR	830.693,73	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DEBI	04/10/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	605.497,18	brAA	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	08/10/21	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	5.008.534,80	-	-	AA-(bra)
FIM EMB I A	LF252	20/10/21	20/10/21	20/10/25	DAYCOVAL	2.462.193,67	brAAA	AA.br	AA(bra)
FIM EMB I A	LF252	20/10/21	20/10/21	20/10/24	DAYCOVAL	1.371.139,24	brAAA	AA.br	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	22/10/21	22/10/21	15/12/35	CART	2.514.265,91	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DEBI	22/10/21	22/10/21	15/12/35	CART	774.393,90	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	25/10/21	22/04/21	15/03/26	VIX LOGI	1.054.520,69	-	-	A+(bra)
FIM EMB I A	DE252	27/10/21	27/10/21	15/10/29	CONT GLO	2.183.268,65	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DEBI	28/10/21	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	790.433,13	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	28/10/21	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	1.145.342,84	brAAA	-	-
FIM EMB I A	LFV	28/10/21	28/10/21	07/11/23	TOYOTA	2.598.392,88	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DEBI	04/11/21	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	3.038.608,25	brAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	10/11/21	10/11/21	15/10/28	LIGHT	422.638,31	BB-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	12/11/21	12/11/21	15/10/31	VAMOS	2.052.721,40	brAAA	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	18/11/21	18/11/21	15/10/31	HIDRO BR	3.985.109,51	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	22/11/21	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	1.643.036,16	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	26/11/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	2.167.327,32	-	-	AA(bra)



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

28/02/2023

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS							INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	Título	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	30/11/21	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	2.137.264,96	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	30/11/21	28/04/21	15/03/28	BRISANET	818.389,85	brA+	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	LFSC	03/12/21	11/06/19	11/06/24	BNBBM	583.730,44	brAAA	AAbr	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	06/12/21	06/12/21	15/12/35	TESC	2.493.799,64	-	-	A+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	09/12/21	06/01/21	15/11/25	QUATA	2.405.191,47	-	-	A(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	09/12/21	06/08/19	15/07/39	EDPM	3.263.863,34	brAA+	-	AA+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DEBI	20/12/21	20/12/21	15/11/35	ORIZON	2.015.065,15	brAA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	06/01/22	01/10/21	15/09/41	TUCANOHO	51.981,97	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	06/01/22	01/10/21	15/09/41	TUCANOHO	308.772,90	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	10/01/22	22/04/21	15/03/26	VIX LOGI	1.035.132,16	-	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DEBI	13/01/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.241.878,62	brAA	-	-
FIM EMB I A	LF252	19/01/22	19/01/22	19/01/24	BES INV	1.166.361,00	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	25/01/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	318.659,49	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	25/01/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	1.914.402,41	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	10/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	321.826,04	brAA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	10/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	311.768,97	brAA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	10/02/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	3.813.836,75	-	-	AA+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DEBI	10/02/22	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	2.093.862,59	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	14/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	744.222,71	brAA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	14/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	663.766,20	brAA+	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DEBI	25/03/22	25/03/22	15/03/44	GBS PART	1.992.991,90	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	25/03/22	25/03/22	15/03/44	GBS PART	3.394.390,10	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	28/03/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	980.769,58	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	12/04/22	12/04/22	08/04/27	UNIGEL P	857.164,70	brAA+	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	19/04/22	19/04/22	16/04/29	VERT-10	1.189.092,65	-	-	AAAsf(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	26/04/22	26/04/22	15/04/24	LIGHT	1.200.456,70	BB-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	06/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	2.572.012,57	brAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	06/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.268.895,56	brAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	12/05/22	12/05/22	15/04/27	BRKA	1.972.975,27	-	A+.br	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	12/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.521.053,65	brAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	12/05/22	01/10/21	15/09/41	TUCANOHO	1.723.722,12	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	19/05/22	19/05/22	13/05/28	CEA MODA	518.723,84	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	26/05/22	26/05/22	10/05/27	GUAR	2.435.167,03	-	-	A+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	30/05/22	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	2.280.216,36	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	30/05/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	537.462,90	-	-	AA+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	30/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.169.833,45	brAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	03/03/22	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	2.669.549,05	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	04/03/22	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	2.512.585,59	brAAA	A2.br	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	04/03/22	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	1.035.555,88	brAAA	A2.br	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	07/03/22	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	3.045.133,86	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	07/03/22	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	2.437.412,01	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	07/06/22	06/12/21	15/12/35	TESC	776.109,74	-	-	A+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	07/06/22	28/04/21	15/03/28	BRISANET	488.010,83	brA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	10/06/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	429.970,32	-	-	AA+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	10/06/22	06/12/21	15/12/35	TESC	486.803,36	-	-	A+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	10/06/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	250.409,25	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	13/06/22	30/09/21	15/09/31	SIMPAR	1.788.177,55	brAA+	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	13/06/22	08/07/21	15/06/31	VAMOS	833.380,01	brAA+	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	13/06/22	08/07/21	15/06/31	VAMOS	67.991,38	brAA+	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	13/06/22	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	849.096,03	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	13/06/22	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	960.154,96	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	20/06/22	23/09/20	15/04/28	PAMPASUL	2.588.079,76	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	21/06/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	1.163.107,14	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	LF252	27/06/22	27/06/22	07/07/24	LAGE	2.196.312,40	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	14/07/22	18/10/21	15/09/46	ENGIE	46.345,68	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	14/07/22	18/10/21	15/09/46	ENGIE	2.723.272,32	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	19/07/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	2.852.002,44	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	19/07/22	12/11/21	15/10/31	VAMOS	1.984.981,60	brAA+	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	19/07/22	12/11/21	15/10/31	VAMOS	1.488.223,02	brAA+	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	25/07/22	25/07/22	22/07/27	CM HOSPI	1.627.912,91	-	AA.br	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	26/07/22	10/01/22	10/01/28	AMBIPAR	2.329.349,19	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	26/07/22	03/05/21	26/04/26	GGSH PAR	2.412.245,90	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	27/07/22	25/03/22	15/03/44	GBS PART	2.724.240,51	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	28/07/22	28/07/22	18/07/25	1V11	1.628.081,83	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	29/07/22	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	1.472.509,23	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	29/07/22	29/10/21	15/10/31	ENERGISA	1.783.977,43	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	29/07/22	19/10/21	15/10/36	UHESIMAO	1.537.646,42	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	08/08/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	1.169,84	-	-	A(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	09/08/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	493.711,33	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	09/08/22	07/04/21	15/03/29	CAGECE	1.458.483,30	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	09/08/22	07/04/21	15/03/29	CAGECE	2.430.085,80	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	09/08/22	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	1.579.077,74	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	09/08/22	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	774.436,75	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	23/08/22	23/08/22	15/08/32	PETRJ	5.462.135,99	brAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	30/08/22	30/08/22	15/08/29	TRBR	8.676.692,90	brA+	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	02/09/22	02/09/22	02/09/29	AEGERA SA	1.789.387,72	brAA+	-	-



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

28/02/2023

Fundo	INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
	Título	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	27/09/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	50.303,13	-	-	A(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	LFSC	28/09/22	28/09/22	28/09/27	B.BRASIL	4.497.089,39	-	AAA.br	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	06/10/22	06/10/22	13/09/32	NTRASSUD	1.766.983,08	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	14/10/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	35.095,21	-	-	A(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	03/11/22	06/04/21	15/03/29	ANET	2.296.946,24	brA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	03/11/22	15/12/21	15/11/36	ITAPOA T	4.231.309,86	-	AA.br	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	08/11/22	08/11/22	27/10/27	CM HOSPI	1.037.166,57	-	AA.br	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	08/11/22	08/11/22	15/06/42	BRK AMBI	4.279.831,65	-	AA-.br	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	09/11/22	02/05/22	15/04/38	RDVE	1.467.070,66	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	09/11/22	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	1.434.343,04	brAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	DEBI	11/11/22	11/11/22	15/10/40	RAHOLD	2.622.807,09	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	11/11/22	11/11/22	15/10/40	RAHOLD	9.726.370,77	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	3.631.521,14	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	1.634.733,08	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	1.338.506,28	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.290.965,17	-	Aa3.br	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.571.478,63	-	Aa3.br	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.286.943,47	-	Aa3.br	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	01/12/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	1.552.976,69	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	2.036.943,50	brAAA+	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	2.160.876,10	brAAA+	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DE252	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	1.576.168,45	brAAA+	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	05/12/22	16/11/20	15/10/36	PAMPASUL	2.278.009,87	brAAA	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	13/12/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	2.967.870,14	-	-	AA+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	20/12/22	20/12/22	16/12/29	CSMG	2.040.673,24	-	-	AA+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	26/12/22	15/12/21	15/11/36	ITAPOA T	2.876.127,46	-	AA.br	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	26/12/22	02/05/22	15/04/38	RDVE	1.697.767,27	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	DEBI	26/12/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	2.918.146,45	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	DE252	26/01/23	26/01/23	20/01/26	CELG	3.105.918,61	-	-	AA+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	FIDC	-	-	-	FIDC VERDECARD SN3	2.493.627,88	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	FIDC	-	-	-	FIDC CREDZ SN4	9.251,30	-	-	AAAsf(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	FIDC	-	-	-	FIDC CREDZ SN6	2.513.281,02	brAA (sf)	-	A+sf(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	FIDC	-	-	-	FIDC VERDECARD SN5	471.842,20	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	FIDC	-	-	-	FIDC VERDECARD SN6	1.416.049,34	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	FIDC	-	-	-	FIDC VERDECARD SN8	1.516.579,48	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	FIDC	-	-	-	RB CAP CREDIT AL SN3	755.395,16	brAA-(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	FIDC	-	-	-	BR ELETRO FIDC S1	3.469.945,15	-	-	Aasf(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	FIDC	-	-	-	INSS CONS PDL I FIDC	1.861.136,08	-	-	AAAsf(bra)

Observação: Em fevereiro de 2023, dois ativos da carteira de crédito da EMBRAER PREV sofreram rebaixamentos de suas classificações de risco: o rating de LIGHB4 e LIGHD3 (Light SESA) foi revisado pela S&P de A- para S&P BB-, portanto, abaixo da classificação mínima de crédito estabelecida pela Política de Investimentos do Plano Embraer Prev, e o rating de DASAA2 (Dasa) foi revisado pela Fitch de AAA para Fitch AA, mantendo-se acima dessa classificação mínima de crédito. Os gestores dos fundos de investimento em que estão alocados esses ativos acompanham atentamente a evolução dessas classificações, sob o monitoramento do administrador desses fundos e da Entidade, visando ao seu enquadramento aos limites estabelecidos na Política de Investimento. O ativo SNGO18 (Saneago) teve o rating elevado pela Fitch de A+ para Fitch AA-.



4. RISCO OPERACIONAL

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

5. RISCO DE LIQUIDEZ

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

6. RISCO LEGAL

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

6.1. Relatório de Enquadramentos Legais



Relatório Resumo de Enquadramento

Patrimônio Líquido da Fundação **4.222.646.669,02**

Tópico do Enquadramento	Limite	Aplicação Atual	Valor Limite	% Aplicado	Status
% do Segmento RF/PL PLANO	100,00%	3.607.299.423,02	4.222.646.669,02	85,43%	Enquadrado
% do PL em Títulos de Emissão do Tesouro Nacional e/ou do BACEN	100,00%	2.931.135.139,37	4.222.646.669,02	69,41%	Enquadrado
% do PL em Títulos RF1, exceto títulos do Tesouro Nacional	80,00%	676.164.283,65	3.378.117.385,55	16,01%	Enquadrado
% do PL em FIDC	20,00%	Verificar Rel. de Diversificação de FIDC's	844.529.346,39	0,00%	Enquadrado
% do PL em uma mesma pessoa jurídica não-financeira	10,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Não Financ.	422.264.673,19	0,00%	Enquadrado
% do PL em Instituições Financeiras	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Financ.	1.055.661.667,26	0,00%	Enquadrado
% de uma mesma Série de Debêntures	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Debêntures	1.055.661.667,26	0,00%	Enquadrado
% do PL em RV	70,00%	489.287.082,96	2.955.852.617,98	11,59%	Enquadrado
% do capital votante de uma empresa	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação RV	1.055.661.667,26	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Imobiliários	20,00%	91.612.487,30	844.529.346,39	2,17%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Empréstimos	15,00%	26.765.767,86	633.397.025,52	0,63%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Estruturados	20,00%	0,00	844.529.346,39	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos no Exterior	10,00%	0,00	422.264.673,19	0,00%	Enquadrado

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

6.2. Relatório de Túnel de Preços

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE FEVEREIRO DE 2023 À 28 DE FEVEREIRO DE 2023



								DADOS BM&FBOVESPA			
DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA	
01-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	13,57	20.400,00	276.828,00	13,14	13,53	13,85	13.890,00	
01-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	ALSO3	17,98	1.900,00	34.152,92	17,74	17,95	18,10	10.447,00	
01-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	ALSO3	17,95	1.900,00	34.105,00	17,74	17,95	18,10	10.447,00	
01-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	ALSO3	17,93	2.200,00	39.448,47	17,74	17,95	18,10	10.447,00	
01-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	15,38	6.900,00	106.111,36	15,24	15,37	15,57	13.128,00	
01-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	40,22	500,00	20.109,33	39,85	40,40	41,05	39.614,00	
01-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	21,25	2.300,00	48.871,42	20,65	21,15	21,84	35.864,00	
01-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	39,88	1.100,00	43.863,34	39,08	39,73	40,96	41.300,00	
01-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,25	5.100,00	62.460,90	11,93	12,17	12,38	24.568,00	
01-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	28,03	2.900,00	81.273,35	27,77	28,04	28,35	24.268,00	
01-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	EUCA4	10,90	300,00	3.270,00	10,50	10,71	10,90	622,00	
01-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	5,04	4.500,00	22.690,42	4,93	5,09	5,24	53.324,00	
01-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	19,42	2.500,00	48.555,34	19,19	19,42	19,87	22.748,00	
01-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	19,50	2.600,00	50.694,42	19,19	19,42	19,87	22.748,00	
01-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	24,96	2.100,00	52.406,68	24,78	25,01	25,50	51.648,00	
01-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	LREN3	21,58	1.700,00	36.687,59	21,13	21,54	22,23	30.191,00	
01-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	LWSA3	6,32	1.800,00	11.384,00	6,21	6,31	6,50	11.106,00	
01-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	NINJ3	3,03	200,00	606,81	2,90	2,99	3,09	878,00	
01-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	14,05	1.300,00	18.261,70	13,85	14,16	14,88	31.522,00	
01-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	7,24	18.500,00	134.012,17	7,12	7,23	7,38	19.536,00	
01-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	7,28	18.400,00	133.966,28	7,12	7,23	7,38	19.536,00	
01-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	7,24	2.600,00	18.820,97	7,12	7,23	7,38	19.536,00	
01-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRIO3	41,53	1.900,00	78.908,38	40,55	41,18	42,39	29.443,00	
01-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIZ4	3,15	300.400,00	946.251,76	3,06	3,15	3,34	35.175,00	
01-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	31,92	6.600,00	210.678,08	31,23	31,93	32,59	23.247,00	
01-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	30,28	800,00	24.222,42	29,42	30,22	31,71	14.568,00	
01-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	58,60	2.900,00	169.944,18	57,92	58,73	60,27	33.904,00	
01-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	10,57	2.900,00	30.643,59	10,30	10,51	10,74	15.209,00	
01-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	46,79	1.600,00	74.868,68	46,02	46,56	47,14	19.448,00	
01-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	15,98	7.100,00	113.439,34	15,79	16,00	16,54	19.858,00	
01-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	10,36	1.800,00	18.655,01	10,14	10,33	10,63	15.432,00	
02-02-23	FIA RVA EMB II	Compra	ABEV3	13,24	33.600,00	444.970,00	13,00	13,20	13,53	42.760,00	
02-02-23	FIA RVA EMB II	Compra	B3SA3	13,12	56.500,00	741.475,00	12,74	13,09	13,29	47.106,00	



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO
E CONTROLE DE RISCO - FEVEREIRO DE 2023



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE FEVEREIRO DE 2023 À 28 DE FEVEREIRO DE 2023

DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
02-02-23	FIA RVA EMB II	Compra	BBSE3	36,74	25.400,00	933.257,66	36,19	36,64	37,20	23.580,00
02-02-23	FIA RVA EMB II	Compra	EQTL3	27,98	16.900,00	472.840,26	27,68	28,12	28,41	25.606,00
02-02-23	FIA RVA EMB II	Venda	SUZB3	45,30	27.900,00	1.263.786,54	44,71	45,26	46,75	31.791,00
02-02-23	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	89,70	5.500,00	493.366,00	88,86	89,97	91,96	96.840,00
02-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	13,54	8.300,00	112.361,20	13,38	13,69	14,24	15.705,00
02-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	13,75	100,00	1.374,82	13,38	13,69	14,24	15.705,00
02-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	13,56	5.300,00	71.879,84	13,38	13,69	14,24	15.705,00
02-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,20	3.100,00	47.122,00	15,13	15,33	15,57	8.309,00
02-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	39,54	400,00	15.815,00	39,25	39,98	41,15	47.081,00
02-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	20,62	2.100,00	43.292,00	20,51	20,99	21,86	30.210,00
02-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	39,15	1.000,00	39.151,00	38,83	39,47	40,75	38.471,00
02-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	11,99	3.600,00	43.158,00	11,91	12,15	12,57	22.397,00
02-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	28,18	2.700,00	76.097,00	27,68	28,12	28,41	25.606,00
02-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	EUCA4	10,74	700,00	7.516,68	10,55	10,73	10,89	189,00
02-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	5,12	2.200,00	11.256,00	5,01	5,12	5,22	44.411,00
02-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	19,25	3.500,00	67.370,05	19,03	19,37	19,84	16.028,00
02-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	19,43	1.400,00	27.196,13	19,03	19,37	19,84	16.028,00
02-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	25,26	1.900,00	47.991,00	24,70	25,32	25,97	73.456,00
02-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	21,93	1.600,00	35.081,00	21,43	21,99	22,43	39.980,00
02-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	NINJ3	3,01	1.500,00	4.518,00	2,96	3,03	3,16	641,00
02-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	7,59	14.000,00	106.324,06	7,23	7,58	7,86	26.776,00
02-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	7,57	3.300,00	24.994,00	7,23	7,58	7,86	26.776,00
02-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	39,99	300,00	11.997,00	39,56	40,33	41,76	24.668,00
02-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	RAI24	3,07	3.500,00	10.738,00	3,04	3,12	3,23	25.932,00
02-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	RDOR3	30,87	900,00	27.783,00	30,41	31,57	32,46	24.689,00
02-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	29,17	700,00	20.421,00	28,86	29,65	30,84	14.933,00
02-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	60,39	3.100,00	187.198,45	58,10	60,04	60,89	38.354,00
02-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	60,10	900,00	54.093,00	58,10	60,04	60,89	38.354,00
02-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	10,78	2.600,00	28.028,00	10,56	10,87	11,10	21.013,00
02-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	44,96	1.500,00	67.434,00	44,71	45,26	46,75	31.791,00
02-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	16,13	5.900,00	95.147,25	15,84	16,19	16,45	18.142,00
02-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	16,21	2.400,00	38.904,00	15,84	16,19	16,45	18.142,00
02-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	10,39	1.700,00	17.658,00	10,22	10,48	10,60	12.564,00
02-02-23	FIA RVA EMB IV	Compra	B3SA3	13,09	28.400,00	371.704,00	12,74	13,09	13,29	47.106,00
02-02-23	FIA RVA EMB IV	Venda	BPAC11	20,61	5.194,00	107.064,30	20,51	20,99	21,86	30.210,00
02-02-23	FIA RVA EMB IV	Venda	BPAC11	21,00	2.397,00	50.327,57	20,51	20,99	21,86	30.210,00
02-02-23	FIA RVA EMB IV	Venda	BPAC11	21,71	4.794,00	104.053,87	20,51	20,99	21,86	30.210,00
02-02-23	FIA RVA EMB IV	Venda	BPAC11	20,64	9.588,00	197.909,54	20,51	20,99	21,86	30.210,00
02-02-23	FIA RVA EMB IV	Venda	BPAC11	20,56	1.283,00	26.381,38	20,51	20,99	21,86	30.210,00
02-02-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GGPS3	12,52	36.600,00	458.157,00	12,35	12,50	12,84	5.667,00
02-02-23	FIA RVA EMB IV	Venda	ITUB4	25,36	51.564,00	1.307.487,52	24,70	25,32	25,97	73.456,00
02-02-23	FIA RVA EMB IV	Venda	ITUB4	25,19	21.239,00	535.010,41	24,70	25,32	25,97	73.456,00
02-02-23	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	23,79	13.400,00	318.809,00	23,38	23,78	24,42	15.684,00
02-02-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	60,23	12.379,00	745.556,09	58,10	60,04	60,89	38.354,00
02-02-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	60,03	248,00	14.888,38	58,10	60,04	60,89	38.354,00
02-02-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	60,12	6.868,00	412.877,14	58,10	60,04	60,89	38.354,00
02-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	12,72	5.800,00	73.798,87	12,61	12,93	13,46	13.783,00
03-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	13,23	9.400,00	124.341,14	12,61	12,93	13,46	13.783,00
03-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	13,13	2.100,00	27.563,50	12,61	12,93	13,46	13.783,00
03-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,18	2.400,00	36.441,48	15,07	15,27	15,54	9.681,00
03-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,35	3.900,00	59.865,00	15,07	15,27	15,54	9.681,00
03-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	20,12	2.200,00	44.264,45	20,05	20,36	20,74	32.086,00
03-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	20,08	1.800,00	36.144,00	20,05	20,36	20,74	32.086,00
03-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	38,54	3.000,00	115.634,50	37,97	38,39	39,05	28.093,00
03-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	11,97	6.400,00	76.625,65	11,68	11,88	12,07	27.070,00
03-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	11,93	3.100,00	36.980,24	11,68	11,88	12,07	27.070,00
03-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	27,51	4.000,00	110.039,85	27,08	27,32	27,88	28.973,00
03-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	8,24	20.800,00	171.392,00	8,19	8,26	8,33	49.937,00
03-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	8,26	31.300,00	258.523,23	8,19	8,26	8,33	49.937,00
03-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	25,14	3.100,00	77.947,69	24,83	25,15	25,36	47.367,00
03-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	25,18	10.400,00	261.872,00	24,83	25,15	25,36	47.367,00
03-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	25,18	6.900,00	173.742,00	24,83	25,15	25,36	47.367,00
03-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	LREN3	20,27	8.800,00	178.364,26	20,08	20,48	21,32	55.152,00
03-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	7,23	5.500,00	39.753,25	7,06	7,21	7,59	19.844,00
03-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	39,95	500,00	19.973,66	39,65	40,48	41,41	25.624,00
03-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	40,01	500,00	20.002,50	39,65	40,48	41,41	25.624,00
03-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	28,66	800,00	22.929,40	28,29	28,84	29,52	14.971,00
03-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	28,59	800,00	22.868,26	28,29	28,84	29,52	14.971,00
06-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	12,46	3.700,00	46.111,69	12,25	12,43	12,75	14.812,00
06-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	12,41	2.000,00	24.821,42	12,25	12,43	12,75	14.812,00
06-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,13	6.100,00	92.289,71	15,01	15,14	15,27	14.316,00
06-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	19,85	100,00	1.985,03	19,65	19,94	20,39	35.749,00
06-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	19,85	7.800,00	154.825,11	19,65	19,94	20,39	35.749,00
06-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	38,02	5.100,00	193.923,54	37,66	38,05	38,29	25.949,00
06-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	11,72	8.700,00	101.951,27	11,53	11,70	11,87	15.662,00
06-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENJL3	0,98	1.700,00	1.673,00	0,97	0,98	1,02	878,00
06-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	26,82	6.900,00	185.048,59	26,56	26,84	27,31	22.397,00
06-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	18,68	2.500,00	46.708,82	18,20	18,71	19,12	17.045,00
06-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	LREN3	20,13	2.900,00	58.374,23	19,77	20,03	20,51	34.139,00
06-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	40,58	2.300,00	93.335,85	40,12	40,76	41,39	26.216,00
06-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	28,35	2.500,00	70.874,75	28,08	28,81	29,44	16.095,00
06-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	28,71	1.100,00	31.579,93	28,08	28,81	29,44	16.095,00
06-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	9,64	6.100,00	58.812,43	9,53	9,71	10,14	20.149,00
06-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	16,13	4.600,00	74.213,28	15,63	16,11	16,46	36.113,00
06-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	8,71	8.100,00	70.536,74	8,61	8,89	9,25	26.956,00



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO
E CONTROLE DE RISCO - FEVEREIRO DE 2023



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE FEVEREIRO DE 2023 À 28 DE FEVEREIRO DE 2023

DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
06-02-23	FIA RVA EMB IV	Venda	BPAC11	19,84	12.803,00	254.009,36	19,65	19,94	20,39	35.749,00
06-02-23	FIA RVA EMB IV	Venda	BPAC11	20,05	1.631,00	32.701,55	19,65	19,94	20,39	35.749,00
06-02-23	FIA RVA EMB IV	Venda	BPAC11	19,85	1.631,00	32.367,35	19,65	19,94	20,39	35.749,00
06-02-23	FIA RVA EMB IV	Venda	BPAC11	19,97	1.305,00	26.063,68	19,65	19,94	20,39	35.749,00
06-02-23	FIA RVA EMB IV	Venda	BPAC11	20,23	326,00	6.593,50	19,65	19,94	20,39	35.749,00
06-02-23	FIA RVA EMB IV	Venda	ITUB4	24,90	2.465,00	61.387,97	24,72	24,97	25,24	51.070,00
06-02-23	FIA RVA EMB IV	Venda	ITUB4	24,82	2.465,00	61.192,72	24,72	24,97	25,24	51.070,00
06-02-23	FIA RVA EMB IV	Venda	ITUB4	24,92	2.465,00	61.430,41	24,72	24,97	25,24	51.070,00
06-02-23	FIA RVA EMB IV	Venda	ITUB4	25,02	9.368,00	234.384,90	24,72	24,97	25,24	51.070,00
06-02-23	FIA RVA EMB IV	Compra	PRIO3	41,00	10.900,00	446.920,00	40,12	40,76	41,39	26.216,00
06-02-23	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	12,63	10.120,00	127.815,60	12,29	12,70	12,90	18.454,00
06-02-23	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	12,86	1.265,00	16.267,90	12,29	12,70	12,90	18.454,00
06-02-23	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	12,59	6.325,00	79.635,76	12,29	12,70	12,90	18.454,00
06-02-23	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	12,78	10.550,00	134.871,05	12,29	12,70	12,90	18.454,00
06-02-23	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	12,50	2.074,00	25.925,00	12,29	12,70	12,90	18.454,00
06-02-23	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	16,00	4.333,00	69.323,70	15,63	16,11	16,46	36.113,00
06-02-23	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	16,19	2.013,00	32.597,62	15,63	16,11	16,46	36.113,00
06-02-23	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	16,12	3.355,00	54.089,27	15,63	16,11	16,46	36.113,00
06-02-23	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	16,07	2.097,00	33.690,91	15,63	16,11	16,46	36.113,00
07-02-23	FIA RVA EMB II	Compra	ABEV3	12,98	60.600,00	786.327,84	12,89	12,97	13,08	23.746,00
07-02-23	FIA RVA EMB II	Venda	BPAC11	20,05	37.000,00	742.004,50	19,82	20,04	20,25	27.743,00
07-02-23	FIA RVA EMB II	Venda	ELET3	37,59	26.200,00	984.822,75	36,63	37,24	38,32	42.740,00
07-02-23	FIA RVA EMB II	Compra	NTCO3	13,99	29.500,00	412.821,24	13,74	13,95	14,34	24.484,00
07-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	14,83	2.200,00	32.615,15	14,67	14,87	15,35	9.582,00
07-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	38,92	1.400,00	54.484,10	38,46	38,90	39,68	37.536,00
07-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	38,82	300,00	11.646,60	38,46	38,90	39,68	37.536,00
07-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	20,86	700,00	14.045,00	19,82	20,04	20,25	27.743,00
07-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	19,96	3.900,00	77.861,07	19,82	20,04	20,25	27.743,00
07-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	36,98	700,00	25.884,05	36,63	37,24	38,32	42.740,00
07-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	36,76	1.400,00	51.457,46	36,63	37,24	38,32	42.740,00
07-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	11,64	5.900,00	68.677,01	11,59	11,63	11,80	11.879,00
07-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENJU3	0,94	2.000,00	1.880,00	0,92	0,94	1,01	955,00
07-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENJU3	0,94	500,00	470,00	0,92	0,94	1,01	955,00
07-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	26,49	1.900,00	50.336,10	26,19	26,46	26,93	24.196,00
07-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	18,81	7.300,00	137.310,20	18,65	18,85	19,15	11.679,00
07-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	24,51	1.000,00	24.508,86	24,26	24,58	25,28	58.062,00
07-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	LTRE3	19,83	1.800,00	35.700,84	19,66	19,88	20,35	33.484,00
07-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	13,90	1.100,00	15.285,48	13,74	13,95	14,34	24.484,00
07-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	6,90	2.300,00	15.873,80	6,77	6,95	7,16	15.993,00
07-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	29,01	400,00	11.602,00	28,50	28,92	29,52	10.828,00
07-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	29,55	2.100,00	62.051,28	29,03	29,52	29,85	8.524,00
07-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	57,49	700,00	40.242,87	57,14	57,53	58,21	33.202,00
07-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	9,54	4.800,00	45.807,04	9,46	9,56	9,79	21.240,00
07-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	45,99	1.000,00	45.986,89	45,52	46,11	46,73	16.731,00
07-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	15,98	1.700,00	27.163,88	15,81	16,01	16,37	15.414,00
07-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	8,85	4.300,00	38.063,89	8,73	8,90	9,21	15.714,00
07-02-23	FIA RVA EMB IV	Venda	BPAC11	19,93	22.400,00	446.440,00	19,82	20,04	20,25	27.743,00
08-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	20,92	9.500,00	198.720,41	20,11	20,84	21,23	37.559,00
08-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	36,98	1.500,00	55.472,95	36,56	37,00	37,29	45.798,00
08-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	EUCA4	10,84	400,00	4.337,37	10,55	10,82	11,00	210,00
08-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,45	300,00	1.335,77	4,19	4,39	4,72	64.306,00
08-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,47	40.600,00	181.531,82	4,19	4,39	4,72	64.306,00
08-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	26,30	14.800,00	389.175,70	25,32	26,04	26,61	123.394,00
08-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	PETZ3	6,82	8.200,00	55.940,13	6,59	6,80	7,01	15.881,00
08-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRIO3	41,90	2.100,00	87.998,28	41,44	42,06	42,57	21.814,00
08-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	RDOR3	28,37	2.000,00	56.743,23	27,59	28,28	29,14	20.500,00
08-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	29,56	3.000,00	88.681,43	29,16	29,67	30,07	14.096,00
08-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	8,87	2.100,00	18.617,04	8,59	8,76	8,98	10.190,00
08-02-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ALSO3	17,88	24.900,00	445.260,00	17,53	17,82	18,01	12.228,00
08-02-23	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	23,78	1.322,00	31.437,16	22,98	23,58	23,95	24.188,00
08-02-23	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	23,76	668,00	15.870,18	22,98	23,58	23,95	24.188,00
08-02-23	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	23,82	6.610,00	157.453,68	22,98	23,58	23,95	24.188,00
08-02-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	58,23	3.118,00	181.552,85	57,21	58,09	58,68	27.518,00
08-02-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	58,55	385,00	22.541,75	57,21	58,09	58,68	27.518,00
08-02-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	58,48	2.160,00	126.327,48	57,21	58,09	58,68	27.518,00
08-02-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	58,00	1.156,00	67.048,00	57,21	58,09	58,68	27.518,00
09-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	14,89	1.000,00	14.890,00	14,75	14,85	15,05	6.796,00
09-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	36,49	2.500,00	91.235,94	36,29	36,56	37,42	35.943,00
09-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	11,44	6.500,00	74.350,80	11,32	11,46	11,76	14.150,00
09-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	26,25	8.500,00	223.091,98	26,04	26,30	26,96	20.928,00
09-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	18,49	800,00	14.794,16	18,32	18,69	19,40	14.053,00
09-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	LTRE3	19,46	5.300,00	103.128,74	19,13	19,49	20,31	39.445,00
09-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	LTRE3	19,97	6.600,00	131.780,05	19,13	19,49	20,31	39.445,00
09-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	LTRE3	19,40	2.800,00	54.320,00	19,13	19,49	20,31	39.445,00
09-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	PETZ3	6,57	5.600,00	36.800,41	6,48	6,62	7,05	15.354,00
09-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	9,07	14.200,00	128.761,77	8,71	8,92	9,67	24.198,00
09-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	9,28	11.600,00	107.663,46	8,71	8,92	9,67	24.198,00
09-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	9,01	6.200,00	55.863,53	8,71	8,92	9,67	24.198,00
09-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	15,83	4.400,00	69.652,00	15,57	15,76	16,43	34.258,00
09-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	15,76	13.300,00	209.561,52	15,57	15,76	16,43	34.258,00
09-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	15,73	6.800,00	106.964,50	15,57	15,76	16,43	34.258,00
09-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	15,97	1.500,00	23.955,00	15,57	15,76	16,43	34.258,00
09-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	8,43	6.600,00	55.636,03	8,29	8,52	9,00	11.808,00
10-02-23	FIA RVA EMB II	Compra	BBSE3	35,91	7.500,00	269.325,00	35,42	35,93	36,14	31.450,00
10-02-23	FIA RVA EMB II	Venda	CPFE3	30,86	25.700,00	793.162,85	29,75	30,82	31,13	7.909,00



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO
E CONTROLE DE RISCO - FEVEREIRO DE 2023



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE FEVEREIRO DE 2023 À 28 DE FEVEREIRO DE 2023

DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
10-02-23	FIA RVA EMB II	Compra	EGIE3	38,05	6.100,00	232.122,66	37,24	38,04	38,29	8.350,00
10-02-23	FIA RVA EMB II	Compra	ITSA4	8,55	66.800,00	570.951,45	8,49	8,54	8,66	18.069,00
10-02-23	FIA RVA EMB II	Compra	ITUB4	25,65	41.900,00	1.074.662,22	25,51	25,72	25,98	54.527,00
10-02-23	FIA RVA EMB II	Venda	LREN3	19,13	63.500,00	1.214.900,81	19,02	19,20	19,62	32.295,00
10-02-23	FIA RVA EMB II	Venda	LWSA3	5,46	152.900,00	834.942,00	5,37	5,49	5,63	12.318,00
10-02-23	FIA RVA EMB II	Compra	MULT3	23,41	27.700,00	648.351,64	22,76	23,48	23,85	26.835,00
10-02-23	FIA RVA EMB II	Compra	NTCO3	14,75	6.300,00	92.895,00	14,47	14,78	15,27	51.742,00
10-02-23	FIA RVA EMB II	Compra	RENT3	56,39	14.200,00	800.687,45	56,08	56,68	57,31	22.857,00
10-02-23	FIA RVA EMB II	Compra	TIMS3	11,20	27.100,00	303.494,00	10,79	11,22	11,38	17.524,00
10-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	VALE3	87,08	13.900,00	1.210.394,31	86,36	87,10	88,95	57.764,00
10-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALPA4	10,60	1.000,00	10.600,00	9,17	9,82	10,81	63.676,00
10-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALPA4	10,11	13.700,00	138.544,80	9,17	9,82	10,81	63.676,00
10-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	ALSO3	17,47	500,00	8.737,38	17,19	17,37	17,61	9.045,00
10-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	ALSO3	17,40	20.100,00	349.749,62	17,19	17,37	17,61	9.045,00
10-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,58	8.000,00	36.679,22	4,42	4,59	4,80	45.205,00
10-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	18,77	100,00	1.876,61	18,37	18,78	19,12	14.095,00
10-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	LREN3	19,18	3.800,00	72.869,81	19,02	19,20	19,62	32.295,00
10-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRIO3	42,83	1.700,00	72.813,48	42,16	42,81	43,17	24.420,00
10-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	RDOR3	28,34	1.300,00	36.835,81	27,90	28,32	28,56	10.705,00
10-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	30,43	2.400,00	73.034,43	29,53	30,40	30,80	9.161,00
10-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBRR3	15,36	12.300,00	188.965,91	15,08	15,38	15,83	24.233,00
10-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBRR3	15,64	2.400,00	37.536,54	15,08	15,38	15,83	24.233,00
10-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	8,50	26.600,00	226.143,04	8,35	8,50	8,63	9.246,00
10-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	8,56	400,00	3.422,37	8,35	8,50	8,63	9.246,00
10-02-23	FIA RVA EMB IV	Venda	EQTL3	26,65	14.451,00	385.132,85	26,06	26,73	27,29	23.980,00
10-02-23	FIA RVA EMB IV	Venda	EQTL3	26,69	55.348,00	1.477.348,84	26,06	26,73	27,29	23.980,00
10-02-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ITUB4	25,68	33.292,00	854.876,13	25,51	25,72	25,98	54.527,00
10-02-23	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	23,39	19.216,00	449.481,82	22,76	23,48	23,85	26.835,00
10-02-23	FIA RVA EMB IV	Compra	PRIO3	42,79	8.990,00	384.715,13	42,16	42,81	43,17	24.420,00
10-02-23	FIA RVA EMB IV	Compra	PRIO3	42,93	4.967,00	213.232,93	42,16	42,81	43,17	24.420,00
10-02-23	FIA RVA EMB IV	Compra	PRIO3	42,77	619,00	26.476,67	42,16	42,81	43,17	24.420,00
13-02-23	FIA RVA EMB II	Compra	BPAC11	21,45	28.500,00	611.190,93	21,12	21,46	21,94	44.781,00
13-02-23	FIA RVA EMB II	Venda	CPFE3	30,95	23.900,00	739.644,85	30,80	30,99	31,34	4.913,00
13-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALPA4	9,88	3.800,00	37.554,00	9,34	9,81	10,06	25.063,00
13-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	17,63	21.400,00	377.350,64	17,36	17,65	17,92	7.837,00
13-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,03	27.600,00	414.732,14	14,85	15,01	15,16	7.268,00
13-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,00	4.400,00	65.996,20	14,85	15,01	15,16	7.268,00
13-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	40,60	3.700,00	150.235,00	40,03	40,58	41,14	46.133,00
13-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	21,66	7.300,00	158.145,70	21,12	21,46	21,94	44.781,00
13-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	21,31	20.000,00	426.271,00	21,12	21,46	21,94	44.781,00
13-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	CLSA3	4,56	2.200,00	10.039,00	4,48	4,56	4,74	1.876,00
13-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	36,78	11.800,00	434.021,00	36,40	36,73	37,23	18.684,00
13-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	11,81	35.100,00	414.391,00	11,48	11,76	11,93	18.415,00
13-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	26,58	24.300,00	645.947,51	26,42	26,62	27,08	16.866,00
13-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,59	24.300,00	111.608,20	4,45	4,58	4,70	29.266,00
13-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	18,82	17.100,00	321.873,36	18,67	18,89	19,20	11.370,00
13-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	8,78	4.200,00	36.878,00	8,53	8,75	8,82	24.828,00
13-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	26,72	15.100,00	403.510,18	25,78	26,61	26,83	66.193,00
13-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	19,24	16.800,00	323.246,00	18,97	19,30	19,64	26.944,00
13-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	LWSA3	5,53	3.500,00	19.370,00	5,41	5,53	5,66	10.363,00
13-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	NINI3	2,81	4.600,00	12.914,00	2,77	2,81	2,90	427,00
13-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	14,63	5.700,00	83.417,00	14,00	14,52	14,84	29.151,00
13-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	7,42	11.200,00	83.083,00	7,11	7,41	7,53	2.620,00
13-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	6,57	30.600,00	200.917,00	6,41	6,58	6,77	9.036,00
13-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRIO3	42,26	1.600,00	67.623,00	41,74	42,30	42,90	22.033,00
13-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRIO3	42,47	1.300,00	55.208,13	41,74	42,30	42,90	22.033,00
13-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	RAIZ4	3,18	23.000,00	73.128,00	3,13	3,17	3,22	17.814,00
13-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	28,10	4.600,00	129.241,00	27,55	28,08	28,48	8.685,00
13-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	30,62	7.300,00	223.552,00	29,77	30,52	30,88	11.155,00
13-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	56,87	8.400,00	477.722,15	56,34	56,95	57,97	16.507,00
13-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	8,95	22.000,00	196.893,00	8,45	8,86	9,02	16.421,00
13-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	46,83	13.300,00	622.857,50	46,24	46,83	47,15	15.438,00
13-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	TEND3	3,97	5.200,00	20.634,00	3,93	3,98	4,06	4.104,00
13-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBRR3	15,69	18.100,00	283.987,00	15,25	15,70	15,88	11.934,00
13-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	8,60	14.400,00	123.897,00	8,45	8,57	8,71	4.470,00
13-02-23	FIA RVA EMB IV	Venda	EQTL3	26,72	1.167,00	31.177,55	26,42	26,62	27,08	16.866,00
13-02-23	FIA RVA EMB IV	Venda	EQTL3	26,60	10.625,00	282.577,44	26,42	26,62	27,08	16.866,00
13-02-23	FIA RVA EMB IV	Venda	EQTL3	27,01	31,00	837,25	26,42	26,62	27,08	16.866,00
13-02-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	BTLG11	93,96	5.321,00	499.961,16	93,60	93,94	94,20	4.936,00
14-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	14,90	4.700,00	70.044,89	14,70	14,89	15,17	6.500,00
14-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	42,31	2.300,00	97.318,48	41,25	42,22	42,75	104.682,00
14-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	42,13	3.000,00	126.386,75	41,25	42,22	42,75	104.682,00
14-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	35,11	4.500,00	158.002,14	34,90	35,40	36,76	47.321,00
14-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	26,32	600,00	15.792,54	26,13	26,39	26,76	14.284,00
14-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,52	7.700,00	34.814,58	4,45	4,56	4,71	35.510,00
14-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	26,61	4.600,00	122.409,79	26,31	26,54	26,88	45.547,00
14-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	26,69	3.600,00	96.084,19	26,31	26,54	26,88	45.547,00
14-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	LREN3	18,67	7.300,00	136.255,75	18,54	18,81	19,56	28.316,00
14-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	7,68	6.500,00	49.923,35	7,45	7,63	7,76	3.604,00
14-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	6,44	8.100,00	52.151,49	6,36	6,47	6,67	13.117,00
14-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	6,44	2.500,00	16.094,06	6,36	6,47	6,67	13.117,00
14-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	RDOR3	27,15	5.100,00	138.457,25	26,87	27,25	28,40	17.805,00
14-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBRR3	15,29	7.900,00	120.825,65	15,14	15,35	15,88	18.517,00
14-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	8,18	3.800,00	31.099,23	7,99	8,31	8,73	15.024,00
14-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	8,64	6.700,00	57.888,01	7,99	8,31	8,73	15.024,00



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE FEVEREIRO DE 2023 À 28 DE FEVEREIRO DE 2023

DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
14-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	8,55	3.800,00	32.490,00	7,99	8,31	8,73	15.024,00
15-02-23	FIA RVA EMB II	Compra	BBDC4	13,82	54.800,00	757.540,17	13,16	13,66	13,85	81.457,00
15-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	17,79	2.200,00	39.138,00	17,04	17,55	17,93	13.540,00
15-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,20	18.800,00	285.758,00	14,85	15,07	15,23	8.557,00
15-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,08	5.000,00	75.391,50	14,85	15,07	15,23	8.557,00
15-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,10	4.500,00	67.950,00	14,85	15,07	15,23	8.557,00
15-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,05	1.300,00	19.570,39	14,85	15,07	15,23	8.557,00
15-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	41,96	500,00	20.982,00	41,18	41,91	42,18	49.542,00
15-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	21,49	1.600,00	34.384,00	20,36	21,31	21,68	49.963,00
15-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	35,47	1.400,00	49.658,00	34,54	35,71	36,22	50.720,00
15-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	35,51	6.500,00	230.834,23	34,54	35,71	36,22	50.720,00
15-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	11,84	2.300,00	27.232,00	11,45	11,68	11,89	20.015,00
15-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENJU3	0,79	12.200,00	9.638,00	0,76	0,80	0,83	998,00
15-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	26,77	2.600,00	69.605,00	26,19	26,64	26,85	17.644,00
15-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,97	33.400,00	166.004,40	4,54	4,91	5,04	50.387,00
15-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	18,95	2.400,00	45.469,00	18,77	19,06	19,06	19.001,00
15-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	26,89	1.500,00	40.336,00	26,12	26,79	27,07	53.609,00
15-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	LRN3	19,59	4.400,00	86.194,00	18,55	19,34	19,75	34.583,00
15-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	14,78	600,00	8.868,00	14,15	14,79	15,24	37.246,00
15-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	7,92	4.300,00	34.056,00	7,60	7,89	8,00	5.314,00
15-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	7,87	300,00	2.361,00	7,60	7,89	8,00	5.314,00
15-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	6,63	3.200,00	21.216,00	6,37	6,55	6,73	16.015,00
15-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	28,72	600,00	17.232,00	26,67	28,29	29,02	20.528,00
15-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	30,71	900,00	27.643,00	29,15	30,25	30,72	14.410,00
15-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	57,03	900,00	51.329,00	54,72	56,59	57,76	33.508,00
15-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	9,12	2.400,00	21.888,00	8,71	9,06	9,23	22.875,00
15-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	47,67	1.400,00	66.732,00	46,62	47,63	48,18	20.877,00
15-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	15,69	1.900,00	29.809,00	15,19	15,53	15,75	21.830,00
15-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	8,61	1.400,00	12.058,00	7,99	8,38	8,75	14.585,00
15-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	8,47	5.600,00	47.434,54	7,99	8,38	8,75	14.585,00
15-02-23	FIA RVA EMB IV	Venda	EQTL3	26,68	7.290,00	194.476,64	26,19	26,64	26,85	17.644,00
15-02-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RAIL3	17,30	3.296,00	57.020,80	16,97	17,41	17,69	24.164,00
15-02-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RAIL3	17,30	2.344,00	40.550,73	16,97	17,41	17,69	24.164,00
16-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,12	2.300,00	34.767,68	14,78	15,06	15,29	9.707,00
16-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,00	1.800,00	27.000,00	14,78	15,06	15,29	9.707,00
16-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	14,90	5.200,00	77.480,00	14,78	15,06	15,29	9.707,00
16-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	35,19	2.800,00	98.528,43	34,44	35,19	35,97	48.442,00
16-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,95	10.800,00	53.467,21	4,77	5,02	5,17	34.388,00
16-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	7,94	3.400,00	26.992,68	7,78	7,92	7,97	3.598,00
16-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	6,65	9.000,00	59.822,87	6,47	6,66	6,86	15.165,00
16-02-23	FIA RVA EMB IV	Venda	EQTL3	26,27	731,00	19.203,88	26,00	26,31	26,63	17.603,00
16-02-23	FIA RVA EMB IV	Venda	EQTL3	26,23	1.664,00	43.640,68	26,00	26,31	26,63	17.603,00
16-02-23	FIA RVA EMB IV	Venda	EQTL3	26,48	97,00	2.568,56	26,00	26,31	26,63	17.603,00
16-02-23	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	5,10	43.364,00	221.154,89	4,77	5,02	5,17	34.388,00
16-02-23	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	5,13	2.200,00	11.281,64	4,77	5,02	5,17	34.388,00
16-02-23	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	5,11	3.323,00	16.988,99	4,77	5,02	5,17	34.388,00
16-02-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	BTLG11	93,17	9.338,00	869.978,78	92,80	93,21	94,00	6.501,00
16-02-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSM11	78,14	5.646,00	441.182,90	77,50	78,33	78,85	2.325,00
16-02-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	MALL11	100,58	1.303,00	131.052,95	100,10	100,54	100,90	2.122,00
16-02-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	TRXF11	103,88	30.147,00	3.131.788,97	103,71	103,90	104,39	5.964,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ABEV3	13,08	9.100,00	119.028,00	12,96	13,05	13,30	30.582,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ALPA4	10,02	400,00	4.008,00	9,87	10,07	10,22	15.251,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ALSO3	17,78	700,00	12.446,00	17,35	17,71	17,95	10.725,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ARZ3	78,73	100,00	7.873,00	76,98	78,31	79,09	4.858,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ASAI3	19,01	1.900,00	36.119,00	18,53	18,89	19,22	31.700,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	AZUL4	8,03	700,00	5.621,00	7,87	8,13	8,49	13.520,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	B3SA3	11,37	12.200,00	138.714,00	10,86	11,13	11,39	79.595,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BBAS3	42,40	2.900,00	122.960,00	41,37	41,90	42,59	43.488,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BBDC3	12,22	3.100,00	37.882,00	11,94	12,19	12,37	11.760,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BBDC4	14,02	10.700,00	150.014,00	13,53	13,88	14,09	59.672,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BBSE3	35,37	1.400,00	49.518,00	34,71	35,26	35,55	19.480,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BEEF3	12,37	500,00	6.185,00	12,34	12,49	13,17	27.377,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BPAC11	21,39	2.500,00	53.475,00	20,88	21,29	21,69	44.847,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BPAN4	5,61	700,00	3.927,00	5,40	5,56	5,70	5.273,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BRAP4	29,21	500,00	14.605,00	29,00	29,22	29,47	6.430,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BRFS3	6,77	2.200,00	14.894,00	6,34	6,60	6,85	26.833,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BRKMS	20,30	600,00	12.180,00	20,12	20,35	20,62	14.369,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CASH3	0,94	1.400,00	1.316,00	0,89	0,92	0,96	7.623,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CCRO3	11,08	2.100,00	23.268,00	10,62	10,91	11,17	24.651,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CIEL3	5,34	2.300,00	12.282,00	5,23	5,30	5,36	28.900,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CMIG4	10,94	3.000,00	32.820,00	10,61	10,80	10,97	16.419,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CMIN3	4,90	2.300,00	11.270,00	4,90	4,97	5,12	9.350,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	COGN3	2,20	3.800,00	8.360,00	2,11	2,16	2,24	17.275,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CPFE3	30,93	400,00	12.372,00	30,30	30,72	31,13	9.521,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CPL66	7,46	3.200,00	23.872,00	7,20	7,36	7,50	23.924,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CRFB3	14,97	1.100,00	16.467,00	14,77	14,99	15,19	16.060,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CSAN3	15,91	2.400,00	38.184,00	15,51	15,85	16,08	12.997,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CSNA3	17,96	1.200,00	21.552,00	17,67	17,94	18,20	12.505,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CVCB3	3,71	600,00	2.226,00	3,42	3,64	3,79	14.301,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CYRE3	14,80	600,00	8.880,00	14,71	14,85	15,34	18.303,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	DXCO3	6,80	600,00	4.080,00	6,63	6,76	6,86	8.064,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ECOR3	4,17	600,00	2.502,00	3,94	4,10	4,18	9.020,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	EGIE3	39,05	500,00	19.525,00	38,42	38,86	39,22	10.479,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ELET3	35,97	3.900,00	140.283,00	34,44	35,19	35,97	48.442,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ELET6	37,33	600,00	22.398,00	36,12	36,69	37,58	14.521,00



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE FEVEREIRO DE 2023 À 28 DE FEVEREIRO DE 2023

DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	EMBR3	16,24	1.500,00	24.360,00	16,11	16,24	16,40	10.818,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ENBR3	19,98	500,00	9.990,00	19,72	19,93	20,08	5.793,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ENEV3	11,84	3.300,00	39.072,00	11,45	11,77	12,02	16.685,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ENGI11	39,99	500,00	19.995,00	39,06	39,72	40,29	7.071,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	EQTL3	26,48	2.300,00	60.904,00	26,00	26,31	26,63	17.603,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	EZTC3	13,02	200,00	2.604,00	12,72	12,97	13,40	10.041,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	FLRY3	15,34	700,00	10.738,00	14,80	15,17	15,48	9.563,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	GGBR4	28,86	2.300,00	66.378,00	28,65	28,97	29,40	26.325,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	GOAU4	12,71	1.400,00	17.794,00	12,62	12,75	12,96	9.792,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	GOLL4	5,97	400,00	2.388,00	5,86	6,00	6,12	10.087,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	HAPV3	5,13	9.200,00	47.196,00	4,77	5,02	5,17	34.388,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	HYPE3	46,33	800,00	37.064,00	44,97	45,88	46,68	17.921,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	IGTI11	19,36	400,00	7.744,00	18,62	19,17	19,57	22.801,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ITSA4	8,76	10.800,00	94.608,00	8,66	8,75	8,83	17.550,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ITUB4	26,97	9.900,00	267.003,00	26,42	26,88	27,09	51.465,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	JBS53	19,01	2.400,00	45.624,00	18,80	19,01	19,64	19.729,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	KLBN11	19,70	1.500,00	29.550,00	19,46	19,68	20,05	18.815,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	LEN3	19,38	2.000,00	38.760,00	18,65	19,18	19,58	35.834,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	LWSA3	5,70	900,00	5.130,00	5,46	5,60	5,72	7.011,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	MGLU3	3,81	5.900,00	22.479,00	3,71	3,80	3,94	36.219,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	MRF3	6,76	700,00	4.732,00	6,60	6,71	6,84	14.148,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	MRVE3	6,45	600,00	3.870,00	6,33	6,45	6,57	12.049,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	MULT3	24,47	600,00	14.682,00	23,59	24,25	24,66	26.056,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	NTCO3	15,36	1.700,00	26.112,00	14,80	15,12	15,46	33.442,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	PCAR3	18,33	300,00	5.499,00	18,15	18,32	18,77	7.030,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	PETR3	30,15	7.200,00	217.080,00	30,00	30,28	30,48	20.980,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	PETRA	26,85	9.400,00	252.390,00	26,49	26,77	26,95	65.842,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	PETZ3	6,75	700,00	4.725,00	6,47	6,66	6,86	15.165,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	PRIO3	40,25	1.700,00	68.425,00	39,92	40,28	41,02	24.018,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	QUAL3	5,29	600,00	3.174,00	5,01	5,16	5,31	7.986,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	RADL3	23,30	2.500,00	58.250,00	23,00	23,19	23,47	13.956,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	RAIL3	17,95	2.500,00	44.875,00	17,40	18,03	18,29	36.252,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	RAI24	3,08	2.500,00	7.700,00	3,00	3,05	3,12	21.941,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	RDOR3	29,07	2.400,00	69.768,00	27,46	28,60	29,45	14.874,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	RENT3	58,09	1.600,00	92.944,00	55,34	57,29	58,45	27.709,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	RRRP3	41,34	400,00	16.536,00	40,82	41,24	41,72	9.336,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	SANB11	29,55	700,00	20.685,00	28,94	29,40	29,79	11.638,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	SBS3	55,04	700,00	38.528,00	53,23	54,44	55,10	13.220,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	SLCE3	51,34	200,00	10.268,00	51,22	51,48	52,25	6.494,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	SMT03	27,63	300,00	8.289,00	26,69	27,39	27,98	13.225,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	SOMA3	9,19	1.000,00	9.190,00	8,86	9,12	9,32	16.697,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	SUZB3	47,76	1.500,00	71.640,00	47,40	47,89	48,84	19.800,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	TAE11	35,84	500,00	17.920,00	35,63	35,81	35,99	10.443,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	TIMS3	12,13	1.700,00	20.621,00	11,95	12,10	12,22	13.072,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	TOTS3	28,50	1.100,00	31.350,00	27,49	28,14	28,73	27.531,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	UGPA3	12,89	2.300,00	29.647,00	12,46	12,76	13,12	42.491,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	USIM5	7,30	1.100,00	8.030,00	7,15	7,24	7,35	12.952,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	VALE3	89,19	7.000,00	624.330,00	88,90	89,57	90,26	76.056,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	VBBR3	15,58	2.300,00	35.834,00	15,12	15,46	15,74	24.306,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	VIIA3	2,29	3.300,00	7.557,00	2,15	2,23	2,33	25.030,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	VIVT3	40,48	900,00	36.432,00	39,20	40,21	40,83	12.136,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	WEGE3	38,78	2.700,00	104.706,00	37,80	38,46	38,96	24.545,00
16-02-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	YDUQ3	8,38	600,00	5.028,00	8,09	8,31	8,53	9.058,00
17-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	20,68	2.500,00	51.700,00	20,54	20,79	21,32	38.728,00
17-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	20,77	4.600,00	95.523,66	20,54	20,79	21,32	38.728,00
17-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	20,62	2.900,00	59.798,00	20,54	20,79	21,32	38.728,00
17-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	36,11	2.600,00	93.895,87	35,50	36,03	36,45	40.598,00
17-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	26,65	4.500,00	119.929,47	26,28	26,57	26,79	16.802,00
17-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	26,95	7.700,00	207.518,86	26,70	26,94	27,15	49.811,00
17-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	LEN3	19,37	4.400,00	85.242,01	18,43	19,27	19,83	52.427,00
17-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	6,69	7.700,00	51.521,65	6,62	6,68	6,80	8.694,00
17-02-23	FIA RVA EMB IV	Venda	BPAC11	20,68	2.196,00	45.413,28	20,54	20,79	21,32	38.728,00
17-02-23	FIA RVA EMB IV	Venda	BPAC11	20,88	1.758,00	36.711,19	20,54	20,79	21,32	38.728,00
17-02-23	FIA RVA EMB IV	Venda	BPAC11	20,64	21.113,00	435.742,51	20,54	20,79	21,32	38.728,00
17-02-23	FIA RVA EMB IV	Venda	BPAC11	20,77	11.776,00	244.589,35	20,54	20,79	21,32	38.728,00
17-02-23	FIA RVA EMB IV	Venda	BPAC11	20,86	6.756,00	140.926,97	20,54	20,79	21,32	38.728,00
17-02-23	FIA RVA EMB IV	Venda	EQTL3	26,63	183,00	4.872,95	26,28	26,57	26,79	16.802,00
17-02-23	FIA RVA EMB IV	Venda	EQTL3	26,63	888,00	23.643,09	26,28	26,57	26,79	16.802,00
17-02-23	FIA RVA EMB IV	Venda	EQTL3	26,67	61,00	1.626,75	26,28	26,57	26,79	16.802,00
17-02-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	57,35	368,00	21.103,36	56,54	57,33	57,87	21.261,00
17-02-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	57,53	3.751,00	215.810,50	56,54	57,33	57,87	21.261,00
17-02-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	57,40	625,00	35.875,00	56,54	57,33	57,87	21.261,00
22-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	ALSO3	17,56	1.600,00	28.095,00	17,46	17,61	18,09	8.345,00
22-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	14,99	17.000,00	254.815,00	14,89	14,97	15,26	10.544,00
22-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	41,90	300,00	12.569,00	41,66	41,94	42,81	32.781,00
22-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	20,67	1.400,00	28.943,00	20,07	20,56	20,83	28.050,00
22-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	34,87	800,00	27.898,88	34,65	34,87	35,40	23.697,00
22-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	11,45	2.800,00	32.050,00	11,23	11,40	11,56	14.949,00
22-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	25,92	2.100,00	54.438,67	25,77	25,90	26,16	12.997,00
22-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	25,91	2.000,00	51.825,00	25,77	25,90	26,16	12.997,00
22-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	19,10	1.800,00	34.377,00	18,92	19,10	19,30	14.432,00
22-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	26,37	1.200,00	31.648,00	26,26	26,51	26,64	35.664,00
22-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	LEN3	18,68	3.000,00	56.047,05	18,52	18,81	19,40	28.420,00
22-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	LEN3	18,84	1.500,00	28.262,00	18,52	18,81	19,40	28.420,00
22-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	7,95	2.200,00	17.490,00	7,80	7,95	8,08	2.128,00



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO
E CONTROLE DE RISCO - FEVEREIRO DE 2023



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE FEVEREIRO DE 2023 À 28 DE FEVEREIRO DE 2023

DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBovespa			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
22-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	RDOR3	27,80	400,00	11.120,00	27,22	27,76	28,20	15.853,00
22-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	RDOR3	27,73	1.200,00	33.272,29	27,22	27,76	28,20	15.853,00
22-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	29,09	500,00	14.543,00	28,64	29,10	29,32	14.238,00
22-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	55,52	600,00	33.314,00	54,67	55,45	56,39	22.495,00
22-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	9,09	1.800,00	16.368,83	9,00	9,08	9,35	15.350,00
22-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	46,15	1.100,00	50.765,00	45,72	46,16	46,66	19.864,00
22-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	15,01	1.300,00	19.512,64	14,93	15,05	15,30	17.197,00
22-02-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSM11	79,26	455,00	36.065,34	78,82	79,39	80,00	2.124,00
23-02-23	FIA RVA EMB II	Venda	ABEV3	13,26	70.100,00	929.419,00	13,12	13,25	13,40	30.736,00
23-02-23	FIA RVA EMB II	Venda	BBAS3	42,19	7.500,00	316.432,99	41,68	42,03	42,60	54.415,00
23-02-23	FIA RVA EMB II	Compra	PETRA	26,70	86.900,00	2.319.795,50	25,77	26,45	26,79	90.985,00
23-02-23	FIA RVA EMB II	Venda	PET3	6,89	89.100,00	613.948,00	6,77	6,88	7,02	14.220,00
23-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	25,99	1.300,00	33.786,93	25,67	26,05	26,40	21.596,00
23-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	LEN3	18,87	1.700,00	32.071,61	18,61	18,95	19,37	33.195,00
23-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	15,39	5.400,00	83.081,53	15,06	15,38	15,75	47.036,00
23-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	PET3	6,88	7.800,00	53.674,93	6,77	6,88	7,02	14.220,00
23-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	PET3	6,95	1.900,00	13.205,00	6,77	6,88	7,02	14.220,00
23-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT9	42,25	41,00	1.732,25	54,89	55,50	56,72	20.933,00
24-02-23	FIA RVA EMB II	Venda	ITSA4	8,36	91.200,00	762.868,34	8,32	8,37	8,56	19.134,00
24-02-23	FIA RVA EMB II	Compra	PETRA	26,42	27.000,00	713.261,70	25,87	26,19	26,70	80.138,00
24-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	14,86	11.300,00	167.871,26	14,70	14,88	15,19	9.141,00
24-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	20,29	8.300,00	168.374,83	20,16	20,30	20,61	21.517,00
24-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	34,56	7.300,00	252.312,50	34,26	34,60	35,05	25.189,00
24-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	PET3	6,86	4.400,00	30.178,37	6,77	6,88	7,00	8.952,00
24-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	PET3	6,90	5.300,00	36.548,84	6,77	6,88	7,00	8.952,00
24-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	RDOR3	26,70	4.400,00	117.466,95	26,29	26,75	27,76	14.617,00
27-02-23	FIA RVA EMB II	Venda	ITUB4	25,48	40.400,00	1.029.264,89	25,28	25,46	25,80	41.942,00
27-02-23	FIA RVA EMB II	Compra	PETRA	26,49	86.000,00	2.278.550,91	25,81	26,32	26,74	102.376,00
27-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	14,82	6.000,00	88.913,52	14,76	14,86	15,14	10.257,00
27-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	34,67	2.700,00	93.603,21	34,23	34,55	34,92	19.008,00
27-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	25,59	22.800,00	583.365,62	25,38	25,55	25,99	12.167,00
27-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,58	7.300,00	33.459,13	4,52	4,60	4,83	29.451,00
27-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	MRVE3	6,20	9.100,00	56.428,36	6,07	6,16	6,24	9.315,00
27-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	PET3	6,81	13.600,00	92.556,40	6,64	6,78	7,09	15.104,00
27-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	PET3	6,73	3.500,00	23.560,92	6,64	6,78	7,09	15.104,00
27-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	RDOR3	26,70	3.800,00	101.472,73	26,35	26,64	27,25	11.414,00
27-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	TEND3	4,85	11.500,00	55.767,32	4,45	4,82	4,97	4.806,00
27-02-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	BTLG11	92,49	5.946,00	549.963,28	92,11	92,50	92,94	6.094,00
27-02-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSLG11	80,51	3.034,00	244.267,14	78,51	80,24	81,85	787,00
27-02-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSM11	79,88	3.114,00	248.740,00	79,42	79,89	80,30	2.597,00
27-02-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	PATC11	67,28	7.432,00	500.024,96	66,76	67,27	67,45	233,00
27-02-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	QAGR11	41,90	9.547,00	400.019,30	41,64	41,87	42,00	480,00
27-02-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	TEPP11	67,35	26.726,00	1.799.996,10	66,45	67,35	68,00	413,00
27-02-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	TRFX11	103,63	6.006,00	622.402,15	103,50	103,65	104,00	3.016,00
27-02-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	XPIN11	70,82	330,00	23.370,61	70,40	70,63	71,10	889,00
28-02-23	FIA RVA EMB II	Venda	ASAI3	18,14	67.000,00	1.215.380,00	17,86	18,15	18,46	22.272,00
28-02-23	FIA RVA EMB II	Compra	CPFE3	30,29	21.200,00	642.148,00	30,09	30,33	30,71	6.993,00
28-02-23	FIA RVA EMB II	Compra	CSMG3	14,22	43.500,00	618.570,00	14,22	14,44	15,01	9.544,00
28-02-23	FIA RVA EMB II	Venda	ELET3	34,46	22.900,00	789.236,10	33,88	34,32	34,91	25.229,00
28-02-23	FIA RVA EMB II	Compra	GGBR4	28,63	6.500,00	186.095,00	28,11	28,62	28,80	23.459,00
28-02-23	FIA RVA EMB II	Compra	GMAT3	5,64	181.300,00	1.021.785,20	5,49	5,63	5,86	17.692,00
28-02-23	FIA RVA EMB II	Venda	PET3	28,75	41.900,00	1.204.625,00	28,75	29,40	30,72	40.585,00
28-02-23	FIA RVA EMB II	Venda	PETRA	25,67	47.000,00	1.206.365,18	25,24	25,92	26,92	142.888,00
28-02-23	FIA RVA EMB II	Venda	PRIO3	35,24	9.400,00	331.248,00	33,70	35,37	37,26	71.821,00
28-02-23	FIA RVA EMB II	Compra	STBP3	8,01	60.400,00	483.804,00	7,96	8,06	8,22	9.336,00
28-02-23	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	47,74	6.800,00	324.632,00	46,14	47,49	47,95	19.813,00
28-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	17,23	2.800,00	48.244,00	16,97	17,21	17,55	19.953,00
28-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	14,77	1.200,00	17.724,00	14,74	14,86	15,10	14.872,00
28-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	14,90	11.600,00	172.840,00	14,74	14,86	15,10	14.872,00
28-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	B3SA3	10,67	900,00	9.603,00	10,43	10,61	10,74	40.907,00
28-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	B3SA3	10,64	10.100,00	107.464,00	10,43	10,61	10,74	40.907,00
28-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	B3SA3	10,66	12.400,00	132.184,00	10,43	10,61	10,74	40.907,00
28-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	40,35	500,00	20.175,00	39,90	40,33	40,79	39.877,00
28-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	20,10	2.800,00	56.280,00	19,85	20,11	20,36	22.952,00
28-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	34,35	4.000,00	137.400,00	33,88	34,32	34,91	25.229,00
28-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	11,46	4.900,00	56.154,00	11,24	11,43	11,59	39.029,00
28-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	25,64	200,00	5.128,00	25,42	25,56	25,76	21.547,00
28-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	25,58	21.100,00	539.738,00	25,42	25,56	25,76	21.547,00
28-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	25,60	4.800,00	122.880,00	25,42	25,56	25,76	21.547,00
28-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	25,43	3.300,00	83.919,00	25,42	25,56	25,76	21.547,00
28-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,56	10.400,00	47.424,00	4,42	4,55	4,78	83.675,00
28-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	19,38	3.100,00	60.078,00	19,18	19,37	19,53	20.481,00
28-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	25,43	1.800,00	45.774,00	25,18	25,43	25,83	45.209,00
28-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	LEN3	18,82	3.100,00	58.342,00	18,65	18,87	19,42	22.937,00
28-02-23	FIA RVA EMB III	Compra	MRVE3	5,95	2.600,00	15.470,00	5,88	5,96	6,26	19.038,00
28-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	NINJ3	2,62	3.600,00	9.432,00	2,53	2,60	2,67	588,00
28-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	7,83	3.000,00	23.490,00	7,43	7,69	8,00	5.840,00
28-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	PET3	6,48	2.100,00	13.608,00	6,43	6,52	6,76	11.909,00
28-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	RAI24	3,07	3.500,00	10.745,00	3,04	3,08	3,14	16.411,00
28-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	25,85	800,00	20.680,00	25,48	25,84	26,96	24.759,00
28-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	28,94	1.000,00	28.940,00	28,30	28,94	30,57	13.311,00
28-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	55,92	1.100,00	61.512,00	54,55	55,69	56,23	27.802,00
28-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	8,87	3.000,00	26.610,00	8,78	8,87	9,10	9.086,00
28-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	47,50	1.900,00	90.250,00	46,14	47,49	47,95	19.813,00



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE FEVEREIRO DE 2023 À 28 DE FEVEREIRO DE 2023

DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
28-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	TEND3	4,75	3.500,00	16.625,00	4,67	4,76	4,87	4.402,00
28-02-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	14,89	2.400,00	35.736,00	14,60	14,83	15,08	15.731,00
28-02-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ALSO3	17,21	4.952,00	85.231,30	16,97	17,21	17,55	19.953,00
28-02-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	5,65	12.466,00	70.492,69	5,49	5,63	5,86	17.692,00
28-02-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	5,64	17.412,00	98.253,87	5,49	5,63	5,86	17.692,00
28-02-23	FIA RVA EMB IV	Venda	PRIO3	34,73	10.271,00	356.710,52	33,70	35,37	37,26	71.821,00
28-02-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	55,94	4.660,00	260.702,10	54,55	55,69	56,23	27.802,00

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.