



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO



Janeiro/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: 31/01/2023

Relatório de Risco de Mercado

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

Dados Gerais							
PL:	4.146.330.363,36	VAR / PL:	2,6924%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	1,7188
VAR:	111.636.050,45	ETL / PL:	3,3764%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1,18148
ETL:	139.996.111,06	VAR / CDI:	0,0303%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	204.971.568,77	Cenário Baixa - 10000 (+):	266.803.707,49	CENARIO BRADESCO 1 (+):	353.328.319,73	CENARIO BRADESCO 2 (+):	49.911.721,00
Cenário Alta - 09999 (-):	(166.748.256,40)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(201.414.127,29)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(40.059.831,68)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(386.261.476,51)
Cenário Alta - 09999:	38.223.312,37	Cenário Baixa - 10000:	65.389.580,19	CENARIO BRADESCO 1:	313.268.488,05	CENARIO BRADESCO 2:	(336.349.755,51)

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
77HD164854	8.526.672,80	109.741,63	104.701,00	0,00%	-241.321,46	189.028,84	169.900,29	-223.199,06
AEGP23	14.267.878,01	156.453,05	140.371,92	0,13%	1.267.905,90	-1.675.447,08	1.327.678,61	-1.338.546,37
CCRDD1	6.050.457,43	42.389,46	33.228,83	0,03%	0,00	0,00	0,00	0,00
CMDDT3	2.048.058,75	12.038,16	10.567,85	0,01%	-360.824,88	252.960,77	227.469,60	-302.413,36
CSMGG3	12.742.876,91	90.954,52	85.370,32	0,08%	-8.628,41	7.004,45	12.744,80	-16.938,27
ELET42	13.119.371,57	302.783,80	293.221,94	0,26%	1.822.595,83	-1.822.601,33	534.386,71	-538.760,95
ENJG21	1.822.491,39	24.416,36	23.205,70	0,02%	36.216,21	-36.216,21	21.237,19	-21.411,02
ENM21	1.134.410,23	15.871,61	15.109,54	0,01%	1.565,05	-1.307,71	-3.021,99	4.572,27
ENVY12	28.817.594,73	692.804,07	629.856,95	0,05%	3.076.851,61	-2.197.751,30	1.288.761,36	-1.299.310,57
ERDV17_VENCIMENTO	12.531.031,62	130.009,38	116.323,70	0,10%	-5.761,25	4.741,04	8.760,43	-12.144,88
ERDV36	4.033.336,56	28.918,49	22.865,12	0,02%	-814.582,95	667.918,67	704.811,96	-860.127,36
GASP17	61.054.793,57	884.381,63	423.365,82	0,38%	-82.622,14	62.961,03	59.740,99	-77.824,78
GEFA24	7.529.152,65	44.694,32	-53.762,22	0,00%	-390,40	245,06	475,29	-675,92
GRRB24_VENCIMENTO	14.548.923,94	340.369,69	329.458,45	0,30%	716,30	937,38	1.007,89	-1.535,15
IGSN15	2.422.477,97	62.329,47	59.266,13	0,05%	846.189,72	-846.189,72	413.504,71	-416.889,47
LSFN1600GM	7.678.855,37	100.114,06	88.717,18	0,08%	638.677,66	-593.057,83	334.393,38	-337.130,57
LSFN1800DCS	2.800.717,65	45.554,15	42.464,95	0,04%	2.975.451,96	-3.687.080,43	1.743.632,23	-1.757.994,80
NEOE16	6.859.132,45	156.891,20	151.680,61	0,14%	91.434,66	-91.435,39	1.007,89	-30.031,77
NTNB20230515 - 760199_VENCIMENTO	43.328.388,73	136.675,17	130.063,83	0,04%	4.664.365,56	-4.664.365,56	2.735.183,96	-2.757.572,92
NTNB20240815 - 760199_VENCIMENTO	120.899.638,49	944.385,61	679.550,94	0,61%	3.267.507,93	-3.267.507,93	1.916.066,65	-1.931.750,69
NTNB20260815 - 760199_VENCIMENTO	41.099.578,60	730.330,71	688.566,05	0,62%	249.614,14	-199.691,21	146.373,73	-147.571,88
NTNB20300815 - 760199_VENCIMENTO	16.812.645,98	142.846,41	136.553,57	0,50%	46.739,88	-36.353,24	115.226,91	-116.811,38
NTNB20350815 - 760199_VENCIMENTO	217.741.811,67	6.157.624,62	5.851.985,02	0,04%	2.988.517,22	-2.390.813,78	1.752.466,50	-1.766.811,38
NTNB20400815 - 760199_VENCIMENTO	27.104.481,77	838.465,40	757.845,32	0,68%	0,00	0,00	0,00	-486.853,26
NTNB20450815 - 760199_VENCIMENTO	203.058.330,07	6.928.927,70	6.214.120,71	0,57%	-140,20	113,67	231,67	-334,70
NTNB20500815 - 760199_VENCIMENTO	650.522.084,20	23.636.405,88	21.170.543,33	18,96%	-1.545,21	1.258,64	2.546,58	-3.672,37
NTNB20550815 - 760199_VENCIMENTO	201.006.282,03	7.743.107,10	6.875.295,03	6,18%	467.143,59	-467.143,59	273.000,00	-276.175,29
OMGE31	12.242.233,28	201.471,36	190.574,71	0,17%	-321,15	261,94	572,79	-840,09
PETR45	17.822.311,91	103.160,10	61.291,51	0,05%	2.913.600,00	-2.913.600,00	427.133,76	-430.630,08
RDCO34	5.560.848,47	22.126,61	-5.561,06	0,00%	3.820.513,44	-4.457.265,68	1.866.957,57	-1.882.239,62
SBSPFC2	16.812.645,98	142.846,41	136.553,57	0,11%	46.739,88	-36.353,24	115.226,91	-116.351,45
TAEE31	7.976.295,68	53.413,04	39.103,87	0,04%	963.099,50	-963.099,50	141.190,39	-142.345,11
ABEV3	9.056.470,72	590.251,54	-175.456,30	-0,16%	104.783,53	-104.783,53	61.445,06	-61.948,02
AEGP13	648.002,50	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
AEGPA1	1.981.190,42	4.346,79	3.770,27	0,00%	112.138,49	-112.138,49	65.758,01	-66.296,28
AIEC11	3.645.202,65	128.603,97	99.791,96	0,09%	178.845,45	-97.552,06	47.570,14	-49.060,65
ALPA4	144.864,84	22.217,53	17.392,39	0,02%	-380.388,37	327.458,86	337.715,32	-417.389,91
ALSCA0	1.591.523,01	310,17	-186,30	0,00%	-6.364,12	5.246,44	9.590,39	-13.255,58
ALS03	8.791.005,18	1.906.646,76	1.338.721,58	1,20%	-244.675,58	193.799,31	181.321,12	-236.909,82
AMBPI3	2.576.007,13	2.859,52	2.453,33	0,00%	1.809.520,56	-1.809.520,56	530.551,43	-534.894,28
ANEM11	11.609.464,07	330.758,09	304.189,71	0,27%	-501.569,84	428.094,07	425.747,48	-536.491,95
ANET11	2.466.362,23	36.165,42	34.871,17	0,03%	-397.708,67	319.547,79	309.529,53	-400.083,46
ANHB10	747.247,40	140,76	116,16	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
APRB28	1.322.783,87	356,36	300,83	0,00%	-402.449,85	333.984,57	341.294,54	-426.289,61
ARZ2	2.830.632,40	530.419,47	383.211,21	0,11%	-16.344,08	16.344,08	5.990,11	-6.039,14
ASAJ	2.280.991,65	165.694,81	60.361,78	0,05%	-72.240,94	70.413,23	116.318,13	-123.130,49
AURE3	11.893.807,84	696.419,27	240.646,39	0,22%	-608.704,47	515.184,94	522.194,22	-653.465,86
AZUL4	203.191,95	61.516,87	51.913,96	0,05%	-153.422,93	130.289,30	132.569,25	-165.490,09
B3SA03	18.657.402,24	2.746.562,24	2.227.276,15	2,00%	3,10	3,10	7,74	-11,52
BBAS3	13.070.051,70	2.838.690,25	2.052.984,88	1,84%	-116.225,75	75.697,06	64.719,48	-86.513,76
BBDC3	998.456,54	151.667,78	124.858,68	0,11%	153.788,46	-153.788,46	90.181,55	-90.919,74
BBDC4	11.954.068,88	2.198.643,28	1.882.729,93	1,69%	-743,01	606,48	1.264,79	-1.838,93
BBSE3	3.294.000,42	186.167,84	52.682,66	0,05%	-1.249,17	1.033,19	1.899,50	-2.616,74
BSTOPND	220.962.006,95	4.690.953,99	4.574.705,20	0,10%	4.574.705,20	-4.574.705,20	2.291,96	-4.365,00
BCBF14	273.988,30	59,59	47,14	0,00%	387.073,75	-387.073,75	113.490,02	-114.419,00
BCBF15	2.623.414,93	664,02	529,95	0,00%	-5.750,28	4.825,26	8.731,88	-11.729,56
BEF3	1.868.574,35	424.874,69	353.376,47	0,32%	874.392,80	-728.669,66	427.286,61	-430.784,18
BKBR19	1.478.492,53	105,50	75,91	0,00%	-291.365,21	232.623,58	239.199,06	-292.143,43
BMLC11	2.913.600,00	129.065,51	-49.494,96	-0,04%	69.600,00	-69.600,00	20.406,72	-20.573,76
BPAC11	12.735.044,80	1.695.985,64	1.031.361,36	0,92%	-28.901,16	20.426,47	17.324,61	-23.109,75
BPAN4	103.866,40	11.652,92	6.254,64	0,01%	216.536,70	-259.844,04	126.977,12	-128.016,50
BPL11	963.099,50	50.290,78	19.441,20	0,02%	-109.117,83	109.117,83	45.704,78	-46.076,90
BR4A4	419.134,10	26.298,57	-573,76	0,00%	232.207,80	-232.207,80	68.683,33	-68.683,33
BRELETR0	3.434.269,79	32.084,62	-8.837,26	0,00%	-671.909,28	562.345,82	591.992,47	-720.528,29
BRFS3	448.553,96	162.732,88	131.882,39	0,12%	56.720,74	-79.422,39	33.266,63	-33.538,94
BRKMS	325.173,54	44.096,48	24.314,53	0,02%	-22.243,52	22.682,30	103.820,05	-158.011,10
BRKPB8	4.930.238,22	159.137,74	146.126,58	0,13%	0,00	0,00	0,00	0,00
BRKPA0	2.466.759,46	3.294,03	2.819,98	0,00%	-448.665,91	360.110,72	349.690,66	-451.272,92
BRST11	6.405.171,21	119.012,61	114.207,85	0,10%	729.517,57	-729.517,57	534.736,38	-538.113,48
BTLG11	3.619.041,12	148.338,18	76.045,37	0,07%	268,36	-234,30	-573,13	876,66
BTOW15	7.612.795,20	210.777,24	199.589,89	0,18%	432,77	-348,18	771.026,79	-5.962.380,39
CAC21	8.255.684,06	182.093,61	176.256,99	0,06%	-74.763,58	81.521,17	385.210,39	-384.061,53
CAIXA	56.992,13	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CART13	6.063.397,02	168.002,90	158.805,55	0,14%	-113.838,11	-113.840,88	66.754,67	-67.301,09
CASH3	40.860,21	6.842,88	-3.719,62	0,00%	-216.147,67	167.250,56	166.392,87	-213.035,29
CBAN22	6.780.962,60	35.178,99	30.803,85	0,03%	-4.697,19	5.589,26	9.373,53	-12.736,80
CBAN32	8.933.438,73	255.470,94	241.244,05	0,22%	683.677,13	-683.693,50	400.908,27	-404.189,92
CBAN72	2.173.048,53	64.321,05	60.465,41	0,05%	-4.415,74	3.703,17	6.675,55	-8.954,16
CCPR43	42.910,95	0,66	0,39	0,00%	-249.114,31	187.188,40	154.634,20	-206.120,30
CCRO3	615.153,64	109.629,88	84.836,78	0,08%	228.593,40	-171.445,05	83.779,48	-84.465,26
CEAB11	1.724.327,93	289,86	221,92	0,00%	-32.487,75	32.487,75	3.925,61	-3.925,61
CEAB22	553.421,42	632,85	540,51	0,00%	69.589,98	-63.067,35	31.880,91	-32.141,87
CELG12	3.204.253,33	1.378,97	1.136,01	0,00%	235.396,47	73.436,16	6.318.324,53	-6.369.884,54
CEOC11	774.147,50	58.629,49	50.747,19	0,05%	-585.446,16	771.026,79	5.932.448,75	-5.962.380,39
COBR13	2.284.967,71	2.930,11	2.530,59	0,00%	58,18	-58,18	81.521,17	-81.521,17
CIEL3	2.914.642,65	459.834,73						



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO - JANEIRO DE 2023



Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS
CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais
PL: 4.146.330.363,36 VAR/PL: 2,6924% Limite Fundo: 0,00% Duração DC: 1.718,68
ETL: 111.636.050,45 ETL/PL: 3,3764% Status: ENQUADRADO Duração DU: 1.818,48

Cenários de STRESS
Cenário Alta - 09999 (+): 204.971.568,77 Cenário Baixa - 10000 (+): 266.803.707,49 CENARIO BRADESCO 1 (+): 353.328.319,73 CENARIO BRADESCO 2 (+): 491.721.700
Cenário Baixa - 09999 (-): (166.748.256,40) Cenário Baixa - 10000 (-): (201.414.127,29) CENARIO BRADESCO 1 (-): (40.059.831,68) CENARIO BRADESCO 2 (-): (386.261.476,51)

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

Table with columns: Produto, MM, VAR Tot., Comp. VAR, Comp. VAR (%), Cenario Alta - 09999, Cenario Baixa - 10000, CENARIO BRADESCO 1, CENARIO BRADESCO 2. Lists various products like EPGT16, CPLEE, CREDZM24, etc.



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



Data: 31/01/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO:	EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS			1,718.68
CNPJ:	10679245000140			1,181.48

Dados Gerais					
PL:	4.146.330.363,36	VAR / PL:	2,6924%	Limite Fundo:	0,00% Dutation DC:
VAR:	111.636.050,45	ETL / PL:	3,3764%	Status:	ENQUADRADO Dutation DU:
ETL:	139.996.111,06	VAR / CDI:	0,0303%	Benchmark:	

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	204.971.568,77	Cenário Baixa - 10000 (-):	266.803.707,49	CENARIO BRADESCO 1 (+):	353.328.319,73
Cenário Alta - 09999 (-):	(166.748.256,40)	Cenário Baixa - 10000 (+):	(201.414.127,29)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(405.931.831,68)
Cenário Alta - 09999:	38.223.312,37	Cenário Baixa - 10000:	65.389.580,19	CENARIO BRADESCO 1:	49.191.721,00
				CENARIO BRADESCO 2:	(386.261.476,51)
					(336.349.755,51)

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
INTB3	2.343.792,00	337.405,52	302.400,02	0,27%	0,00	0,00	0,00	0,00
IPIL11	8.379.072,30	202.428,78	193.303,10	0,17%	0,00	0,00	0,00	0,00
IRBR12	10.660.108,12	199.495,47	190.769,39	0,17%	0,00	0,00	0,00	0,00
ITPO14	8.515.800,62	304.043,85	280.180,51	0,25%	0,00	0,00	0,00	0,00
ITSA4	6.798.529,42	636.945,81	494.336,45	0,43%	1.921,69	-1.489,60	-2.899,22	4.665,75
ITUB4	34.162.343,03	4.186.670,17	3.993.805,28	3,58%	0,00	0,00	0,00	0,00
IVIA35	1.325.318,35	139,03	106,86	0,00%	2.009,81	-1.550,11	-2.894,12	4.444,14
JBS53	4.763.779,20	615.310,57	450.444,98	0,40%	3.876,88	-2.979,37	-8.506,99	8.918,88
JSMLE5	3.020.429,88	79.246,95	75.689,21	0,07%	5.891,74	-4.527,42	548,03	13.546,53
KLBN11	7.111.112,46	75.002,48	-13.321,51	0,00%	3.961,60	-3.044,26	-9.914,87	9.085,95
LAMEA6	7.928.375,03	212.691,53	202.104,29	0,18%	-14.563,88	12.052,02	21.916,37	-30.167,39
LACAMA9	1.901.988,90	831,46	669,83	0,00%	-89.607,20	162.506,05	133.144,38	-177.060,44
LCAAMD1	9.228.131,47	249.013,98	236.677,21	0,21%	-89.607,20	63.685,11	60.447,28	-79.992,18
LF002100DD	2.125.513,44	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002100G50	1.116.403,17	0,00	0,00	0,00%	-2.912,36	3.097,01	57,67	-87,80
LF002100E1F	1.160.963,67	0,00	0,00	0,00%	-24.822,97	28.394,27	309,69	-471,48
LF002100HDP	1.326.782,07	0,00	0,00	0,00%	-24.936,41	31.158,89	155,05	-236,06
LF002100DD	2.365.133,25	0,00	0,00	0,00%	83.747,43	109.365,10	548,03	-834,33
LF002100ISJ	2.534.587,51	0,00	0,00	0,00%	-60.072,80	102.752,49	2.950,01	-4.489,45
LF00220018H	1.131.232,17	0,00	0,00	0,00%	-12.675,80	29.871,57	1.533,01	-2.331,29
LF002200H09	2.159.410,98	0,00	0,00	0,00%	-250,47	214,38	525,55	-781,10
LFSC19002GT	423.837,05	0,00	0,00	0,00%	-232,77	4.389,26	7.878,68	-10.616,28
LFSC1900889	6.598.120,21	0,00	0,00	0,00%	-201.645,44	154.815,15	144.572,41	-189.685,63
LFSC19000HY	411.327,82	0,00	0,00	0,00%	-378.557,84	322.635,41	321.282,18	-405.286,35
LFSC190054B	806.142,95	0,00	0,00	0,00%	-2.365.746,64	-2.365.801,33	1.734.092,29	-1.748.286,77
LFSC190059S	1.221.049,78	0,00	0,00	0,00%	-329,97	268,73	570,86	-833,43
LFSC19005L1	807.810,98	0,00	0,00	0,00%	-26.451,74	23.847,75	62.805,21	-92.921,28
LFSC22002X	4.839.706,55	7.528,53	6.462,73	0,01%	-39.025,72	31.210,01	66.449,24	-97.476,18
LFSC210029N	3.509.767,39	0,00	0,00	0,00%	-753.181,78	669.486,81	1.138.454,24	-1.579.121,13
LFT20230301 - 210100	18.116.071,16	248,55	-72,62	0,00%	-320.687,65	314.498,29	509.554,63	-679.105,08
LFT20230901 - 210100	17.985.445,10	1.584,40	-355,76	0,00%	-245.174,22	293.732,89	212.953,62	-268.419,74
LFT20240301 - 210100	7.583.810,44	1.103,33	-39,98	0,00%	549.383,15	-549.383,15	201.348,93	-202.937,08
LFT20240901 - 210100	17.654.868,45	3.001,66	557,16	0,00%	1.649.041,14	-1.649.041,14	483.498,86	-487.456,56
LFT20250901 - 210100	9.021.098,88	1.612,99	66,61	0,00%	468.287,06	-468.287,06	228.836,27	-230.709,42
LFT20260901 - 210100	1.690.809,50	639,66	28,62	0,00%	540.988,75	-540.988,75	158.617,90	-159.916,27
LIGH4	2.132.645,42	49,30	29,54	0,00%	653.685,91	-653.704,29	319.458,55	-322.073,49
LIGHD3	1.681.750,21	2.711,81	2.348,28	0,00%	-429.257,00	359.827,90	375.784,35	-459.426,78
LIGHD7	5.539.946,60	101.950,07	97.310,37	0,09%	-6.127,74	5.160,96	9.251,37	-12.316,13
LORTA7	5.776.948,91	159.580,34	151.412,07	0,14%	0,00	0,00	0,00	0,00
LREN3	11.828.733,21	2.257.593,58	1.710.362,71	1,52%	-499.697,24	422.364,99	420.610,00	-531.197,87
LRENB1	1.448.642,67	120,34	89,31	0,00%	51.124,92	-38.343,69	18.737,28	-18.890,66
LTN20230701 - 100000	4.592.527,06	3.655,54	1.502,55	0,00%	33.698,11	-33.698,11	16.671,14	-16.601,93
LTN20240101 - 100000	2.228.807,01	11.865,79	7.287,38	0,00%	-298.578,50	231.004,10	231.587,01	-295.784,59
LTN20250701 - 100000	14.828.918,54	427.684,19	367.208,77	0,33%	5.271,79	-4.130,93	-8.209,62	12.122,11
LTN20260701 - 100000	4.851.294,02	4.883.669,38	160.427,92	0,00%	1.578.433,69	-1.515.361,69	771.327,68	-777.641,42
LTTE15	3.471.283,40	101.156,87	93.971,63	0,08%	-386.664,11	302.357,61	306.939,19	-394.305,91
LWSA3	1.373.457,88	192.073,21	82.818,63	0,07%	-351.890,10	288.206,23	281.007,98	-361.399,23
MALL11	3.298.082,28	162.819,04	109.077,77	0,10%	465.393,68	-465.393,68	136.453,43	-137.570,37
MATD3	1.550.956,05	426.031,14	327.087,65	0,29%	653.869,60	-653.869,60	350.869,60	-350.869,60
MAXR11	1.081.977,50	100.968,48	-27.067,60	-0,02%	195.627,60	-195.627,60	47.798,34	-48.189,60
MGLU3	2.179.117,00	1.487.227,34	977.737,22	0,88%	810.413,18	-648.330,54	475.226,29	-478.116,27
MGSP12	5.782.972,06	177.936,40	164.379,06	0,15%	-451.091,88	362.419,06	305.325,99	-451.770,59
MOVZ7	1.222.350,42	3.157,93	2.739,81	0,00%	-698.935,83	893.198,82	302.244,83	-409.244,45
MOVZ3	782.865,65	0,00	0,00	0,00%	-166.003,65	189.874,84	82,78	-111.561,24
MOVZ7	7.976.852,10	210.554,16	200.433,59	0,18%	-177.726,35	183.495,61	131.502,04	-175.511,30
MRFQ3	127.812,30	39.478,60	28.983,88	0,03%	-2.219.467,19	2.291.514,33	1.642.212,61	-2.191.805,38
MRV3	112.327,02	13.742,63	9.914,04	0,01%	-263.822,03	253.283,28	204.739,57	-271.491,23
MTR19	5.787.179,21	124.604,82	120.336,96	0,11%	-146.882,98	173.644,04	135.169,51	-176.914,28
MULP16	3.179.415,43	2.293,35	-1.728,15	0,00%	-1.284.439,37	1.520.525,75	1.183.620,95	-1.549.161,79
MULT3	5.261.443,98	794.365,43	670.686,92	0,60%	-205.895,30	257.482,51	199.740,97	-259.604,72
MVLV16	6.436.132,92	167.994,86	161.967,91	0,15%	-251.843,02	331.775,83	265.822,56	-341.061,62
NEWL11	930.787,35	76.185,19	65.779,71	0,06%	-44.539,07	59.022,46	48.262,48	-60.814,15
NEWL11	535.060,90	29.300,35	12.630,16	0,01%	-1.298.387,88	1.720.603,12	1.408.931,45	-1.172.833,25
NINJ3	326.046,00	43.822,64	15.553,27	0,01%	-16.247,14	23.275,53	19.153,74	-23.675,46
NTCO3	3.241.652,70	939.447,85	724.932,36	0,65%	-64.328,44	97.339,49	80.534,41	-97.075,99
NTEN11	9.790.493,86	201.021,21	194.619,46	0,17%	-14.790.984,10	22.393.809,90	18.517.209,00	-22.320.600,44
NTNB2020815 - 760199 - NEGOCIAÇAO	158.941.189,76	591.352,90	157.536,36	0,14%	-42.425,21	60.860,61	66.936,47	-85.905,82
NTNB2020815 - 760199 - NEGOCIAÇAO	9.681.175,59	75.622,75	54.415,81	0,05%	-2.155.200,87	3.546.277,37	2.892.372,66	-3.342.986,39
NTNB2020815 - 760199 - NEGOCIAÇAO	10.768.736,88	132.083,92	115.212,48	0,10%	-64.739,16	124.806,30	95.896,93	-107.319,37
NTNB2020815 - 760199 - NEGOCIAÇAO	4.693.571,88	83.403,77	78.634,24	0,07%	-17.003.741,41	32.780.374,28	25.187.329,61	-28.187.433,16
NTNB2020815 - 760199 - NEGOCIAÇAO	5.784.964,36	115.899,21	111.076,22	0,10%	-110.819,85	217.887,68	167.243,33	-181.607,79
NTNB2020815 - 760199 - NEGOCIAÇAO	6.123.175,58	128.277,51	124.942,53	0,11%	-58.141.375,26	114.478.891,88	87.902.459,14	-95.432.366,69
NTNB2030815 - 760199 - NEGOCIAÇAO	862.084,38	19.960,49	19.203,24	0,02%	-71.453,72	155.342,56	114.428,95	-121.480,82
NTNB2030815 - 760199 - NEGOCIAÇAO	279.444,63	7.192,18	6.683,33	0,01%	-18.345.042,64	39.882.679,00	29.378.511,12	-31.189.008,94
NTNB2030815 - 760199 - NEGOCIAÇAO	947.021,30	26.790,53	24.581,42	0,02%	-14.988,57	31.846,20	24.939,68	-24.467,36
NTNB2040815 - 760199 - NEGOCIAÇAO	533.552,79	16.505,22	14.918,22	0,01%	-11.594,59	10.145,59	18.130,45	-22.763,40
NTNB2040815 - 760199 - NEGOCIAÇAO	773.113,76	26.380,84	23.659,32	0,02%	-13.416,62	11.247,93	20.285,39	-27.254,37
NTNB2050815 - 760199 - NEGOCIAÇAO	1.237.684,11	44.970,65	40.279,10	0,04%	-404.673,06	297.920,26	280.010,54	-369.040,31
NTNB2050815 - 760199 - NEGOCIAÇAO	782.917,07	30.159,31	26.778,84	0,02%	405.966,75	-405.966,75	170.042,07	-171.433,96
NTNB2060815 - 760199 - NEGOCIAÇAO	1.551.571,17	6.062,47	5.234,39	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
NTSD35	1.925.425,24	5.818,83	5.057,44	0,00%	-1.907,55	1.620,71	3.095,78	-4.396,32
OMGE13	5.180.859,00	6.884,63	5.952,21	0,01%	-360.805,94	291.072,91	275.778,43	-356.469,48
ONCO3	1.159.905,00	335.286,68	150.531,21	0,13%	-4.928.527,80	-4.928.527,80	1.445.044,35	-1.456.872,82
OUTRAS DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	30.686,33	-27.278,29	24.992,98	-25.197,56
OVSIA10	1.525.847,50	963,64	796,63	0,00%	-558.126,61			



Data: 31/01/2023

Relatório de Risco de Mercado

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

Dados Gerais					
PL:	4.146.330.363,36	VAR / PL:	2,6924%	Limite Fundo:	0,00%
VAR:	111.636.050,45	ETL / PL:	3,3764%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	139.996.111,06	VAR / CDI:	0,0303%	Benchmark:	
				Datation DC:	1,718,68
				Datation DU:	1,814,8

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	204.971.568,77	Cenário Baixa - 10000 (+):	266.803.707,49	CENARIO BRADESCO 1 (+):	353.328.319,73
Cenário Alta - 09999 (-):	(166.748.256,40)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(201.414.127,29)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(40.059.831,68)
Cenário Alta - 09999:	38.223.312,37	Cenário Baixa - 10000:	65.389.580,19	CENARIO BRADESCO 1:	313.268.488,05
				CENARIO BRADESCO 2 (+):	49.911.721,00
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	(386.261.476,51)
				CENARIO BRADESCO 2:	(336.349.755,51)

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
RADL3	6.219.617,04	509.831,40	395.271,02	0,35%	72.422,44	-72.422,44	30.534,66	-30.534,66
RAHD11	14.601.178,99	470.628,75	432.828,61	0,39%	0,00	0,00	0,00	0,00
RAIL3	9.466.196,26	971.972,33	839.965,77	0,75%	2.631.304,11	-2.631.304,11	385.749,18	-388.906,75
RAI2	206.821,26	22.166,16	13.792,96	0,01%	0,00	0,00	0,00	0,00
RBCAPMZ	705.622,26	6.215,84	-1.174,24	0,00%	-3.100,67	2.528,16	4.798,25	-5.774,98
RBRL11	2.631.304,11	189.084,94	-28.339,46	-0,33%	-28.233,68	5.444,70	6.058,80	-8.211,62
RCRB11	5.154.234,58	424.540,32	347.251,12	0,31%	1.216.337,43	-1.216.337,43	594.383,56	-599.248,91
RDCO10	2.201.907,82	1.505,08	1.253,61	0,00%	-6.169,69	5.308,46	9.473,75	-12.095,74
RDDR3	4.054.458,10	567.888,62	400.527,42	0,36%	-253.561,57	211.856,97	218.238,98	-269.324,15
RDDRB9	1.163.223,04	3.102,00	2.698,09	0,00%	1.788.350,14	-1.788.350,14	438.953,55	-440.530,25
RDE11	3.632.907,68	107.017,18	100.490,82	0,09%	5.950.928,29	-4.688.640,62	2.643.654,81	-2.665.294,55
REC13	2.980.583,56	444.889,15	305.333,40	0,27%	0,00	0,00	0,00	0,00
RENT3	18.033.116,02	3.606.244,27	2.876.377,67	2,58%	-744,66	602,55	1.225,46	-1.772,09
RENT9	31.705,77	70.180,96	-14.558,41	-0,01%	-688.221,15	501.274,13	540.778,91	-642.326,29
RLOG11	1.600.009,35	312,20	244,80	0,00%	62.926,34	-62.926,34	18.450,00	-18.601,03
RMSA12	5.558.654,08	247.228,02	218.853,92	0,20%	1.634.618,36	-1.634.618,36	399.391,75	-402.660,99
RNGO11	125.852,68	4.915,35	1.584,20	0,00%	-535,84	434,62	855,94	-1.227,25
RRRP3	2.274.363,93	996.418,13	855.763,45	0,77%	-289.756,27	237.651,02	230.212,23	-295.518,74
RSAN24	1.103.080,71	239,69	193,28	0,00%	107.674,77	-107.676,63	78.926,97	-79.573,03
RSAN44	6.004.693,26	129.503,96	125.308,43	0,11%	-280,49	232,05	526,23	-777,18
SANB11	538.383,15	70.437,74	61.291,24	0,05%	1.069.075,54	-1.069.075,54	626.905,89	-632.037,46
SBCF11	1.677.351,06	73,31	47,46	0,00%	-327.281,76	267.206,52	212.301,35	-263.195,51
SBBP3	4.276.302,14	463.873,89	-749,18	0,00%	78.258,15	-78.258,15	38.242,15	-38.555,18
SLCE3	260.860,50	22.261,25	12.012,71	0,01%	56.422,56	-56.422,56	27.571,82	-27.797,52
SMT03	188.075,20	21.016,43	3.713,11	0,00%	-1.232,03	1.001,05	2.026,98	-2.926,23
SNGO18	2.415.227,42	520,96	412,21	0,00%	1.148.389,20	-1.148.389,20	581.179,52	-565.773,08
SOMA3	3.827.964,00	738.563,76	610.868,72	0,55%	840.562,10	-840.562,10	352.075,44	-354.957,37
STBP3	2.401.606,00	473.103,31	385.892,07	0,35%	4.076.655,01	-3.261.324,01	2.390.550,50	-2.410.118,44
SUZB3	16.306.620,04	2.129.582,17	-1.849.979,08	-0,14%	105.880,42	-105.880,42	62.088,28	-62.596,50
TAE11	423.521,68	60.208,13	46.218,76	0,04%	-144.311,93	98.575,06	81.621,11	-109.176,08
TCH11	10.853.437,03	376.583,12	344.004,63	0,31%	-904.278,85	757.274,44	602.391,61	-668.416,57
TEND3	401.620,00	133.692,77	85.810,93	0,09%	140.532,00	-140.532,00	58.862,83	-59.344,66
TEPP11	8.169.588,83	954.420,12	665.345,57	0,60%	4.084.782,57	-4.084.794,42	1.197.661,72	-1.207.465,23
TIMS3	2.830.378,14	248.206,48	-75.149,73	-0,07%	905.721,01	-650.986,97	414.933,44	-418.329,89
TNHL11	2.492.840,79	82.906,68	76.139,50	0,07%	-198.478,33	166.497,29	175.289,65	-212.206,93
TOTS3	4.117.394,89	665.671,72	534.302,76	0,48%	623.465,29	-623.478,98	603.610,09	-608.550,97
TRXF11	15.685.940,00	502.549,24	401.762,12	0,36%	7.842.970,00	-7.842.970,00	2.299.558,80	-2.318.381,93
UGEL11	890.324,21	620,32	521,40	0,00%	-1.252,03	1.024,16	1.924,97	-2.701,36
UGPA3	5.397.875,60	599.189,57	332.278,78	0,30%	1.349.468,90	-1.079.575,12	791.328,56	-797.806,01
UHSM12	1.795.234,16	65.852,75	59.845,84	0,05%	-159.040,46	133.917,13	143.153,31	-172.472,08
UNEG11	6.620.832,34	240.488,02	216.036,87	0,19%	-582.236,83	488.556,44	522.288,28	-630.092,24
USIM5	230.079,69	45.110,80	22.380,56	0,02%	89.731,08	-50.617,53	33.729,68	-34.005,78
UTPS11	3.859.681,23	60.508,24	58.263,14	0,05%	-134.400,61	105.063,35	98.149,88	-128.116,52
UTPS21	4.801.214,49	127.297,92	117.283,61	0,11%	-306.729,71	259.162,01	289.662,45	-331.899,34
UTPS22	2.537.996,12	84.118,93	71.130,27	0,07%	-202.592,75	171.542,46	179.112,48	-220.010,81
VALE3	56.789.168,80	3.455.228,63	-533.458,18	-0,48%	14.197.292,20	-14.197.292,20	8.325.292,15	-8.383.439,15
VAMO22	1.134.322,25	466,70	384,34	0,00%	-989,22	803,67	1.543,88	-2.193,17
VAMO33	7.174.068,68	192.841,58	183.837,69	0,16%	-459.640,70	383.709,22	383.955,35	-485.527,91
VAMO34	6.575.663,98	175.217,63	166.598,72	0,15%	-416.244,05	352.973,27	351.600,98	-443.710,38
VBBR3	8.322.686,26	1.111.573,69	912.697,47	0,82%	2.080.671,57	-2.080.671,57	1.220.165,81	-1.230.083,03
VCCS11	1.300.074,18	2.987,57	2.599,15	0,00%	-5.832,50	4.950,91	8.833,23	-11.600,04
VECS11	1.692.457,23	409,34	325,19	0,00%	-912,88	735,38	1.450,72	-2.088,10
VERDECS2	552.886,76	128.390,23	-33.706,95	-0,33%	0,00	0,00	0,00	0,00
VIB3	198.302,40	83.765,16	42.863,22	0,04%	89.236,08	-89.236,08	29.071,13	-29.309,10
VIMT13	6.553.811,87	190.012,63	176.916,80	0,16%	-462.340,56	381.357,29	396.899,13	-490.621,83
VIVT3	927.149,40	102.528,28	70.205,11	0,06%	139.070,19	-139.074,63	135.920,10	-137.032,68
VKL14	2.150.196,18	773,21	627,33	0,00%	-1.709,43	1.388,27	2.740,20	-3.925,10
VRDN12	4.580.662,77	123.767,74	117.911,96	0,10%	-295.423,54	246.204,13	250.621,53	-313.445,18
VVEO15	1.712.126,76	1.427,85	1.255,75	0,00%	-2.861,75	2.350,86	4.302,54	-5.960,97
VVEO16	1.088.450,04	1.026,10	879,59	0,00%	-1.987,04	1.641,38	2.996,76	-4.128,55
WDOH23	3.198,07	27.354,56	14.096,95	0,01%	-51.294,61	52.077,83	-66.422,31	66.770,61
WEGE3	8.048.372,80	893.668,66	-67.539,45	-0,85%	2.012.093,20	-2.012.093,20	1.179.891,45	-1.189.549,50
WING23	-67.225,60	474.195,04	-440.121,70	-0,35%	-1.054.115,70	1.053.804,31	-847.230,82	852.967,40
XPNR11	3.099.236,36	194.593,89	168.674,74	0,14%	1.549.618,18	-1.549.618,18	454.348,05	-458.067,13
XPPR11	2.960.200,20	460.133,98	314.394,93	0,28%	1.480.100,10	-1.480.100,10	433.965,35	-437.517,59
YDUQ3	2.315.583,13	320.786,42	222.799,10	0,20%	903.077,42	-578.895,78	339.464,49	-342.243,19
Total Var:	4.311.279.363,28	152.594.978,87	111.636.050,45	100,02%	38.223.312,37	65.389.580,20	313.268.488,05	-336.349.755,51



Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/01/2023

FUNDO: EMBRAERPREV RENDA FIXA
CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais

PL:	2.473.311.264,93	VAR / PL:	2,1890%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	2.533,95
VAR:	54.139.769,08	ETL / PL:	2,7450%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1.742,12
ETL:	67.893.454,62	VAR / CDI:	0,0246%	Benchmark:			

Cenários de STRESS

Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (+):	226.405.496,01	CENARIO BRADESCO 1 (+):	175.091.758,10	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
Cenário Alta - 09999 (-):	(124.100.359,20)	Cenário Baixa - 10000 (-):	-	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(195.095.559,84)
Cenário Alta - 09999:	(124.100.359,20)	Cenário Baixa - 10000:	226.405.496,01	CENARIO BRADESCO 1:	175.091.758,10	CENARIO BRADESCO 2:	(195.095.559,84)

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
CAIXA	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
FI RF EMB II	2.335.971.739,66	52.645.173,18	52.637.742,77	97,23%	-119.767.865,65	222.971.297,02	171.936.074,46	-190.979.373,80
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	144.505.086,45	1.743.094,45	1.502.026,31	2,77%	-4.332.493,96	3.434.198,89	3.155.683,84	-4.116.186,04
Total Var:	2.480.476.826,11	54.388.267,63	54.139.769,08	100,00%	-124.100.359,20	226.405.496,01	175.091.758,10	-195.095.559,84



Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/01/2023

FUNDO: EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL
CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais

PL:	574.712.119,95	VAR / PL:	9,9579%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	1,18
VAR:	51.539.349,10	ETL / PL:	11,2461%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1,12
ETL:	64.632.423,06	VAR / CDI:	0,1008%	Benchmark:			

Cenários de STRESS

Cenário Alta - 09999 (+):	140.976.936,51	Cenário Baixa - 10000 (+):	0,14	CENARIO BRADESCO 1 (+):	75.218.304,33	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
Cenário Alta - 09999 (-):	(0,14)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(138.315.062,98)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(75.837.078,59)
Cenário Alta - 09999:	140.976.936,37	Cenário Baixa - 10000:	(138.315.062,84)	CENARIO BRADESCO 1:	75.218.304,33	CENARIO BRADESCO 2:	(75.837.078,59)

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
CAIXA	7.000.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CONTAS A PAGAR_RECEBER	7.000.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
FIA RVA EMB II	239.148.155,89	20.476.547,55	20.396.503,65	39,57%	60.433.222,67	-59.971.526,14	34.053.827,76	-34.331.595,67
FIA RVA EMB III	102.189.007,97	10.843.747,49	10.687.936,78	20,74%	26.777.196,01	-26.358.394,78	13.024.761,60	-13.135.234,01
FIA RVA EMB IV	93.182.616,35	9.063.619,08	8.837.904,50	17,34%	28.957.522,04	-24.377.965,04	12.424.284,21	-12.526.541,98
FIC FIA EMB VIII ETF	25.499.322,74	2.047.238,63	2.023.085,67	3,93%	-0,14	0,14	0,66	-1,00
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	107.693.652,22	9.565.405,23	9.493.918,51	18,42%	27.808.995,80	-27.607.177,02	15.715.430,09	-15.843.705,93
Total Var:	581.711.755,17	51.996.557,97	51.539.349,10	100,00%	140.976.936,37	-138.315.062,84	75.218.304,33	-75.837.078,59



Relatório de Risco de Mercado



Data: 31/01/2023

FUNDO: FI RF EMB II CNPJ: 11005764000196

Dados Gerais table with columns: PL, VAR, ETL, VAR / PL, ETL / PL, VAR / CDI, Limite Fundo, Status, Benchmark, 0,00% ENQUADRADO, Dutation DC, Dutation DU, 2.634,55, 1.811,35

Canários de STRESS table with columns: Cenário Alta - 09999 (+), Cenário Baixa - 10000 (-), CENÁRIO BRADESCO 1 (+), CENÁRIO BRADESCO 2 (+), CENÁRIO BRADESCO 1 (-), CENÁRIO BRADESCO 2 (-)

Parâmetros do Cálculo table with columns: Modelo, Int. Confiância, Horizonte, VaR paramétrico, Modelo Volatilidade, Lâmbda, EWMA

Main portfolio table with columns: Produto, MM, VAR Tot., Comp. VAR, Comp. VAR (%), Cenário Alta - 09999, Cenário Baixa - 10000, CENÁRIO BRADESCO 1, CENÁRIO BRADESCO 2

Relatório de Risco de Mercado



Data: 31/01/2023

FUNDO: FI RF EMB V CREDITO PRIVADO CNPJ: 20726178000121

Dados Gerais table with columns: PL, VAR, ETL, VAR / PL, ETL / PL, VAR / CDI, Limite Fundo, Status, Benchmark, 0,00% ENQUADRADO, Dutation DC, Dutation DU, 905,89, 621,77

Canários de STRESS table with columns: Cenário Alta - 09999 (+), Cenário Baixa - 10000 (-), CENÁRIO BRADESCO 1 (+), CENÁRIO BRADESCO 2 (+), CENÁRIO BRADESCO 1 (-), CENÁRIO BRADESCO 2 (-)

Parâmetros do Cálculo table with columns: Modelo, Int. Confiância, Horizonte, VaR paramétrico, Modelo Volatilidade, Lâmbda, EWMA

Main portfolio table with columns: Produto, MM, VAR Tot., Comp. VAR, Comp. VAR (%), Cenário Alta - 09999, Cenário Baixa - 10000, CENÁRIO BRADESCO 1, CENÁRIO BRADESCO 2



Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/01/2023

FUNDO: FIM EMB I A
CNPJ: 20725946000122

Dados Gerais							
PL:	372.298.287,19	VAR / PL:	0,4689%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	97,91
VAR:	1.745.665,52	ETL / PL:	0,5880%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	66,36
ETL:	2.189.134,98	VAR / CDI:	0,0053%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	10.855.393,50	Cenário Baixa - 10000 (-):	13.307.658,27	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	35.461.660,30	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	40.912.380,43
Cenário Alta - 09999 (-):	(13.169.084,50)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(10.350.358,24)	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	(31.645.087,11)	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(41.715.249,81)
Cenário Alta - 09999:	(2.313.691,00)	Cenário Baixa - 10000:	2.957.300,03	CENÁRIO BRADESCO 1:	3.816.573,19	CENÁRIO BRADESCO 2:	(802.869,38)

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
ANHB10	747.247,40	140,76	131,25	0,01%	-300,40	245,06	475,29	-675,92
BCBF14	273.988,30	59,59	54,17	0,00%	-140,20	113,67	231,67	-334,70
CAIXA	9.000,01	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CBAN22	2.204.063,34	11.421,00	10.571,70	0,61%	-23.453,30	22.859,93	37.763,14	-39.974,80
CGBP13	2.284.967,71	2.930,11	2.800,96	0,16%	-5.750,28	4.825,26	8.731,88	-11.729,56
COMPROMISSADA PRE	176.378.953,46	0,00	0,00	0,00%	-4.909,49	5.006,34	22.914,71	-34.875,52
CONTAS_A PAGAR_RECEBER	-38.503,08	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
DHF24	-1.724,19	49.912,90	-40.508,79	-2,32%	161.049,43	-128.321,79	-273.709,32	401.515,31
DHF26	28.540,44	560.762,30	538.297,70	30,84%	-994.571,59	821.807,91	1.437.320,37	-1.955.553,73
DHF27	63.889,65	1.095.064,35	1.057.024,96	60,55%	-2.014.160,59	1.709.459,79	2.978.356,19	-3.899.074,90
DHF31	11.826,14	114.152,57	107.009,45	6,13%	-245.485,05	224.807,24	405.533,39	-453.462,13
DH1223	1,30	12,78	-0,04	0,00%	-2.873,89	2.930,58	13.413,66	-20.415,21
DH123	-597,00	2.951,99	-657,24	-0,04%	91.938,96	-93.635,82	-343.085,58	518.667,97
ELET13	2.115.443,91	1.235,24	1.158,22	0,07%	-2.493,35	2.026,04	3.832,43	-5.423,28
EQLT13	1.490.295,38	95,00	80,42	0,00%	-292,68	238,51	525,42	-771,31
ETEN13	1.364.377,42	18,95	14,39	0,00%	-107,53	92,64	231,46	-344,83
GRRB14	1.056.973,40	248,02	231,53	0,01%	-510,04	413,60	784,87	-1.112,64
IDIF24C382600	65.363.056,00	713.870,99	-579.370,17	-33,19%	2.342.374,16	-1.810.934,42	-3.804.708,80	5.988.107,33
IDIF24C382700	-63.144.892,00	719.568,73	583.994,39	33,45%	-2.362.222,07	1.824.668,50	3.831.829,79	-6.043.149,89
IDUJ23P348000	2.459,97	2.097,95	467,09	0,03%	-2.459,97	1.072.777,19	4.409.479,54	-2.459,97
IDUJ23P348100	-52.678.626,16	132.338,68	-29.464,06	-1,69%	4.020.987,18	-4.301.962,15	-16.771.382,53	20.067.995,84
IDUJ23P348200	138.929.939,87	91.706,30	20.417,62	1,17%	-2.838.820,88	2.926.843,43	10.898.864,05	-15.559.292,42
IDIN23C359100	-6.342.624,00	78.880,46	56.581,65	3,24%	-634.372,47	543.266,62	1.339.348,25	-2.421.482,38
IDIN23C359200	5.616.864,00	78.875,16	-56.577,85	-3,24%	636.814,66	-541.181,18	-1.325.707,70	2.452.015,53
IDIN23P358900	1.773.928,00	117.575,50	84.337,95	4,83%	-767.268,70	958.559,38	2.947.300,48	-1.630.614,80
IDIN23P359000	88.946,00	3.265,06	2.342,05	0,13%	-23.155,79	25.054,65	72.351,95	-62.657,72
IDIN23P359100	-37.544.767,97	465.059,57	-333.591,36	-19,11%	3.516.738,09	-3.387.526,50	-9.126.493,18	11.484.078,44
IDIN23P359200	49.554.164,00	349.286,47	250.546,28	14,35%	-2.677.363,90	2.514.401,95	6.656.060,93	-9.074.539,35
IVIA35	1.325.318,35	139,03	124,22	0,01%	-357,62	292,05	610,35	-887,61
LF0021006S0	1.116.403,17	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002100HDP	1.326.762,07	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002100HDQ	2.365.133,25	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002100ISJ	2.534.587,51	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF00220018H	1.131.232,17	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFSC1900089	3.299.060,11	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20230301 - 210100	17.860.915,23	245,05	-37,30	0,00%	-2.871,34	3.053,39	56,86	-86,56
LFT20230901 - 210100	2.551.418,42	223,17	-14,27	0,00%	-3.541,08	4.050,54	44,18	-67,26
MOV133	782.665,55	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
NTNB20230515 - 760199 - NEGOCIACAO	145.026.734,23	457.462,12	93.790,41	5,37%	-555.626,73	632.513,04	275.784,90	-373.417,28
NTNB20500815 - 760199 - NEGOCIACAO	23.426,20	851,18	719,19	0,04%	-2.093,75	4.122,54	3.165,49	-3.437,37
OMGE13	1.090.536,84	1.449,17	1.398,03	0,09%	-2.824,11	2.367,62	4.269,94	-5.736,87
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PRLG14	2.261.129,42	17,24	13,74	0,00%	-68,47	57,15	131,41	-194,32
VAMO22	1.134.322,25	466,70	434,58	0,02%	-989,22	803,67	1.543,88	-2.193,17
WDOH23	-5.330,12	45.590,94	-26.643,38	-1,53%	85.491,02	-86.796,38	110.703,85	-111.284,36
Total Var:	473.431.525,92	5.097.974,99	1.745.665,52	99,98%	-2.313.691,00	2.957.300,03	3.816.573,19	-802.869,38



Data: 31/01/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIM EMB II A
CNPJ: 20725957000102

Dados Gerais									
PL:	179.427.895,60	VAR / PL:	0,6173%	Limite Fundo:	0,00%	Duration DC:	554,49		
VAR:	1.107.645,66	ETL / PL:	0,7741%	Status:	ENQUADRADO	Duration DU:	380,44		
ETL:	1.389.032,35	VAR / CDI:	0,0069%	Benchmark:					

Cenários de STRESS									
Cenário Alta - 09999 (+):	3.017.756,98	Cenário Baixa - 10000 (+):	4.577.249,70	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	5.249.521,14	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	3.334.277,55		
Cenário Alta - 09999 (-):	(4.212.571,12)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(2.813.451,10)	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	(2.697.765,98)	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(6.422.810,09)		
Cenário Alta - 09999:	(1.194.814,14)	Cenário Baixa - 10000:	1.763.798,60	CENÁRIO BRADESCO 1:	2.551.755,15	CENÁRIO BRADESCO 2:	(3.088.532,55)		

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	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
AEGP13	648.002,50	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CAIXA	8.999,99	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	48.578.403,86	0,00	0,00	0,00%	-1.352,18	1.378,85	6.311,18	-9.605,44
CONTAS A PAGAR RECEBER	-33.125,51	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPGT14	143.565,07	35,83	-22,97	0,00%	268,36	-234,30	-573,13	876,66
CPGT16	288.623,21	177,33	-145,04	-0,01%	432,77	-348,18	-717,06	1.064,31
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DHF24	117,18	3.392,14	2.468,98	0,22%	-10.945,11	8.720,90	18.601,60	-27.287,45
DHF25	-2.240,37	41.631,73	-36.606,51	-3,30%	75.911,20	-60.949,03	-110.903,55	156.757,89
DHF26	2.618,39	51.446,08	46.863,92	4,23%	-91.245,10	75.395,22	131.864,25	-179.408,60
DHF27	4.110,86	70.459,90	64.712,13	5,84%	-129.597,46	109.992,05	191.636,86	-250.878,81
DHF29	3.215,03	36.899,50	33.047,07	2,98%	-75.507,41	66.794,57	118.007,30	-142.764,53
DHF31	1.556,07	15.020,08	13.003,23	1,17%	-32.300,66	29.579,90	53.359,66	-59.666,07
DHF33	1.560,68	14.171,26	11.925,90	1,08%	-31.050,94	29.579,29	54.092,52	-55.947,90
DHJ23	2,80	13,84	1,84	0,00%	-430,96	438,92	1.608,21	-2.431,26
DHJ24	292,96	7.315,34	5.756,57	0,52%	-18.214,94	14.421,23	29.227,64	-42.475,80
DHN23	-82,45	1.745,44	-1.098,53	-0,10%	13.592,32	-12.388,82	-32.086,20	48.022,09
DHN24	659,68	12.822,40	10.561,48	0,95%	-26.944,37	21.331,24	41.813,37	-60.206,10
DHN25	-18.892,97	394.666,03	-355.151,23	-32,06%	705.040,93	-573.923,77	-1.017.902,24	1.412.855,77
DHN26	-10.917,16	191.275,60	-175.145,59	-15,81%	345.053,96	-290.131,99	-505.333,48	674.628,55
DHV23	11,35	226,02	155,31	0,01%	-1.054,74	879,19	2.016,42	-2.986,61
DH V24	507,19	9.019,28	7.721,55	0,70%	-17.283,00	13.830,72	26.017,06	-37.108,99
ERDV18	1.394.194,03	21,71	14,80	0,00%	-110,30	94,41	231,45	-343,99
INDG23	119.483,00	842.807,59	796.741,58	71,93%	1.873.525,95	-1.872.439,30	1.505.820,41	-1.516.016,28
LFSC18002GT	423.037,05	0,00	0,00	0,00%	1.921,69	-1.485,80	-2.999,22	4.805,75
LFSC1900089	3.299.060,11	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFSC19000HY	411.327,82	0,00	0,00	0,00%	2.009,81	-1.550,11	-2.894,12	4.444,14
LFT20230901 - 210100	14.887.526,46	1.302,18	-295,44	-0,03%	-20.662,20	23.634,89	257,78	-392,45
LFT20240301 - 210100	7.883.810,44	1.103,33	-17,74	0,00%	-24.936,41	31.158,89	155,05	-236,06
LFT20240901 - 210100	16.583.330,19	2.819,48	543,35	0,05%	-78.664,50	101.788,03	514,77	-783,69
LFT20250901 - 210100	9.021.098,88	1.612,99	-77,62	-0,01%	-60.072,80	102.752,49	2.950,01	-4.489,45
LFT20260901 - 210100	1.690.809,50	639,66	-12,25	0,00%	-12.675,80	29.871,57	1.533,01	-2.331,29
LTN20230701 - 100000	4.592.527,06	3.655,54	1.861,84	0,17%	-26.451,74	23.847,75	62.085,21	-92.921,28
LTN20240101 - 100000	2.228.807,01	11.865,79	8.083,54	0,73%	-39.025,72	31.210,01	66.449,24	-97.476,18
LTN20250701 - 100000	14.828.918,54	427.684,19	383.774,98	34,65%	-753.161,78	669.486,61	1.138.454,24	-1.579.121,13
LTN20260701 - 100000	4.561.294,02	183.669,36	167.027,46	15,00%	-320.887,65	314.498,29	509.554,63	-679.105,08
NTNB20230515 - 760199 - NEGOCIACAO	13.828.615,29	43.620,01	13.067,52	1,18%	-52.980,22	60.311,50	26.296,69	-35.606,15
NTNB20240815 - 760199 - NEGOCIACAO	9.578.446,65	74.820,30	59.514,89	5,37%	-175.840,46	181.548,50	130.106,64	-173.648,91
NTNB20250515 - 760199 - NEGOCIACAO	10.198.962,44	125.095,35	116.923,58	10,56%	-249.863,20	239.882,34	193.906,79	-257.126,61
NTNB20260815 - 760199 - NEGOCIACAO	3.209.877,09	57.038,83	55.711,21	5,03%	-100.314,72	118.753,06	92.440,80	-120.989,54
NTNB20270515 - 760199 - NEGOCIACAO	5.119.322,56	102.579,33	100.473,19	9,07%	-182.232,49	227.890,97	176.785,45	-229.769,28
NTNB20280815 - 760199 - NEGOCIACAO	1.488.020,23	31.170,24	30.412,88	2,75%	-61.195,50	80.618,43	64.592,40	-82.874,79
NTNB20300815 - 760199 - NEGOCIACAO	862.084,38	19.960,49	18.791,77	1,70%	-44.539,07	59.022,48	48.262,48	-60.814,15
NTNB20320815 - 760199 - NEGOCIACAO	279.444,63	7.192,18	6.422,52	0,58%	-16.247,14	23.275,53	19.153,74	-23.675,46
NTNB20350515 - 760199 - NEGOCIACAO	947.021,30	26.780,53	23.225,21	2,10%	-64.328,44	97.394,39	80.534,41	-97.075,99
NTNB20400815 - 760199 - NEGOCIACAO	533.552,79	16.505,22	13.792,71	1,25%	-42.425,21	69.808,61	56.936,47	-65.906,82
NTNB20450515 - 760199 - NEGOCIACAO	773.113,76	26.380,84	21.713,28	1,96%	-64.739,16	124.806,30	95.896,93	-107.319,37
NTNB20500815 - 760199 - NEGOCIACAO	1.214.257,91	44.119,48	36.248,96	3,27%	-108.526,10	213.685,14	164.077,84	-178.170,42
NTNB20550515 - 760199 - NEGOCIACAO	782.917,07	30.159,31	24.468,70	2,21%	-71.453,72	155.342,56	114.428,95	-121.480,82
NTNB20600815 - 760199 - NEGOCIACAO	155.457,17	6.062,47	4.803,48	0,43%	-14.588,57	31.846,20	23.539,68	-24.467,36
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
WDOH23	8.528,20	72.945,50	44.639,76	4,03%	-136.785,64	138.874,20	-177.126,17	178.054,97
WING23	-67.225,60	474.195,04	-448.276,58	-40,47%	-1.054.115,70	1.053.504,31	-847.230,82	852.967,40
Total Var:	180.454.608,24	3.486.124,75	1.107.645,66	100,01%	-1.194.814,14	1.763.798,61	2.551.755,15	-3.088.532,55



Data: 31/01/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIM EMB VI A CRED PRIV
CNPJ: 41837660000109

Dados Gerais							
PL:	231.030.818,04	VAR / PL:	1,0060%	Limite Fundo:	0,00%	Dutação DC:	725,78
VAR:	2.324.188,51	ETL / PL:	1,2616%	Status:	ENQUADRADO	Dutação DU:	498,55
ETL:	2.914.626,15	VAR / CD:	0,0113%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	1.466.692,91	Cenário Baixa - 10000 (+):	5.719.105,17	CENARIO BRADESCO 1 (+):	32.632.145,40	CENARIO BRADESCO 2 (+):	4.666.739,43
Cenário Alta - 09999 (-):	(5.223.202,06)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(1.257.236,30)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(4.691.194,63)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(33.458.819,33)
Cenário Alta - 09999:	(3.756.509,15)	Cenário Baixa - 10000:	4.461.868,88	CENARIO BRADESCO 1:	27.940.950,77	CENARIO BRADESCO 2:	(28.792.079,90)

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
ABSPA1	1.981.190,42	4.346,79	3.640,39	0,16%	-3.428,41	7.094,45	12.714,80	-16.938,27
ALSCA0	1.591.523,01	310,17	-206,92	-0,01%	1.565,05	-1.307,71	-3.021,99	4.572,27
AMBP13	2.576.007,13	2.895,52	2.411,63	0,10%	-5.761,25	4.741,04	8.760,43	-12.144,88
APRB28	1.322.783,87	356,36	296,13	0,01%	-716,30	587,38	1.097,89	-1.535,15
BCBF15	2.623.414,93	664,02	534,22	0,02%	-1.545,21	1.258,64	2.546,58	-3.672,37
BKBR18	1.478.492,53	106,59	79,69	0,00%	-321,15	261,94	572,79	-840,09
BRELETRO	3.434.269,79	32.084,62	-1.269,90	-0,05%	0,00	0,00	0,00	0,00
BRKPA0	2.466.759,46	3.294,03	2.757,42	0,12%	-6.364,12	5.246,44	9.590,39	-13.255,58
CAIXA	10.001,40	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CART13	880.908,62	24.407,97	21.971,19	0,95%	-58.469,13	48.522,29	49.584,30	-61.932,64
CBAN22	4.584.899,27	23.757,99	18.445,23	0,79%	-48.787,63	47.553,30	78.554,99	-83.155,70
CCPRA3	42.910,95	0,66	0,44	0,00%	-3,61	3,10	7,74	-11,52
CEAB11	1.724.327,93	289,96	227,93	0,01%	-743,01	606,48	1.264,79	-1.838,93
CEAB22	553.421,42	632,85	528,50	0,02%	-1.249,17	1.033,19	1.899,30	-2.616,74
CELGI2	3.284.253,33	1.376,97	1.130,28	0,05%	-2.838,24	2.295,56	4.355,00	-6.207,80
COMPROMISSADA PRE	91.640.538,90	0,00	0,00	0,00%	-2.550,80	2.601,12	11.305,68	-18.120,10
CONTAS_A PAGAR RECEBER	-68.182,55	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CSAN23	1.175.253,01	3.267,04	2.711,78	0,12%	-6.497,19	5.589,26	9.973,53	-12.736,80
CSMG7	2.128.957,53	2.266,94	1.896,94	0,08%	-4.415,74	3.703,17	6.675,55	-8.954,16
DAPK23	53.038,15	174.403,34	46.097,03	1,98%	235.396,47	73.436,16	6.318.324,53	-6.369.884,54
DAPK25	-53.257,76	523.266,93	506.526,45	21,79%	-585.446,16	771.026,79	5.932.448,75	-5.962.380,39
DAPK27	-48,32	49.296,12	46.617,91	2,01%	-74.763,58	81.521,17	385.210,39	-384.601,53
DAPK29	6,87	19.909,26	-16.541,73	-0,71%	50.712,53	-51.758,63	-130.803,66	124.215,79
DAPQ24	-51.341,56	582.338,79	536.502,48	23,08%	-739.288,38	1.192.997,67	11.479.890,41	-11.555.068,27
DAPQ26	-11.387,50	689.800,93	660.500,95	28,42%	-959.321,90	1.082.809,22	5.861.017,18	-5.867.526,83
DAPQ28	8.893,24	444.046,38	-414.666,81	-17,84%	798.101,87	-824.010,70	-3.347.917,04	3.322.838,51
DAPQ30	-3.516,78	164.083,24	-148.287,92	-6,38%	342.389,26	-349.509,84	-1.151.935,51	1.131.380,50
DASAA2	2.675.929,96	112,82	85,14	0,00%	-335,95	277,71	613,52	-900,26
DESPEFAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DIF125	487,04	9.950,33	7.492,60	0,22%	-16.042,43	13.249,29	24.109,47	-34.807,80
DIF26	-392,76	7.716,91	-6.525,08	-0,28%	13.686,77	-11.309,28	-19.779,64	26.911,29
DIF27	171,29	2.935,83	2.483,96	0,11%	-5.399,89	4.583,00	7.984,87	-10.453,28
DIF29	1.071,68	12.299,83	10.853,28	0,43%	-25.169,14	22.264,86	39.335,77	-47.588,18
DIF25	318,42	6.651,67	5.587,87	0,24%	-11.882,71	9.672,87	17.155,66	-23.812,18
ELEK27	561.281,69	15,77	-7,75	0,00%	208,92	-206,10	-604,59	921,40
ERDVA0	2.046.296,08	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ETEN13	2.136.157,37	28,67	19,53	0,00%	-168,96	145,84	362,39	-539,89
GBSP11	2.423.627,70	94.077,43	77.176,96	3,32%	-224.867,61	193.591,61	206.407,30	-243.577,83
GGSH12	2.491.347,46	1.031,10	836,91	0,04%	-2.304,28	1.873,68	3.710,57	-5.320,93
GUAR15	2.713.966,62	2.327,14	1.932,37	0,08%	-4.678,40	3.832,05	7.175,85	-10.052,41
HARG11	3.271.631,43	96.480,48	84.584,15	3,64%	-232.505,39	194.379,61	202.060,31	-248.698,18
HZTC14	2.251.079,88	60.649,00	54.730,68	2,35%	-144.674,73	120.979,43	122.974,27	-153.556,67
IGTA37	2.189.434,00	2.889,32	-2.341,52	-0,10%	5.630,04	-4.521,16	-8.381,08	12.226,12
INSNS13	1.913.116,70	39.896,72	23.067,71	0,99%	0,00	0,00	0,00	0,00
ISML85	1.221.049,78	79.346,66	72.741,64	3,01%	-188.049,35	158.841,54	158.206,91	-198.009,79
LCAM9	1.901.988,90	831,46	672,44	0,03%	-1.827,18	1.476,34	2.884,40	-4.133,04
LCAMD1	4.644.837,79	125.337,35	113.680,10	4,89%	-297.490,94	252.122,24	251.485,82	-317.339,45
LF0021003Q1	2.125.513,44	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002100E1F	1.160.963,67	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002200I09	2.159.410,98	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFSC190054B	806.142,95	0,00	0,00	0,00%	3.876,88	-2.979,37	-5.806,99	8.918,88
LFSC190095S	1.221.049,78	0,00	0,00	0,00%	5.891,74	-4.527,42	-8.919,84	13.540,63
LFSC19005L1	807.810,98	0,00	0,00	0,00%	3.961,60	-3.044,26	-5.914,87	9.085,95
LFSC22002X	4.839.706,55	7.528,53	6.309,46	0,27%	-14.563,88	12.052,02	21.916,37	-30.167,39
LFNS210029N	3.509.767,39	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20240901 - 210100	1.071.538,26	182,18	33,97	0,00%	-5.082,94	6.577,07	33,26	-50,64
LIGHB4	2.132.645,42	49,30	33,01	0,00%	-250,47	214,38	525,55	-781,10
LIGHD3	1.681.750,21	2.711,81	2.275,22	0,10%	-5.232,77	4.380,26	7.878,68	-10.618,28
LIREN11	1.222.350,42	129,64	92,33	0,00%	-329,97	268,73	570,86	-833,43
MOVIZ	1.222.350,42	3.157,93	2.644,94	0,11%	-6.127,74	5.160,96	9.251,37	-12.316,13
MTRJ19	3.278.423,75	70.588,34	66.724,99	2,87%	-169.144,03	130.883,30	131.193,51	-167.561,29
MULP16	3.179.415,43	2.293,35	-1.777,86	-0,08%	5.271,79	-4.130,93	-8.209,62	12.122,11
NTEN11	3.335.521,76	68.485,88	65.845,10	2,83%	-153.682,42	123.472,49	119.352,51	-153.913,65
NTNB20230515 - 760199 - NEGOCIACAO	85.841,24	270,77	105,03	0,00%	-328,88	374,38	163,24	-221,03
NTNB20240815 - 760199 - NEGOCIACAO	102.728,94	802,45	719,16	0,03%	-1.885,89	1.947,11	1.395,40	-1.862,39
NTNB20250515 - 760199 - NEGOCIACAO	569.774,44	6.980,57	6.825,59	0,29%	-13.950,84	13.401,25	10.832,78	-14.364,62
NTNB20260815 - 760199 - NEGOCIACAO	1.483.694,79	26.364,94	25.460,45	1,10%	-46.366,26	54.890,98	42.728,72	-55.924,74
NTNB20270515 - 760199 - NEGOCIACAO	664.741,80	13.319,88	12.667,05	0,55%	-23.662,81	29.591,54	22.955,51	-29.835,44
NTNB20280815 - 760199 - NEGOCIACAO	4.635.555,35	97.107,27	90.596,02	3,90%	-190.647,52	251.157,40	201.230,16	-258.186,84
NTSD35	1.925.425,24	5.818,83	4.805,76	0,21%	-11.694,59	10.145,88	18.130,45	-22.768,40
OMGE13	4.090.322,16	5.435,46	4.551,06	0,20%	-10.592,51	8.880,31	16.015,45	-21.517,51
OUTRAS DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
OVSA10	1.525.847,50	964,64	792,01	0,03%	-1.997,55	1.620,71	3.096,78	-4.396,32
PASN12	1.990.692,32	34.692,31	33.541,01	1,44%	-79.808,90	64.384,22	61.001,14	-78.840,69
RAHD11	3.101.103,26	99.955,51	86.446,79	3,72%	-241.013,89	201.166,26	211.735,52	-257.438,10
RBCAPMZ	705.622,26	6.215,84	659,46	0,03%	0,00	0,00	0,00	0,00
RDCO10	2.201.907,82	1.505,08	1.241,70	0,05%	-3.100,67	2.528,16	4.798,25	-6.774,98
RDROR9	1.163.223,04	3.102,00	2.574,57	0,11%	-6.169,69	5.308,46	9.473,75	-12.095,74
RLOG11	1.600.009,35	312,20	248,22	0,01%	-744,66	602,55	1.225,46	-1.772,09
RSAN24	1.103.080,71	239,69	193,94	0,01%	-535,84	434,62	855,94	-1.227,25
RSAN44	808.712,90	174.441,61	16.876,84	0,72%	-80.021,72	32.006,87	31.005,02	-39.800,64
SBCF11	1.677.351,06	73,31	51,29	0,00%	-280,49	232,05	526,23	-777,18
SNGO18	2.415.227,42	520,96	416,72	0,02%	-1.232,03	1.001,05	2.026,98	-2.926,23



Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/01/2023

FUNDO: FIM EMB VI A CRED PRIV
CNPJ: 41837660000109

Dados Gerais					
PL:	231.030.818,04	VAR / PL:	1,0060%	Limite Fundo:	0,00%
VAR:	2.324.188,51	ETL / PL:	1,2616%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	2.914.626,15	VAR / CD:	0,0113%	Benchmark:	
				Dutation DC:	725,78
				Dutation DU:	498,55

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	1.466.692,91	Cenário Baixa - 10000 (+):	5.719.105,17	CENARIO BRADESCO 1 (+):	32.632.145,40
Cenário Alta - 09999 (-):	(5.223.202,06)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(1.257.236,30)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(4.691.194,63)
Cenário Alta - 09999:	(3.756.509,15)	Cenário Baixa - 10000:	4.461.868,88	CENARIO BRADESCO 1:	27.940.950,77
				CENARIO BRADESCO 2 (+):	4.666.739,43
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	(33.458.819,33)
				CENARIO BRADESCO 2:	(28.792.079,90)

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
UGEL11	890.324,21	620,32	514,37	0,02%	-1.252,03	1.024,16	1.924,97	-2.701,36
UNEG11	4.890.565,65	177.639,66	148.090,43	6,37%	-430.076,96	360.908,24	385.795,17	-465.425,99
VAMO33	1.369.805,99	36.820,88	33.578,33	1,44%	-87.763,11	73.264,87	73.311,86	-92.705,98
VCCS11	1.300.074,18	2.987,57	2.498,12	0,11%	-5.832,50	4.950,91	8.833,23	-11.600,04
VECS11	1.692.457,23	409,34	328,13	0,01%	-912,88	735,38	1.450,72	-2.088,10
VERDECS2	200.160,13	46.480,78	-11.899,08	-0,51%	0,00	0,00	0,00	0,00
VIXL14	2.150.196,18	773,21	628,22	0,03%	-1.709,43	1.388,27	2.740,20	-3.925,10
IVVEO15	1.712.126,76	1.472,85	1.230,22	0,05%	-2.861,75	2.350,86	4.302,54	-5.960,97
VVEO16	1.088.450,04	1.026,10	859,12	0,04%	-1.987,04	1.641,38	2.996,76	-4.128,55
Total Var:	238.662.544,05	4.033.163,72	2.324.188,51	99,97%	-3.756.509,15	4.461.868,88	27.940.950,77	-28.792.079,90



Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/01/2023

FUNDO: FIM EMB VII A CRED PRIV
CNPJ: 41687175000104

Dados Gerais				Limite Fundo:		0,00%		Duration DC:	
PL:	262.648.415,63	VAR / PL:	3,0677%	Status:	ENQUADRADO	Duration DU:		2.107,39	
VAR:	8.057.294,94	ETL / PL:	3,8470%	Benchmark:					
ETL:	10.104.172,92	VAR / CDI:	0,0345%						

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (-):	15.968.291,35	CENARIO BRADESCO 1 (+):	16.230.498,63	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-
Cenário Alta - 09999 (-):	(19.240.344,57)	Cenário Baixa - 10000 (+):	-	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (+):	(20.213.303,96)
Cenário Alta - 09999:	(19.240.344,57)	Cenário Baixa - 10000:	15.968.291,35	CENARIO BRADESCO 1:	16.230.498,63	CENARIO BRADESCO 2:	(20.213.303,96)

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
ANEM11	11.609.464,07	330.768,09	328.533,88	4,08%	-814.582,95	667.918,67	704.811,96	-860.127,96
ANET11	2.466.362,23	36.165,42	34.637,76	0,43%	-82.622,14	62.961,03	59.740,99	-77.824,78
BRKP28	4.903.238,22	159.137,74	157.937,99	1,96%	-380.388,37	327.458,86	337.715,32	-417.389,91
BRST11	6.405.171,21	119.012,61	112.525,20	1,40%	-244.675,58	193.799,31	181.321,12	-236.909,82
BTOH15	7.612.795,20	210.777,24	210.669,87	2,61%	-501.569,84	428.094,07	425.747,48	-536.491,95
CAEC21	8.255.694,06	182.093,61	176.190,39	2,19%	-397.708,67	319.547,79	309.529,53	-400.083,46
CAIXA	999,41	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CART13	5.182.488,40	143.594,93	143.537,62	1,78%	-343.980,72	285.462,29	291.710,24	-364.356,97
CBAN32	8.933.438,73	255.470,94	255.301,05	3,17%	-608.704,47	515.184,94	522.194,22	-653.465,86
CBAN72	2.173.048,53	64.321,05	64.241,54	0,80%	-153.422,93	130.289,30	132.569,25	-165.490,09
CJEN13	4.308.068,18	117.414,34	117.379,75	1,46%	-281.365,21	232.632,58	238.109,86	-297.021,43
CNRD11	9.198.546,03	280.098,73	279.406,97	3,47%	-671.909,28	562.345,82	581.992,47	-720.528,29
COMPROMISSADA, PRE	588.835,31	0,00	0,00	0,00%	-15,83	16,15	73,90	-112,48
CONTAS A PAGAR, RECEBER	-4167.851,56	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CONX12	9.463.364,32	202.646,64	197.171,16	2,45%	-448.665,91	360.110,72	349.690,66	-451.272,92
CREDZM24	1.903.114,80	113.395,48	-24.054,62	-0,30%	0,00	0,00	0,00	0,00
CRMG15	4.481.479,49	90.724,18	89.718,27	1,11%	-216.147,67	167.250,56	166.302,87	-213.035,29
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
EGIEA0	3.203.593,19	136.300,71	132.521,10	1,64%	-320.659,98	288.087,35	303.066,38	-351.066,62
ENGIAS	1.982.096,42	54.522,01	54.489,45	0,68%	-129.539,35	110.220,67	110.000,96	-138.661,78
ERDV17	3.825.645,15	37.616,05	33.339,54	0,42%	-87.785,47	61.989,93	55.076,61	-73.275,44
ERDV38	5.561.715,98	86.984,31	80.190,00	1,00%	-172.602,37	129.466,61	119.567,96	-157.840,15
GASPI9	2.867.459,36	78.905,40	78.846,38	0,98%	-187.045,78	159.133,56	158.715,48	-200.226,91
GBSP11	7.440.713,95	288.824,59	282.814,92	3,51%	-690.359,97	594.340,37	633.685,47	-747.801,72
GRRB24	7.665.434,68	179.327,90	175.343,13	2,18%	-404.342,02	327.869,71	321.208,12	-413.331,74
HARG11	3.885.581,86	114.585,89	114.177,76	1,42%	-276.137,07	230.856,66	239.978,70	-295.368,58
HBSA21	4.278.049,87	117.786,18	117.715,50	1,46%	-279.849,81	238.137,71	237.675,84	-299.592,85
IPL11	8.375.072,30	202.428,78	202.262,81	2,51%	-485.649,43	393.765,72	399.184,90	-501.573,33
IRBR12	10.660.108,12	199.495,47	186.154,20	2,31%	-395.711,56	304.135,40	284.365,59	-373.090,54
ITPO14	8.515.800,62	304.043,85	302.164,46	3,75%	-725.010,39	613.030,30	641.633,62	-788.350,10
LAMEA6	7.928.375,03	212.691,53	212.575,32	2,64%	-504.128,02	431.701,17	426.741,29	-538.796,87
LCAMD1	4.583.293,69	123.676,63	123.595,55	1,53%	-293.549,18	248.781,62	248.153,63	-313.134,71
LIGHD7	5.539.946,60	101.950,07	95.061,61	1,18%	-201.645,41	154.781,15	144.372,41	-189.685,03
LORTA7	5.776.949,91	159.580,34	159.472,91	1,98%	-378.557,84	322.635,41	321.282,18	-405.296,35
LTIIE15	3.471.283,40	101.158,87	100.793,00	1,25%	-245.174,22	203.732,89	212.055,62	-260.419,74
MGSP12	5.782.972,06	177.836,40	177.049,71	2,20%	-429.257,00	359.926,87	375.784,35	-459.426,78
MOVB7	7.976.852,10	210.554,16	210.406,87	2,61%	-499.667,24	422.364,99	420.813,00	-531.411,97
MTRJ19	2.508.755,46	54.016,47	53.558,19	0,66%	-129.434,46	100.140,81	100.393,50	-128.223,30
MLV16	6.436.132,92	167.994,86	164.183,90	2,04%	-386.664,11	302.357,61	306.939,19	-394.305,91
NTE111	6.454.972,10	132.535,33	129.539,33	1,61%	-297.409,46	238.946,57	230.973,49	-297.856,94
OUTRAS DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PASN12	7.008.941,20	122.164,84	119.130,69	1,48%	-280.997,05	226.680,70	214.777,30	-277.619,79
PEJA11	9.458.057,88	238.155,85	237.552,60	2,95%	-558.126,61	469.166,43	465.816,57	-589.752,87
QUAT12	4.471.759,46	73.249,96	67.525,03	0,84%	-144.465,08	106.060,54	99.289,71	-131.090,95
RAHD11	11.500.075,72	370.673,23	368.339,82	4,57%	-893.771,95	746.001,36	785.196,21	-954.678,84
RDVE11	3.632.907,68	107.017,18	106.925,79	1,33%	-253.561,57	211.856,97	218.238,98	-269.924,15
RMSA12	5.558.654,08	247.228,02	241.796,24	3,00%	-589.221,15	501.274,13	540.778,91	-642.326,29
RSAN44	5.195.980,36	112.062,35	110.187,70	1,37%	-250.714,55	205.644,15	199.207,22	-255.719,10
TCM11	10.853.337,03	376.583,12	373.454,47	4,63%	-904.278,85	757.274,44	802.391,61	-968.418,57
TNHL11	2.492.840,79	82.906,68	82.374,81	1,02%	-198.478,33	166.497,29	175.289,65	-212.206,53
UHLMI2	1.765.234,16	65.852,75	64.705,78	0,80%	-159.040,46	133.817,13	143.153,31	-173.472,30
UNEG11	1.730.266,69	62.848,35	61.866,17	0,77%	-152.159,87	127.688,20	136.493,11	-164.666,25
UTPS11	3.859.681,23	60.508,24	57.691,60	0,72%	-134.400,61	105.063,35	98.149,88	-128.116,52
UTPS21	4.001.214,49	127.297,92	126.513,41	1,57%	-306.729,71	259.182,01	269.662,45	-331.899,34
UTPS22	2.537.996,12	84.118,93	83.460,54	1,04%	-202.592,75	171.542,46	179.112,48	-220.010,81
VAMO33	5.804.262,69	156.020,69	155.859,65	1,93%	-371.877,59	310.444,35	310.643,49	-392.821,53
VAMO34	6.575.663,98	175.217,63	175.118,91	2,17%	-416.244,65	352.973,27	351.600,98	-443.710,38
VERDEC52	352.726,63	81.909,46	-17.949,15	-0,22%	0,00	0,00	0,00	0,00
VIMT13	6.553.811,87	190.012,63	189.459,62	2,35%	-462.340,56	381.357,29	396.899,13	-490.621,83
VRDN12	4.503.662,77	123.767,74	123.728,83	1,54%	-295.423,54	246.284,13	250.621,53	-313.445,18
Total Var:	309.680.995,25	8.406.130,37	8.057.294,94	100,03%	-19.240.344,57	15.968.291,35	16.230.498,63	-20.213.303,96



Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/01/2023

FUNDO:	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO
CNPJ:	32711990000162

Dados Gerais							
PL:	92.400.884,52	VAR / PL:	4,1583%	Limite Fundo:	0,00%	Dutation DC:	1,00
VAR:	3.842.342,12	ETL / PL:	5,2147%	Status:	ENQUADRADO	Dutation DU:	1,00
ETL:	4.818.452,03	VAR / CDI:	0,0466%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	47.852.109,64	Cenário Baixa - 10000 (+):	12,64	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	12.418.646,15	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	-
Cenário Alta - 09999 (-):	(12,39)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(47.852.126,98)	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	-	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(12.520.329,18)
Cenário Alta - 09999:	47.852.097,25	Cenário Baixa - 10000:	(47.852.114,34)	CENÁRIO BRADESCO 1:	12.418.646,15	CENÁRIO BRADESCO 2:	(12.520.329,18)

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

Produto	MhM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
AIEC11	3.645.202,65	128.603,97	108.675,41	2,83%	1.822.595,83	-1.822.601,33	534.386,71	-538.760,95
BMLC11	2.913.600,00	129.065,51	-62.488,90	-1,63%	2.913.600,00	-2.913.600,00	427.133,76	-430.630,08
BPML11	963.099,50	50.290,78	18.952,65	0,49%	963.099,50	-963.099,50	141.190,39	-142.346,11
BTLG11	3.619.041,12	148.338,18	53.503,76	1,39%	1.809.520,56	-1.809.520,56	530.551,43	-534.894,28
CAIXA	999,80	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CEOC11	774.147,50	58.629,49	53.714,40	1,40%	387.073,75	-387.073,75	113.490,02	-114.419,00
CNES11	464.415,60	28.610,44	-15.214,22	-0,40%	232.207,80	-232.207,80	68.083,33	-68.640,63
COMPROMISSADA_PRE	445.235,75	0,00	0,00	0,00%	-12,39	12,64	57,84	-88,04
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-237.139,11	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
FVPRQ11	1.064.245,70	86.334,17	55.289,40	1,44%	532.122,85	-532.122,85	156.018,42	-157.295,51
GALG11	2.598.136,20	80.287,15	-39.825,13	-1,02%	1.299.068,10	-1.299.068,10	380.886,77	-384.004,53
BTLG11	1.409.442,30	33.309,94	-11.208,76	-0,28%	1.409.442,30	-1.409.442,30	206.624,24	-208.315,57
HBRH11	2.541.049,38	218.202,19	146.238,24	3,81%	2.541.049,38	-2.541.049,38	372.517,84	-375.567,10
HSLG11	3.286.267,42	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
HSML11	8.602.640,00	507.495,03	318.022,29	8,28%	4.301.320,00	-4.301.320,00	1.261.147,02	-1.271.470,19
MALL11	3.298.082,28	162.819,04	124.623,20	3,24%	1.649.041,14	-1.649.041,14	483.498,86	-487.456,56
MAXR11	1.081.977,50	100.968,48	-50.027,81	-1,30%	540.988,75	-540.988,75	158.617,90	-159.916,27
NEWL11	930.797,35	76.185,19	72.415,50	1,88%	465.393,68	-465.393,68	136.453,43	-137.570,57
NEWU11	535.060,80	29.300,35	13.188,19	0,34%	535.060,80	-535.060,80	78.439,91	-79.081,99
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PATC11	9.857.055,60	552.837,82	437.859,80	11,40%	4.928.527,80	-4.928.527,80	1.445.044,35	-1.456.872,82
QAQR11	7.740.592,20	528.482,02	488.908,49	12,72%	3.870.296,10	-3.870.296,10	1.134.770,82	-1.144.059,53
RBRL11	2.631.304,11	189.084,94	-63.257,73	-1,65%	2.631.304,11	-2.631.304,11	385.749,18	-388.906,75
RCRB11	5.154.234,58	424.540,32	343.721,07	8,99%	0,00	0,00	0,00	0,00
RWGO11	125.852,68	4.915,35	1.804,90	0,05%	62.926,34	-62.926,34	18.450,00	-18.601,03
TEPP11	8.168.588,83	954.420,12	830.420,21	21,61%	4.084.782,57	-4.084.782,57	1.197.661,72	-1.207.465,23
TRXF11	15.685.940,00	502.549,24	441.839,94	11,50%	7.842.970,00	-7.842.970,00	2.299.558,80	-2.318.381,93
XPIN11	3.099.236,36	194.593,89	171.757,70	4,47%	1.549.618,18	-1.549.618,18	454.348,05	-458.067,13
XPPR11	2.960.200,20	460.133,98	402.629,52	10,48%	1.480.100,10	-1.480.100,10	433.965,35	-437.517,59
Total Var:	93.360.296,30	5.649.988,58	3.842.342,12	99,99%	47.852.097,25	-47.852.114,34	12.418.646,15	-12.520.329,18



Relatório de Risco de Mercado



Data: 31/01/2023

FUNDO: FIA RVA EMB II
CNPJ: 13294268000125

Dados Gerais					
PL:	232.148.158,00	VAR / PL:	8,8205%	Limite Fundo:	0,00%
VAR:	20.476.547,54	ETL / PL:	11,0612%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	25.678.416,72	VAR / CDI:	0,0992%	Benchmark:	
				Duration DC:	1,00
				Duration DU:	1,00

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	60.433.399,21	Cenário Baixa - 10000 (-):	180,05	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	34.053.827,75
Cenário Baixa - 10000 (-):	(176,57)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(59.971.706,16)	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	-
Cenário Baixa - 10000 (-):	(59.971.706,16)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(59.971.706,16)	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	-
Cenário Baixa - 10000 (-):	(59.971.706,16)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(59.971.706,16)	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(34.331.595,65)
Cenário Baixa - 10000 (-):	(59.971.706,16)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(59.971.706,16)	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	(34.331.595,65)
Cenário Baixa - 10000 (-):	(59.971.706,16)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(59.971.706,16)	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(34.331.595,65)

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
ABEV3	5.913.482,30	385.408,64	-157.902,02	-0,77%	827.887,52	-1.093.994,23	866.916,51	-874.012,68
ARZZ3	2.540.400,00	477.721,81	430.678,16	2,10%	762.120,00	-762.120,00	372.422,64	-375.471,12
ASAI3	1.316.550,00	96.630,25	48.987,09	0,24%	358.834,00	-342.303,00	193.006,23	-194.586,09
B3SA3	9.951.063,84	1.464.949,01	1.044.405,79	5,10%	2.487.765,96	-2.487.765,96	1.458.805,96	-1.470.767,24
BBAS3	7.912.080,00	1.718.430,75	1.509.461,32	7,37%	1.978.020,00	-1.978.020,00	1.159.910,93	-1.169.405,42
BBD4C	8.166.369,60	1.501.993,49	1.221.060,56	5,96%	2.041.592,40	-1.633.273,92	1.197.189,78	-1.206.989,43
BBS3E	1.964.560,00	111.031,41	56.009,45	0,27%	392.912,00	-392.912,00	288.004,50	-290.361,97
BEEF3	1.677.401,00	381.405,87	337.242,38	1,65%	419.350,25	-419.350,25	245.906,99	-247.919,87
BPAC11	3.201.922,00	426.414,97	183.670,73	0,90%	960.576,60	-1.120.672,70	469.401,77	-473.244,07
CAIXA	9.999,99	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CIEL3	2.627.745,00	414.571,71	210.880,73	1,03%	788.323,50	-656.936,25	385.227,42	-388.380,71
COMPROMISSADA_PRE	6.343.359,39	0,00	0,00	0,00%	-176,57	180,05	824,11	-1.254,28
CONTAS_A PAGAR_RECEBER	7.203.363,82	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPFE3	3.321.344,00	255.627,63	230.634,43	1,13%	664.268,80	-664.268,80	486.909,03	-490.894,64
CSAN3	1.710.080,00	150.273,02	95.797,64	0,47%	427.520,00	-427.530,24	250.697,73	-252.749,82
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
EGIE3	3.765.795,00	261.500,51	211.274,85	1,03%	677.843,10	-677.843,10	552.065,55	-556.584,50
ELET3	5.854.494,30	413.344,98	223.364,33	1,09%	1.756.348,29	-1.756.348,29	858.268,86	-865.294,26
ELET6	3.227.720,00	291.223,71	158.279,65	0,77%	968.316,00	-968.323,60	473.183,75	-477.057,02
ENEV3	2.242.800,00	337.028,80	314.985,47	1,54%	829.836,00	-1.143.828,00	328.794,48	-331.485,84
ENGH1	2.167.425,00	144.669,84	28.341,36	0,14%	368.462,25	-476.833,50	317.744,51	-320.345,42
ECTL3	3.311.964,00	230.759,73	185.491,17	0,91%	662.380,96	-662.392,80	485.533,92	-489.509,28
GGBR4	4.861.890,00	503.525,63	112.508,30	0,55%	1.215.472,50	-1.215.472,50	712.753,07	-718.587,34
GMAT3	2.857.068,00	611.565,65	554.968,31	2,71%	514.230,47	-457.172,65	118.846,17	-422.274,65
HAPV3	3.821.238,20	748.377,53	482.541,47	2,36%	917.097,17	-917.097,17	560.193,52	-564.779,01
HYPE3	3.684.160,00	291.172,48	220.489,60	1,08%	847.356,80	-773.673,60	540.097,86	-544.518,85
INDG23	78.780,00	555.697,31	552.919,53	2,70%	1.235.291,83	-1.234.575,36	992.848,62	-999.571,17
INTB3	2.343.792,00	337.495,52	302.102,06	1,48%	1.171.896,00	-820.327,20	334.599,91	-346.412,46
ITSA4	4.458.989,26	351.513,75	305.442,06	1,49%	847.155,69	-847.207,96	653.687,83	-659.038,61
ITUB4	14.687.271,21	1.799.957,35	1.707.114,93	8,34%	2.937.454,24	-2.790.581,53	2.153.153,96	-2.170.778,69
JBSS3	3.570.224,00	461.145,75	341.151,72	1,67%	1.249.578,40	-1.249.578,40	523.394,84	-527.679,11
LREN3	6.338.671,50	1.209.778,24	1.107.422,72	5,41%	1.267.734,30	-1.267.763,61	929.249,24	-936.855,65
LWSA3	980.089,00	137.061,97	68.823,88	0,34%	392.035,60	-392.035,60	143.681,05	-144.857,15
MGLU3	1.511.959,00	1.031.898,13	870.169,27	4,25%	453.553,57	-453.621,83	221.653,19	-223.467,54
MULT3	2.293.356,00	346.247,67	329.605,44	1,61%	688.006,80	-573.339,00	336.205,99	-338.958,02
NTCO3	1.455.000,00	421.666,58	387.902,69	1,89%	363.750,00	-291.000,00	213.303,00	-215.049,00
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PETR3	6.843.558,00	1.396.082,56	1.255.076,64	6,13%	1.710.889,50	-2.053.067,40	1.003.265,60	-1.011.477,87
PETR4	12.176.228,13	2.707.366,13	2.423.080,44	11,83%	3.044.057,03	-3.652.868,44	1.785.035,04	-1.799.646,52
PETZ3	1.343.020,00	323.993,28	264.500,82	1,29%	335.755,00	-335.755,00	196.886,73	-198.498,36
PRIO3	6.533.920,00	718.141,98	506.329,26	2,47%	3.920.352,00	-3.920.352,00	957.872,67	-965.713,38
RADL3	4.663.074,00	382.239,22	317.619,21	1,55%	932.614,80	-932.614,80	683.606,65	-689.202,34
RENT3	5.275.611,00	1.055.011,34	997.351,87	4,87%	1.740.951,83	-1.371.667,77	773.404,57	-779.735,31
RRRP3	2.263.915,00	828.011,97	767.560,71	3,75%	1.358.349,00	-1.358.349,00	331.889,94	-334.606,64
SBSPP3	3.283.940,00	356.226,94	-40.607,30	-0,20%	820.985,00	-820.985,00	481.425,60	-485.366,33
STBP3	2.401.606,00	473.103,31	417.068,88	2,04%	840.562,10	-840.562,10	352.075,44	-354.957,37
SUZB3	5.980.440,00	781.022,58	-126.899,84	-0,62%	1.495.110,00	-1.196.088,00	876.732,50	-883.909,03
TIMS3	2.330.883,00	204.403,88	-79.213,95	-0,39%	745.882,56	-536.103,09	341.707,45	-344.504,51
TOTS3	3.295.160,81	532.738,64	502.182,14	2,45%	659.021,20	-659.032,16	483.070,58	-487.024,77
VALE3	39.977.257,45	2.432.339,96	-318.526,44	-1,56%	9.994.314,36	-9.994.314,36	5.860.665,94	-5.908.638,65
WEGE3	5.407.136,00	600.393,16	-84.798,01	-0,41%	1.351.784,00	-1.351.784,00	792.886,14	-799.174,70
Total Var:	239.148.158,80	30.660.170,66	20.476.547,54	100,01%	60.433.222,64	-59.971.526,11	34.053.827,75	-34.331.595,65



Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/01/2023

FUNDO:	FIA RVA EMB III		
CNPJ:	38452593000108		

Dados Gerais					
PL:	102.188.012,46	VAR / PL:	10,6116%	Limite Fundo:	0,00%
VAR:	10.843.747,49	ETL / PL:	13,3073%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	13.598.496,82	VAR / CDI:	6,1193%	Benchmark:	
				Dutacion DC:	1,00
				Dutacion DU:	1,00

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	27.717.712,10	Cenário Baixa - 10000 (-):	954.877,24	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	14.242.503,99
				CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	1.224.127,92
Cenário Alta - 09999 (-):	(940.516,09)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(27.313.272,02)	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	(1.217.742,39)
				CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(14.359.361,93)
Cenário Alta - 09999:	26.777.196,01	Cenário Baixa - 10000:	(26.358.394,78)	CENÁRIO BRADESCO 1:	13.024.761,60
				CENÁRIO BRADESCO 2:	(13.135.234,01)

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
ALSO3	4.660.159,54	798.681,62	769.900,62	7,10%	1.631.055,84	-1.165.039,89	683.179,39	-688.771,58
AURE3	6.080.678,13	356.042,53	150.894,84	1,39%	1.520.169,53	-1.885.010,22	891.427,41	-896.724,23
BBAS3	2.124.540,00	461.430,48	377.993,93	3,48%	531.135,00	-531.135,00	311.457,56	-314.007,01
BPAC11	5.830.914,00	776.530,16	375.393,79	3,48%	1.749.274,20	-2.040.819,90	854.811,99	-861.809,09
CAIXA	901,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CLSA3	139.200,00	27.828,97	-4.139,89	-0,04%	69.600,00	-69.600,00	20.406,72	-20.573,76
COMPROMISSADA_PRE	4.125.465,55	0,00	0,00	0,00%	-114,83	117,10	535,97	-815,73
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	822.728,50	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
DOLH23	58.631,35	501.500,31	331.434,87	3,06%	-940.401,26	954.760,14	-1.217.742,39	1.224.127,92
ELET3	5.555.716,80	392.250,38	255.391,36	2,36%	1.666.715,04	-1.666.715,04	814.468,08	-821.134,94
ENEV3	5.601.144,00	841.692,02	748.819,88	6,91%	2.072.423,28	-2.856.583,44	821.127,71	-827.849,08
ENUJ3	210.840,00	58.229,89	49.981,36	0,46%	94.878,00	-56.926,90	30.909,14	-31.162,15
EOTL3	9.537.195,42	664.500,18	588.483,82	5,43%	1.907.405,05	-1.907.439,08	1.398.152,85	-1.409.597,48
EUCA4	92.655,00	29.009,50	22.513,79	0,21%	74.124,00	-74.124,87	13.583,22	-13.694,41
HAPV3	1.393.075,00	272.829,37	198.599,30	1,83%	334.338,00	-334.338,00	204.224,80	-205.896,49
IGTH1	5.857.547,13	766.277,98	698.541,30	6,44%	1.171.509,43	-1.171.509,43	858.716,41	-865.745,47
ITUB4	6.185.586,00	758.057,15	691.485,05	6,38%	1.237.117,20	-1.175.261,34	906.806,91	-914.229,61
LREN3	4.395.778,38	838.963,98	789.960,13	7,28%	879.155,68	-879.176,00	644.421,11	-649.696,05
LWSA3	252.554,00	35.318,78	18.745,96	0,17%	101.021,60	-101.021,60	37.024,42	-37.327,48
NINJ3	326.046,00	43.822,64	19.803,72	0,18%	195.627,60	-195.627,60	47.798,34	-48.189,60
NTCO3	1.149.813,75	333.222,02	297.252,81	2,74%	287.453,44	-229.962,75	168.562,70	-169.942,47
ONCO3	1.159.905,00	335.286,68	243.571,69	2,23%	405.966,75	-405.966,75	170.042,07	-171.433,96
OUTRAS DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PETZ3	3.447.688,00	831.728,30	704.233,91	6,49%	861.922,00	-861.922,00	505.431,06	-509.568,29
PRI03	1.166.170,00	128.173,54	93.779,50	0,86%	699.702,00	-699.702,00	170.960,52	-172.359,93
RDO3	2.132.834,00	298.630,68	248.758,00	2,29%	639.850,20	-639.850,20	312.673,46	-315.232,87
RECV3	2.980.583,56	444.889,15	227.915,17	2,10%	1.788.350,14	-1.788.350,14	436.953,55	-440.530,25
RENT3	7.026.273,07	1.405.106,97	1.355.670,27	12,50%	2.318.670,11	-1.826.842,87	1.030.051,63	-1.038.483,16
RENT9	31.795,77	70.180,36	-13.303,15	-0,12%	0,00	0,00	0,00	0,00
SOMA3	3.557.536,50	686.387,73	686.448,82	6,16%	1.067.260,95	-1.067.260,95	521.534,85	-525.803,90
SUZB3	8.561.579,36	1.118.109,50	-108.064,03	-1,00%	2.140.394,84	-1.712.315,87	1.255.127,53	-1.265.401,43
TEND3	401.520,00	133.602,77	106.533,44	0,98%	140.532,00	-140.532,00	58.862,93	-59.344,66
VBBR3	5.165.082,16	689.845,71	689.809,21	6,18%	1.291.270,54	-1.291.270,54	757.201,05	-763.399,14
YDUQ3	2.155.871,00	298.660,90	266.238,02	2,46%	840.789,69	-538.967,75	316.050,69	-318.637,73
Total Var:	102.188.007,97	14.396.790,26	10.843.747,49	99,99%	26.777.196,01	-26.358.394,78	13.024.761,61	-13.135.234,01



Data: 31/01/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIA RVA EMB IV
CNPJ: 38452613000132

Dados Gerais			
PL:	93.182.619,27	VAR / PL:	9,7267%
VAR:	9.063.619,08	ETL / PL:	12,1977%
ETL:	11.366.143,98	VAR / CDI:	0,1094%
Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	1,00
Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1,00
Benchmark:			

Cenários de STRESS

Cenário Alta - 09999 (+):	25.957.754,85	Cenário Baixa - 10000 (+):	237,41	CENARIO BRADESCO 1 (+):	12.424.284,21	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
Cenário Alta - 09999 (-):	(232,82)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(24.378.202,45)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(12.526.541,98)
Cenário Alta - 09999:	25.957.522,04	Cenário Baixa - 10000:	(24.377.965,04)	CENARIO BRADESCO 1:	12.424.284,21	CENARIO BRADESCO 2:	(12.526.541,98)

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
ALSO3	3.820.335,23	654.748,30	632.185,25	6,97%	1.337.117,33	-955.083,81	560.061,15	-564.645,55
AURE3	5.813.129,71	340.376,74	145.983,55	1,61%	1.453.282,43	-1.802.070,21	852.204,82	-859.180,57
B3SA3	4.691.831,04	690.709,39	527.636,76	5,82%	1.172.957,76	-1.172.957,76	687.822,43	-693.452,63
BPAC11	2.312.280,62	307.937,25	156.477,64	1,73%	693.684,19	-809.298,22	338.980,34	-341.755,08
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA PRE	8.364.204,87	0,00	0,00	0,00%	-232,82	237,41	1.086,66	-1.653,86
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	75.272,62	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	872.868,00	131.167,14	117.494,46	1,30%	322.961,16	-445.162,68	127.962,45	-129.009,89
EQLT3	16.094.772,06	1.121.396,65	981.021,79	10,82%	3.218.896,97	-3.218.954,41	2.359.493,58	-2.378.807,31
GGPS3	5.055.839,60	712.563,87	673.548,62	7,43%	2.275.127,82	-2.275.127,82	741.186,09	-747.253,09
GMAT3	6.150.329,64	1.316.500,12	1.217.417,90	13,43%	1.106.969,42	-984.142,66	901.638,33	-909.018,72
HAPV3	2.830.120,70	554.270,27	410.447,12	4,53%	679.228,97	-679.228,97	414.895,70	-418.291,84
ITUB4	6.915.799,24	847.546,39	787.501,78	8,69%	1.383.159,85	-1.314.001,86	1.013.856,17	-1.022.155,13
MATD3	1.550.956,85	426.031,14	385.911,47	4,26%	468.287,06	-468.287,06	228.836,27	-230.709,42
MULT3	2.634.980,40	397.825,64	383.258,34	4,23%	790.494,12	-658.745,10	386.288,13	-389.450,10
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PRIO3	7.523.901,50	826.950,67	607.666,69	6,70%	4.514.340,90	-4.514.340,90	1.103.003,96	-1.112.032,64
RAIL3	8.294.508,02	851.665,45	776.435,67	8,57%	3.732.483,48	-2.737.232,77	1.215.974,88	-1.225.928,29
RENT3	3.326.773,06	665.284,71	635.047,67	7,01%	1.097.835,11	-864.966,61	487.704,93	-491.697,06
UGPA3	4.646.533,63	515.787,08	342.936,10	3,78%	1.161.633,41	-929.306,73	681.181,83	-686.757,67
VBBR3	2.197.179,56	293.454,17	282.648,26	3,12%	549.294,89	-549.294,89	322.106,52	-324.743,14
Total Var:	93.182.616,35	10.654.214,98	9.063.619,08	100,00%	25.957.522,04	-24.377.965,04	12.424.284,21	-12.526.541,98



Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/01/2023

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

Dados Gerais			
PL:	107.694.007,72	VAR / PL:	8,820%
VAR:	9.565.405,23	ETL / PL:	11,1394%
ETL:	11.995.404,06	VAR / CDI:	0,0999%
Limite Fundo:	0,00%	Duration DC:	1,95
Status:	ENQUADRADO	Duration DU:	1,65
Benchmark:			

Cenários de STRESS			
Cenário Alta - 09999 (+):	27.809.688,58	Cenário Baixa - 10000 (+):	785,17
Cenário Alta - 09999 (-):	(692,78)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(27.607.962,19)
Cenário Alta - 09999:	27.808.995,80	Cenário Baixa - 10000:	(27.607.177,02)
CENARIO BRADESCO 1 (+):	15.715.430,09	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(15.843.705,93)
CENARIO BRADESCO 1:	15.715.430,09	CENARIO BRADESCO 2:	(15.843.705,93)

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
ABEV3	3.142.988,42	204.842,90	-86.456,40	-0,90%	440.018,38	-581.452,86	460.762,10	-464.533,69
ALPA4	144.864,84	22.217,53	16.180,16	0,17%	36.216,21	-36.216,21	21.237,19	-21.411,02
ALSO3	310.510,41	53.216,84	50.883,55	0,53%	108.678,64	-77.627,60	45.520,83	-45.893,44
ARZ2	280.232,40	52.697,66	47.674,09	0,50%	84.069,72	-84.069,72	41.082,07	-41.418,35
ASA3	964.441,65	70.098,55	35.255,96	0,37%	270.043,66	-250.754,63	141.387,15	-142.544,48
AZUL4	203.191,95	61.516,87	57.390,50	0,60%	91.434,66	-91.436,38	29.787,94	-30.031,77
B3SA3	4.014.567,36	591.005,80	414.201,05	4,33%	1.003.641,84	-1.003.641,84	588.535,58	-593.353,06
BBAS3	3.033.411,70	658.829,02	585.529,21	6,12%	758.352,93	-758.352,93	444.698,16	-448.338,25
BBDC3	998.456,54	151.667,78	116.128,57	1,21%	249.614,14	-199.691,31	146.373,73	-147.571,88
BBDC4	3.787.699,28	696.649,79	568.512,52	5,94%	946.924,82	-757.539,86	555.276,71	-559.821,95
BBSE3	1.329.440,42	75.136,24	38.295,18	0,40%	265.888,08	-265.888,08	194.896,97	-196.491,29
BEEF3	191.173,35	43.468,82	38.306,22	0,40%	47.793,34	-47.793,34	28.026,01	-28.255,42
BRAC11	1.389.193,18	195.193,25	76.360,88	0,80%	416.879,45	-486.474,86	203.763,47	-205.431,39
BPAN4	103.866,40	11.652,92	5.647,01	0,06%	46.739,88	-36.353,24	15.228,61	-15.351,45
BRAP4	419.134,10	26.298,57	-8.439,53	-0,09%	104.783,53	-104.783,53	61.445,06	-61.948,02
BRFS3	448.553,96	162.732,68	142.148,89	1,49%	112.138,49	-112.138,49	65.758,01	-66.296,28
BRKMS	325.173,54	44.096,48	26.983,65	0,28%	178.845,45	-97.552,06	47.670,44	-48.060,65
CAIXA	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CASH3	40.860,21	6.842,88	-4.311,09	-0,05%	16.344,08	-16.344,08	5.990,11	-6.039,14
CCRO3	615.153,84	109.529,89	100.405,06	1,05%	153.788,46	-153.788,46	90.181,55	-90.919,74
CIEL3	286.897,65	45.263,01	22.283,15	0,23%	86.069,30	-71.724,41	42.059,20	-42.403,47
CMIG4	866.146,80	76.822,48	62.678,72	0,66%	216.536,70	-259.844,04	126.977,12	-128.016,50
CMIN3	311.765,22	46.290,78	32.776,33	0,34%	109.117,83	-109.117,83	45.704,78	-46.078,90
COGN3	226.921,10	49.826,27	44.823,58	0,47%	56.720,74	-79.422,39	33.266,63	-33.538,94
COMPROMISSADA PRE	1.152.363,91	0,00	0,00	0,00%	-32,08	32,71	149,71	-227,86
CONTAS A PAGAR RECEBER	751.914,68	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPFE3	328.243,84	25.109,39	22.521,49	0,24%	65.248,77	-65.248,77	47.927,35	-48.218,84
CPLE6	637.730,52	66.864,16	-11.386,36	-0,12%	140.300,71	-140.300,71	93.491,29	-94.256,57
CRFB3	455.352,45	83.139,88	68.192,92	0,71%	113.838,11	-113.840,88	66.754,67	-67.301,09
CSAN3	1.024.628,50	90.039,07	57.399,63	0,60%	256.157,13	-256.163,26	150.210,54	-151.440,09
CSNA3	571.483,50	125.900,46	105.719,11	1,11%	228.593,40	-171.445,05	83.779,48	-84.465,26
CVCB3	64.975,50	18.951,98	16.789,42	0,18%	32.487,75	-32.487,75	9.525,41	-9.603,38
CYRE3	217.468,68	57.835,72	53.514,36	0,56%	69.589,98	-63.067,35	31.860,91	-32.141,87
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DXCO3	108.410,12	21.458,59	18.977,70	0,20%	27.102,53	-32.524,47	15.892,92	-16.023,02
ECOR3	73.942,98	13.469,43	11.430,07	0,12%	18.485,75	-18.485,75	10.840,04	-10.928,77
EGIE3	526.424,30	36.555,42	29.670,80	0,31%	94.756,37	-94.756,37	77.173,80	-77.805,51
ELET3	3.987.277,20	281.513,81	146.166,73	1,53%	1.196.183,16	-1.196.183,16	584.534,84	-589.319,57
ELET6	612.205,05	55.236,71	29.004,36	0,30%	183.661,52	-183.662,96	89.749,26	-90.483,91
EMBR3	629.475,00	84.093,13	69.119,78	0,72%	157.368,75	-157.368,75	92.281,74	-93.036,41
ENBR3	581.917,40	24.329,11	23.125,33	0,24%	49.784,32	-39.267,62	38.397,10	-38.711,40
ENEV3	992.340,00	149.120,37	140.025,79	1,46%	367.165,80	-506.093,40	145.477,04	-146.667,85
ENGH1	549.461,25	36.675,07	5.944,90	0,06%	93.408,41	-120.881,48	80.551,02	-81.210,37
EQLT3	1.615.268,94	112.543,20	88.577,38	0,93%	323.048,02	-323.053,79	236.798,43	-238.736,75
EZTC3	72.913,05	17.515,20	15.957,77	0,16%	14.582,11	-21.874,41	10.689,05	-10.776,55
FLRY3	284.661,72	25.055,15	19.372,18	0,20%	56.932,34	-56.932,34	41.731,41	-42.073,00
GGBR4	1.874.561,44	194.148,49	45.698,02	0,48%	466.840,36	-466.840,36	274.810,71	-277.060,18
GOL4	595.671,02	49.219,82	33.125,33	0,34%	151.701,61	-156.418,01	74.131,52	-74.732,33
GOLL4	76.086,78	18.539,76	17.548,49	0,18%	45.652,07	-26.830,37	11.154,32	-11.245,63
HAPV3	1.202.499,25	235.505,71	149.055,85	1,56%	288.599,82	-288.599,82	176.286,39	-177.729,39
HYPE3	975.838,40	77.124,04	57.056,62	0,60%	224.442,83	-204.926,06	143.057,91	-144.228,92
IGTI11	218.408,91	28.572,02	25.906,39	0,27%	43.681,78	-43.681,78	32.018,75	-32.280,84
INDG23	24.947,00	175.970,82	175.483,76	1,83%	391.175,75	-390.948,87	314.402,06	-316.530,87
ITS44	2.339.540,16	184.432,05	157.823,80	1,65%	444.465,20	-444.512,63	342.976,59	-345.794,04
ITUB4	6.373.636,58	781.108,29	737.064,71	7,71%	1.274.737,32	-1.211.000,45	934.383,45	-942.030,88
JBS3	1.193.555,20	154.164,81	112.671,30	1,18%	417.744,32	-417.744,32	174.975,19	-176.407,46
KLBN11	711.112,46	75.002,48	-8.990,31	-0,09%	177.778,12	-142.222,49	104.249,09	-105.102,42
LFT20230301 - 210100	255.155,93	3,50	-1,79	0,00%	-41,02	43,62	0,81	-1,24
LFT20230901 - 210100	446.498,22	39,05	-16,34	0,00%	-619,69	708,84	7,73	-11,77
LEN3	1.094.283,33	208.851,36	190.101,20	1,99%	218.856,67	-218.861,73	160.421,94	-161.735,08
LWSA3	140.814,86	19.692,46	9.723,50	0,10%	56.325,95	-56.325,95	20.645,46	-20.812,44
MGLU3	687.159,00	455.329,21	386.520,15	4,04%	200.132,84	-200.162,46	97.805,36	-98.805,95
MRFG3	127.812,30	39.478,60	25.738,45	0,27%	51.124,92	-38.343,69	18.737,28	-18.890,66
MVVE3	112.327,02	13.742,63	10.205,14	0,11%	33.698,11	-33.698,11	16.467,14	-16.601,93
MULT3	333.107,58	50.292,12	47.759,23	0,50%	99.932,27	-83.276,90	48.833,57	-49.233,30
NTOCO	636.838,95	184.559,25	171.097,43	1,79%	159.209,74	-127.367,79	93.360,59	-94.124,80
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PCARS	170.484,16	42.614,45	34.517,34	0,36%	30.686,33	-27.278,29	24.992,98	-25.197,56
PET3	5.381.399,28	1.097.802,88	1.000.263,11	10,46%	1.345.349,82	-1.614.419,78	788.913,13	-795.370,81
PETRA	6.240.610,53	1.387.590,43	1.257.701,64	13,15%	1.560.152,63	-1.872.183,16	914.873,50	-922.362,24
PETZ3	127.300,92	30.710,37	25.148,04	0,26%	31.825,23	-31.825,23	18.662,32	-18.815,08
PRIO3	1.849.663,50	203.296,18	140.157,80	1,47%	1.109.798,10	-1.109.798,10	271.160,67	-273.380,27
QUAL3	91.558,10	25.950,14	19.058,83	0,20%	22.889,53	-22.889,53	13.422,42	-13.532,29
RADL3	1.556.543,04	127.592,18	104.225,45	1,09%	311.308,61	-311.308,61	228.189,21	-230.057,06
RAIL3	1.171.688,24	120.306,26	103.404,97	1,06%	521.253,33	-386.853,49	171.769,50	-173.175,52
RAIZ2	206.921,26	22.166,16	10.938,10	-0,11%	72.422,44	-72.422,44	30.334,66	-30.582,96
RDRD3	1.921.624,10	269.057,94	216.228,76	2,26%	576.487,23	-576.487,23	281.710,09	-284.016,04
RENT3	2.404.458,89	480.841,25	451.686,16	4,72%	793.471,43	-625.163,37	352.493,67	-355.379,02
RRRP3	460.448,93	168.406,16	155.717,16	1,63%	276.269,36	-276.269,36	67.501,81	-68.054,35
SANB11	538.383,15	70.437,74	61.284,42	0,64%	107.674,77	-107.676,63	78.926,97	-79.573,03
SBSF3	992.362,14	107.646,95	-13.619,73	-0,14%	248.090,54	-248.090,54	145.480,29	-146.671,12
SLE3	260.860,50	22.861,25	16.043,51	0,17%	78.258,15	-78.258,15	38.242,15	-38.555,18
SMTG3	188.075,20	21.016,43	4.422,08	0,05%	56.422,56	-56.422,56	27.571,82	-27.797,52
SOMA3	270.427,50	52.176,03	48.309,11	0,51%	81.128,25	-81.128,25	39.644,67	-39.969,18
SUZB3	1.764.600,68	230.450,10	-41.645,67	-0,44%	441.150,17	-352.920,14	258.690,46	-260.807,98



Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/01/2023

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

Dados Gerais					
PL:	107.694.007,72	VAR / PL:	8,820%	Limite Fundo:	0,00%
VAR:	9.565.405,23	ETL / PL:	11,1394%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	11.995.404,06	VAR / CDL:	0,999%	Benchmark:	
				Duration DC:	1,95
				Duration DU:	1,65

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	27.809.688,58	Cenário Baixa - 10000 (+):	785,17	CENARIO BRADESCO 1 (+):	15.715.430,09
Cenário Alta - 09999 (-):	(692,78)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(27.607.962,19)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-
Cenário Alta - 09999:	27.808.995,80	Cenário Baixa - 10000:	(27.607.177,02)	CENARIO BRADESCO 1:	15.715.430,09
				CENARIO BRADESCO 2 (+):	(15.843.705,93)
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	(15.843.705,93)

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
TAE11	423.521,68	60.208,13	55.299,62	0,58%	105.880,42	-105.880,42	62.088,28	-62.596,50
TIMS3	499.495,14	43.802,60	-17.778,95	-0,19%	159.838,45	-114.883,88	73.225,99	-73.825,38
TOTS3	822.234,08	132.933,08	125.024,26	1,31%	164.444,08	-164.446,82	120.539,52	-121.526,20
UGPA3	751.341,97	83.402,49	54.627,77	0,57%	187.835,49	-150.268,39	110.146,73	-111.048,34
USIMS	230.079,69	45.110,80	32.682,62	0,34%	89.731,08	-50.617,53	33.729,68	-34.005,78
VALES	16.811.911,35	1.022.888,67	-106.832,74	-1,12%	4.202.977,84	-4.202.977,84	2.464.626,20	-2.484.800,50
VBBR3	960.424,54	128.273,81	118.738,54	1,24%	240.106,14	-240.106,14	140.798,24	-141.950,75
VIAA3	198.302,40	63.765,16	42.479,88	0,44%	89.236,08	-89.236,08	29.071,13	-29.309,10
VIVT3	927.149,40	102.528,28	89.822,43	0,94%	139.070,19	-139.074,63	135.920,10	-137.032,68
WEGE3	2.641.236,80	293.275,50	-50.201,63	-0,52%	660.309,20	-660.309,20	387.205,32	-390.374,80
YDUQ3	159.712,13	22.125,52	17.440,60	0,18%	62.287,73	-39.928,03	23.413,80	-23.605,45
Total Var:	107.693.652,21	14.194.779,90	9.565.405,23	100,01%	27.808.995,80	-27.607.177,02	15.715.430,09	-15.843.705,93



3. RISCO DE CRÉDITO

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

3.1. Relatório de Risco de Crédito



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/01/2023

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS							INFORMAÇÕES DE RATING			
Fundo	DataAquisição	DataVencimento	Emissor	CNPJEmissor	Financeiro	Cód.ISIN	S&P	Moody's	Fitch	Austin
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	25/05/15	15/04/23	RD COLIN	03025305000146	613.448,64	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	27/05/15	15/04/23	RD COLIN	03025305000146	613.352,56	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	27/05/15	15/04/23	RD COLIN	03025305000146	674.713,16	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	01/06/15	15/04/23	RD COLIN	03025305000146	791.248,65	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	12/08/15	16/07/23	DUKE GEP	02998301000181	1.489.869,49	BRGEPADBS079	-	Aaa.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	18/05/16	15/10/24	TRANS AL	07859971000130	1.210.280,12	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/24	TRANS AL	07859971000130	447.093,42	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/24	TRANS AL	07859971000130	268.256,05	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	20/06/16	15/10/24	TRANS AL	07859971000130	893.263,13	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/07/17	15/04/23	RD COLIN	03025305000146	1.449.919,61	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-	-
FI RF EMB II	25/08/17	15/08/24	PETR	33000167000101	17.876.581,42	BRPETRDBS084	AAA	Aaa.br	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	18/12/17	06/11/27	RB CAPIT	03559006000191	3.644.881,65	BRBRACRI4G2	-	-	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	21/12/17	06/11/27	RB CAPIT	03559006000191	1.063.842,29	BRBRACRI4G2	-	-	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/01/18	06/11/27	RB CAPIT	03559006000191	3.788.321,52	BRBRACRI4G2	-	-	AAA(bra)	-
FI RF EMB II	19/02/18	15/02/25	SABESP	43776517000180	9.548.406,95	BRBSPDBS1A7	brAAA	-	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/02/18	15/02/25	SABESP	43776517000180	5.925.829,58	BRBSPDBS1A7	brAAA	-	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	26664057000189	12.075.364,82	BRENTVDBS008	brAA-	-	AA(bra)	-
FI RF EMB II	23/05/18	15/05/28	COMGAS	61856571000117	27.075.763,29	BRGASDBS093	-	-	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	26664057000189	594.154,27	BRENTVDBS008	brAA	-	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	26664057000189	594.154,27	BRENTVDBS008	brAA	-	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	26664057000189	594.154,27	BRENTVDBS008	brAA	-	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	26664057000189	592.796,57	BRENTVDBS008	brAA	-	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	26664057000189	594.154,27	BRENTVDBS008	brAA	-	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	08873873000110	12.177.685,61	BRERDVDBS0E8	brAAA	A2.br	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/07/18	15/07/25	AEGEA SA	08827501000158	14.025.986,55	BRAEGPDBS038	brA	Aa1.br	AA(bra)	-
FI RF EMB II	26/07/18	15/07/25	CSMG	17281106000103	12.674.583,11	BRCSMGDBS0E7	-	Aa3.br	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/04/23	RD COLIN	03025305000146	454.279,41	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/04/23	RD COLIN	03025305000146	257.834,26	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/04/23	RD COLIN	03025305000146	681.419,12	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/02/25	CEMIG	17155730000164	2.007.504,67	BRMCGDDBS041	brA+	A1.br	AA-(bra)	-
FIM EMB II A	14/11/18	15/03/24	BRADESCO	60746948000112	338.209,30	BRBBDCLTR6K7	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	-
FIM EMB I A	04/01/19	06/02/23	MOV_PART	21314559000166	783.332,57	BRMOVDBS085	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB II A	17/01/19	16/09/24	ITAUUBB	60872504000123	310.144,16	BRBITALFIU67	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	-
FIM EMB I A	12/02/19	15/01/25	ITAUUBB	60872504000123	2.467.591,02	BRBITALFITJ2	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	-
FIM EMB II A	12/02/19	15/01/25	ITAUUBB	60872504000123	2.467.591,02	BRBITALFITJ2	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/05/26	OMEGA GE	09149503000106	557.129,24	BROMGEDBS028	-	-	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/05/26	OMEGA GE	09149503000106	3.527.592,40	BROMGEDBS028	-	-	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/05/26	OMEGA GE	09149503000106	2.008.879,49	BROMGEDBS028	-	-	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/05/26	OMEGA GE	09149503000106	6.073.512,35	BROMGEDBS028	-	-	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/07/29	GUARIROB	04089570000150	694.943,14	BRGRRDBS042	-	-	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/07/29	GUARIROB	04089570000150	5.622.721,79	BRGRRDBS042	-	-	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/07/29	GUARIROB	04089570000150	8.339.317,71	BRGRRDBS042	-	-	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/07/29	GUARIROB	04089570000150	859.202,43	BRGRRDBS042	-	-	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/05/26	OMEGA GE	09149503000106	609.360,11	BROMGEDBS028	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB I A	30/09/20	22/09/25	BCBF	19276528000116	268.722,29	BRBCBFDBS032	-	-	AA+(bra)	-
FIM EMB II A	08/01/21	15/04/24	ECORODOV	08873873000110	1.375.286,36	BRERDVDBS0F5	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB II A	20/01/21	15/07/23	AEGEA SA	08827501000158	357.610,63	BRAEGPDBS020	-	Aa1.br	AA(bra)	-
FIM EMB II A	20/01/21	23/07/23	COPEL GT	04370282000170	87.840,98	BRCPGTDBS032	-	-	AA+(bra)	-
FIM EMB II A	04/02/21	15/07/23	AEGEA SA	08827501000158	120.882,47	BRAEGPDBS020	-	Aa1.br	AA(bra)	-
FIM EMB II A	05/02/21	23/07/23	COPEL GT	04370282000170	55.206,30	BRCPGTDBS032	-	-	AA+(bra)	-
FIM EMB II A	05/02/21	15/07/23	AEGEA SA	08827501000158	166.213,39	BRAEGPDBS020	-	Aa1.br	AA(bra)	-
FIM EMB II A	05/02/21	15/07/24	COPEL GT	04370282000170	285.761,31	BRCPGTDBS057	-	-	AA+(bra)	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/12/30	ENTREVIA	26664057000189	5.891.247,83	BRENTVDBS008	brAA	-	AA(bra)	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/12/30	ENTREVIA	26664057000189	5.905.000,86	BRENTVDBS008	brAA	-	AA(bra)	-



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/01/2023

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS							INFORMAÇÕES DE RATING			
Fundo	DataAquisição	DataVencimento	Emissor	CNPJEmissor	Financeiro	Cód.ISIN	S&P	Moody's	Fitch	Austin
FI RF EMB II	12/02/21	15/05/29	ELETROB	00001180000126	4.099.641,85	BRELETDBS032	brAAA	-	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/06/29	NEOENERG	01083200000118	590.997,47	BRNEOEDBS047	brAA+	-	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/06/29	NEOENERG	01083200000118	5.874.809,74	BRNEOEDBS047	brAA+	-	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/05/29	ELETROB	00001180000126	1.697.643,94	BRELETDBS032	brAAA	-	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/05/29	ELETROB	00001180000126	3.253.764,75	BRELETDBS032	brAAA	-	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/05/29	ELETROB	00001180000126	3.481.203,37	BRELETDBS032	brAAA	-	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/07/34	IGUA SAN	08159965000133	2.562.507,84	BRIGSNDBS044	brAA	-	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/05/28	COMGAS	61856571000117	23.582.116,42	BRGASDBS093	-	-	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	16/07/23	DUKE GEP	02998301000181	5.988.232,82	BRREPDBS079	-	Aaa.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	07859971000130	455.312,55	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	07859971000130	801.350,09	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	07859971000130	910.625,10	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	07859971000130	455.312,55	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	07859971000130	557.302,56	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	07859971000130	468.168,36	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	07859971000130	1.358.322,13	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	27/01/25	BRDESCO	60746948000112	13.053.587,93	BRBBDCLFRZJ5	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/11/24	CCR	02846056000197	6.045.809,69	BRCCRODBS0G5	brAAA	-	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/11/24	ECORODOV	08873873000110	4.029.466,43	BRREDVDBS000	brAA	A2.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/02/25	SABESP	43776517000180	1.391.693,19	BRBSPDBS1A7	brAAA	-	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/05/28	COMGAS	61856571000117	10.480.940,63	BRGASDBS093	-	-	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/06/27	JAGUARA	28925264000175	1.792.900,90	BRENJGDBS018	-	-	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/06/27	ENERGMIR	28942127000149	1.115.630,92	BRENMDDBS018	-	-	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	01/08/25	BRDESCO	60746948000112	4.231.903,47	BRBBDCLTR2J8	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	-
FIM EMB I A	28/05/21	28/11/23	B.ALFA	60770336000165	1.155.575,29	BRBRVLFII52	-	Aa1.br	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/34	VIARONDO	10635691000153	172.899,87	BRVRDNDDBS012	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/10/30	LAMEA	00776574000660	196.080,00	BRAMERDBS081	-	-	D	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/10/38	TAUBATE	14395590000103	3.144.795,28	BRLTTEEDBS048	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/26	IRB	33376989000191	2.493.406,64	BRIRBRDBS022	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/10/30	LAMEA	00776574000660	96.000,00	BRAMERDBS081	-	-	D	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/03/28	BRISANET	04601397000128	3.213.387,81	BRBRSTDBS001	brA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/10/36	PAMPASUL	04739720000124	984.047,67	BRUTPSDBS013	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/10/30	LAMEA	00776574000660	45.000,00	BRAMERDBS081	-	-	D	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/31	METROLOR	10324624000118	1.314.030,26	BRMGPRDBS068	brAA	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/03/31	LICALIZA	16670085000155	5.060.974,51	BRRENTDBS0K7	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/05/30	NORTE EN	12300288000107	289.070,20	BRNTENDBS005	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/34	VIARONDO	10635691000153	1.563.523,98	BRVRDNDDBS012	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	09/06/21	15/11/25	QUATA	60855574000173	1.732.180,06	BRQUATDBS019	-	-	A(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/06/21	15/12/35	MS 306	36128741000108	665.848,48	BRCNRDDBS004	-	-	A(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/06/21	25/08/25	CSAN	50746577000115	30.157,06	BRRLOGDBS006	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/06/21	25/11/24	DASA	61486650000183	434.444,07	BRDASADBS0G1	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/06/21	25/08/25	CSAN	50746577000115	814.240,61	BRRLGDBS006	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/06/21	04/11/25	BCBF	19276528000116	510.432,51	BRBCBFDDBS040	-	-	AA+(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/06/21	04/11/25	BCBF	19276528000116	510.432,51	BRBCBFDDBS040	-	-	AA+(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/06/21	27/11/25	SANEAMEN	01616929000102	470.408,36	BRNSNGDBS0J1	-	-	A+(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/06/21	27/11/25	SANEAMEN	01616929000102	956.114,56	BRNSGDBS0J1	-	-	A+(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/06/21	27/11/25	SANEAMEN	01616929000102	941.772,84	BRNSGDBS0J1	-	-	A+(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/06/21	25/11/24	DASA	61486650000183	1.764.479,68	BRDASADBS0G1	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/06/21	25/11/24	DASA	61486650000183	440.606,39	BRDASADBS0G1	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/06/21	25/08/25	CSAN	50746577000115	203.560,15	BRRLOGDBS006	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/06/21	25/08/25	CSAN	50746577000115	509.438,90	BRRLOGDBS006	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/06/21	04/11/25	BCBF	19276528000116	1.530.247,26	BRBCBFDDBS040	-	-	AA+(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	14/06/21	19/06/24	BNBBM	07237373000120	573.700,60	BRBNBRLFI0F8	brAAA	AAbr	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	14/06/21	12/06/24	BNBBM	07237373000120	870.525,21	BRBNBRLFI0E2	brAAA	AAbr	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	15/06/21	29/06/24	SBF COME	06347409000165	485.162,67	BRBFCDBS002	brA+	-	A+(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	15/06/21	29/06/24	SBF COME	06347409000165	1.161.657,10	BRBFCDBS002	brA+	-	A+(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	15/06/21	15/12/30	LAMEA	00776574000660	48.720,00	BRAMERDBS081	-	-	D	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	16/06/21	13/07/23	ECORODOV	08873873000110	2.022.577,29	BRREDVDBS0J7	brAAA	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	16/06/21	15/03/29	OMEGA GE	09149503000106	2.030.513,59	BROMGEDBS069	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	17/06/21	15/02/31	CORSAN	92802784000190	753.321,66	BRRSANDBS055	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	17/06/21	15/02/26	CORSAN	92802784000190	1.078.533,43	BRRSANDBS030	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	18/06/21	15/12/30	MG050	08822767000108	517.861,99	BRRDVIDBS061	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	21/06/21	15/04/28	PAMPASUL	04739720000124	1.162.849,91	BRUTPSDBS005	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	15/10/30	LAMEA	00776574000660	29.400,00	BRAMERDBS081	-	-	D	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	15/12/35	MS 306	36128741000108	1.453.295,22	BRCNRDDBS004	-	-	A(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	15/10/30	LAMEA	00776574000660	152.400,00	BRAMERDBS081	-	-	D	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	15/12/35	MS 306	36128741000108	79.431,12	BRCNRDDBS004	-	-	A(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	20/06/26	OURO VER	75609123000123	1.445.646,22	BRROVSADBS0E8	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	30/06/21	15/12/35	MS 306	36128741000108	2.941.893,16	BRCNRDDBS004	-	-	A(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	01/07/21	15/10/26	LIGHT	6044437000146	5.312.668,67	BRLIGHDBS0S5	brAA+	A+.br	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	01/07/21	15/12/35	MS 306	36128741000108	2.573.175,88	BRCNRDDBS004	-	-	A(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	02/07/21	18/02/25	RENNER	92754738000162	1.177.166,79	BRLRENDDBS0B4	brAAA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	02/07/21	18/02/25	RENNER	92754738000162	248.954,14	BRLRENDDBS0B4	brAAA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	07/07/21	15/03/29	CAGECE	07040108000157	1.177.632,90	BRCAECDDBS019	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	08/07/21	15/06/31	VAMOS	23373000000132	243.624,94	BRVAMODDBS041	brAA+	-	AAA(bra)	-



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/01/2023

Fundo	INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING			
	DataAquisição	DataVencimento	Emissor	CNPJEmissor	Financeiro	Cód.ISIN	S&P	Moody's	Fitch	Austin
FIM EMB VII A CRED PRIV	08/07/21	15/03/29	CAGECE	07040108000157	2.683.882,48	BRCAECDBS019	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	08/07/21	15/06/31	VAMOS	2337300000132	4.833.828,12	BRVAMODBS041	brAA+	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	12/07/21	12/07/26	BRADESCO	60746948000112	3.684.789,93	BRBBDCLTRQT4	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/26	IRB	33376989000191	1.958.465,72	BRIRBRDBS022	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/34	VIARONDO	10635691000153	215.329,29	BRVRDNDBS012	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/26	IRB	33376989000191	951.254,78	BRIRBRDBS022	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/30	LAMEA	00776574000660	175.440,00	BRAMERDBS008	-	-	D	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/26	IRB	33376989000191	494.652,48	BRIRBRDBS022	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/30	LAMEA	00776574000660	154.800,00	BRAMERDBS008	-	-	D	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/30	LAMEA	00776574000660	227.040,00	BRAMERDBS008	-	-	D	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/30	LAMEA	00776574000660	113.520,00	BRAMERDBS008	-	-	D	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/34	VIARONDO	10635691000153	1.811.736,06	BRVRDNDBS012	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/34	VIARONDO	10635691000153	283.216,35	BRVRDNDBS012	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/26	IRB	33376989000191	3.916.931,43	BRIRBRDBS022	brAA+	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	10/05/24	MULTIPLA	07816890000153	3.142.833,82	BRCMLTDBS031	brAAA	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	20/09/24	IGUATEMI	51218147000193	387.190,72	BRIGTADBS072	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	20/09/24	IGUATEMI	51218147000193	387.190,72	BRIGTADBS072	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	20/09/24	IGUATEMI	51218147000193	1.380.419,10	BRIGTADBS072	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	15/07/27	RT BANDE	10647979000148	2.314.003,61	BRCRBDDBS033	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	15/05/23	ELEKTRO	02328280000197	559.629,88	BREKTRDBS0F0	brAAA	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	15/09/23	SONAE	05878397000132	1.581.199,50	BRALSCDBS036	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	16/07/21	15/02/31	CORSAN	92802784000190	2.776.827,33	BRRSANDBS055	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	19/07/21	15/07/30	PARANAGU	01691945000160	616.833,23	BRPASNDBS018	brAA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	19/07/21	15/05/30	NORTE EN	12300288000107	1.845.231,44	BRNTENDBS005	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	19/07/21	15/10/30	LAMEA	00776574000660	194.160,00	BRAMERDBS081	-	-	D	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	21/07/21	15/10/36	PAMPASUL	04739720000124	1.901.111,90	BRUTPSDBS013	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	21/07/21	15/10/36	PAMPASUL	04739720000124	696.627,81	BRUTPSDBS013	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB I A	21/07/21	15/05/25	INTERVIA	03207703000183	1.297.927,89	BRVIADBS074	-	Aa2.br	-	-
FIM EMB I A	21/07/21	05/03/24	ENERG TR	28201130000101	1.345.853,14	BRETENDBS061	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB I A	21/07/21	15/07/27	RT BANDE	10647979000148	1.112.393,14	BRCRBDDBS033	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB I A	21/07/21	15/03/29	OMEGA GE	09149503000106	1.026.424,62	BROMGEDBS069	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB I A	21/07/21	20/08/26	VAMOS	2337300000132	1.090.337,31	BRVAMODBS017	brAA+	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	23/07/21	15/12/30	MG050	08822767000108	1.553.585,97	BRRDVIDBS061	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	27/07/21	15/06/28	MOVIDA L	07976147000160	1.645.512,79	BRMLVLDBS050	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	27/07/21	15/06/28	MOVIDA L	07976147000160	4.180.223,44	BRMLVLDBS050	brAA+	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	29/07/21	15/10/24	BKBR	13574594000196	1.439.187,20	BRBKBRDBS048	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	29/07/21	15/12/26	RD COLIN	03025305000146	2.115.327,61	BRCOLNDBS0C7	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	30/07/21	15/05/30	NORTE EN	12300288000107	1.023.790,29	BRNTENDBS005	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	23449511000190	1.036.259,94	BRUNEGDBS007	brAA	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	06/08/21	15/12/31	METRRIO	10324624000118	1.127.712,54	BRMGRPRDBS068	brAA	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	11/08/21	15/08/31	CSAN	50746577000115	1.082.690,40	BRCNSANDBS040	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	11/08/21	15/06/27	AUTOPIST	09336431000106	1.277.951,52	BRAPRBDDBS023	brAAA	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	17/08/21	15/05/30	NORTE EN	12300288000107	3.105.095,72	BRNTENDBS005	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	18/08/21	15/12/31	METRRIO	10324624000118	1.143.647,60	BRMGRPRDBS068	brAA	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	18/08/21	15/12/31	METRRIO	10324624000118	887.460,73	BRMGRPRDBS068	brAA	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	27/08/21	20/08/31	S LUIZ A	06047087000139	1.059.301,38	BRRDORDBS0A0	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	06/09/21	15/08/31	COMGAS	61856571000117	2.668.221,38	BRCGASDBS0B7	-	AAA(bra)	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	08/09/21	15/05/30	NORTE EN	12300288000107	504.668,39	BRNTENDBS005	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB I A	16/09/21	15/07/26	GUARIROB	04089570000150	659.372,00	BRGRRBDBS034	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB I A	16/09/21	15/07/26	GUARIROB	04089570000150	59.048,24	BRGRRBDBS034	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB I A	16/09/21	15/07/26	GUARIROB	04089570000150	295.241,19	BRGRRBDBS034	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB I A	16/09/21	15/06/24	PROLAGOS	02382073000110	2.234.208,05	BRPRLGDBS037	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB I A	16/09/21	15/04/26	ELETROB	00001180000126	2.036.052,79	BRELETDBS040	brAAA	-	-	-
FIM EMB I A	16/09/21	21/10/26	AUTOBAN	02451848000162	731.290,52	BRANHBDBS0F3	brAAA	-	-	-
FIM EMB I A	17/09/21	01/10/24	EQUATENE	03220438000173	1.463.178,56	BREQTLDBS036	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	17/09/21	15/03/28	BRISANET	04601397000128	1.431.760,73	BRBRSTDBS001	brA+	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	20/09/21	15/09/29	MOV_PART	21314559000166	1.092.011,60	BRMOVIBDS0G1	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	15/12/30	MG050	08822767000108	1.035.723,98	BRRDVIDBS061	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	15/12/30	MG050	08822767000108	1.035.723,98	BRRDVIDBS061	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	21314559000166	1.037.918,22	BRMOVIBDS0H9	brAA+	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/07/39	EDPM	27821748000101	1.876.390,74	BRMGSPDBS017	brAA+	-	AA+(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/02/31	CORSAN	92802784000190	774.247,26	BRRSANDBS055	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/02/31	CORSAN	92802784000190	774.247,26	BRRSANDBS055	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/02/31	CORSAN	92802784000190	257.384,90	BRRSANDBS055	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/02/31	CORSAN	92802784000190	257.384,90	BRRSANDBS055	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/04/26	ECORODOV	08873873000110	750.491,67	BRERDVDBS0H1	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/04/26	ECORODOV	08873873000110	750.491,67	BRERDVDBS0H1	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/04/26	ECORODOV	08873873000110	964.387,98	BRERDVDBS0H1	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/04/26	ECORODOV	08873873000110	374.627,64	BRERDVDBS0H1	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/04/26	ECORODOV	08873873000110	374.627,64	BRERDVDBS0H1	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	10215988000160	3.980.955,09	BRLCAMDBS0R2	brAAA	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	10215988000160	4.034.411,04	BRLCAMDBS0R2	brAAA	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	24/09/21	15/03/24	CCPR	08801621000186	42.199,95	BRCPCPRDBS0D1	-	A.br	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	24/09/21	20/05/25	CEA MODA	45242914000105	1.661.010,16	BRCEABDBS011	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	24/09/21	11/09/23	PANAMERI	59285411000113	1.185.127,53	BRBPANLFI654	brAAA	AAAb	AA(bra)	-



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/01/2023

Fundo	INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING			
	DataAquisição	DataVencimento	Emissor	CNPJEmissor	Financeiro	Cód.ISIN	S&P	Moody's	Fitch	Austin
FIM EMB VI A CRED PRIV	27/09/21	15/01/26	LOCAMERI	10215988000160	1.827.973,80	BRLCAMDBS009	brAAA	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	27/09/21	05/03/24	ENERG TR	28201130000101	2.107.154,56	BRETENDBS061	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	27/09/21	01/04/24	CNH	02992446000175	2.201.996,19	BRCNHCLF317	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	30/09/21	15/09/31	SIMPAR	07415333000120	806.719,49	BRSIMHDBS044	brAA+	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	04/10/21	15/12/31	METRORIO	10324624000118	605.532,60	BRMGPRDBS068	brAA	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	34623550000189	5.100.278,25	BRTCIDBS009	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB I A	20/10/21	20/10/25	DAYCOVAL	62232889000190	2.446.222,25	BRDAYCLFNKX1	brAA+	AA.br	AA(bra)	-
FIM EMB I A	20/10/21	20/10/24	DAYCOVAL	62232889000190	1.361.553,29	BRDAYCLFNKX3	brAA+	AA.br	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/10/21	15/12/35	CART	10531501000158	2.568.465,51	BRRPADBS033	brAA+	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	22/10/21	15/12/35	CART	10531501000158	791.087,38	BRRPADBS033	brAA+	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	25/10/21	15/03/26	VIX LOGI	32681371000172	1.047.945,28	BRVXLDBS047	-	-	A+(bra)	-
FIM EMB I A	27/10/21	15/10/29	CONT GLO	07802794000156	2.170.042,47	BRGGBDPS014	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	18903785000178	795.800,21	BRHARGDBS003	brAAA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	18903785000178	1.153.119,78	BRHARGDBS003	brAAA	-	-	-
FIM EMB I A	28/10/21	07/11/23	TOYOTA	03215790000110	2.573.416,77	BRBTOYLF2F4	brAAA	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	04/11/21	15/07/39	UTE GNA	23449511000190	3.100.620,29	BRUNEGDBS007	brAA	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/11/21	15/10/28	LIGHT	60444437000146	1.537.726,66	BRLIGHDBS020	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	12/11/21	15/10/31	VAMOS	23373000000132	2.041.966,63	BRVAMODBS074	brAA+	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	18/11/21	15/10/31	HIDRO BR	12648327000153	3.928.785,82	BRHBSADBS010	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/11/21	15/06/39	ANEMUS	38482780000126	1.692.263,73	BRANEMDBS007	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	26/11/21	15/04/26	ECORODOV	08873873000110	2.136.490,29	BRERDVDBS0H1	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	30/11/21	15/06/39	ANEMUS	38482780000126	2.201.300,28	BRANEMDBS007	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	30/11/21	15/03/28	BRISANET	04601397000128	815.995,97	BRBRSTDBS001	brA+	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	03/12/21	11/06/24	BNBMB	07237373000120	574.604,10	BRBNBRLF005	brAAA	AA.br	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	06/12/21	15/12/35	TESC	01115535000170	2.498.415,46	BRJCJENDBS009	-	-	A+(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	09/12/21	15/11/25	QUATA	60855574000173	2.391.781,19	BRQUATDBS019	-	-	A(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	09/12/21	15/07/39	EDPM	27821748000101	3.265.631,22	BRMGSPDBS017	brAA+	-	AA+(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	20/12/21	15/11/35	ORIZON	03279285000130	2.004.972,59	BRORMADBS023	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	06/01/22	15/09/41	TUCANOHO	35714529000151	53.616,10	BRTNHLDBS002	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	06/01/22	15/09/41	TUCANOHO	35714529000151	318.479,62	BRTNHLDBS002	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/01/22	15/03/26	VIX LOGI	32681371000172	1.028.677,65	BRVXLDBS047	-	-	A+(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	13/01/22	15/07/30	PARANAGU	01691945000160	1.249.064,65	BRPASNDBS018	brAA	-	-	-
FIM EMB I A	19/01/22	19/01/24	BES INV	34111187000112	1.154.460,81	BRINTLLFI6T5	brAAA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/01/22	15/07/34	RT BANDE	10647979000148	324.659,83	BRCRBDDBS041	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/01/22	15/07/34	RT BANDE	10647979000148	1.933.234,38	BRCRBDDBS082	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	15/12/35	CART	10531501000158	328.763,59	BRRPADBS033	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	15/12/35	CART	10531501000158	318.489,72	BRRPADBS033	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	37070559000106	3.761.411,90	BRIPILDBS008	-	-	AA+(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/02/22	15/10/36	HOLDARAG	18903785000178	2.108.080,04	BRHARGDBS003	brAAA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	14/02/22	15/12/35	CART	10531501000158	760.265,79	BRRPADBS033	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	14/02/22	15/12/35	CART	10531501000158	678.074,89	BRRPADBS033	brAA+	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	25/03/22	15/03/44	GBS PART	41774224000138	2.066.822,62	BRGBSPDBS002	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/03/22	15/03/44	GBS PART	41774224000138	3.520.135,84	BRGBSPDBS002	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/03/22	15/06/39	ANEMUS	38482780000126	1.010.154,75	BRANEMDBS007	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	12/04/22	08/04/27	UNIGEL P	05303439000107	850.182,06	BRUGELDBS001	brAA+	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	19/04/22	16/04/29	VERT-10	42945876000150	1.195.103,51	BRVCCSDBS007	-	-	AAAs(f)(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	26/04/22	15/04/24	LIGHT	60444437000146	2.084.762,87	BRLIGHDBS108	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	06/05/22	15/07/30	PARANAGU	01691945000160	2.586.895,31	BRPASNDBS018	brAA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	06/05/22	15/07/30	PARANAGU	01691945000160	1.276.237,92	BRPASNDBS018	brAA	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	12/05/22	15/04/27	BRKA	24396489000120	2.302.554,51	BRBRKPDBS071	-	A+.br	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	12/05/22	15/07/30	PARANAGU	01691945000160	1.529.855,10	BRPASNDBS018	brAA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	12/05/22	15/09/41	TUCANOHO	35714529000151	1.777.909,82	BRTNHLDBS002	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	19/05/22	13/05/28	CEA MODA	45242914000105	513.612,21	BRCEABDBS037	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	26/05/22	10/05/27	GUAR	08402943000152	2.516.615,65	BRGUARDDBS071	-	-	A+(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	15/10/36	HOLDARAG	18903785000178	2.295.699,16	BRHARGDBS003	brAAA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	15/12/35	IP SUL C	37070559000106	530.074,96	BRIPILDBS008	-	-	AA+(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	15/07/30	PARANAGU	01691945000160	1.176.602,59	BRPASNDBS018	brAA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	03/03/22	15/09/41	AESTUCAN	34623550000189	2.718.448,31	BRTCIDBS009	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	04/03/22	15/06/25	ECORODOV	08873873000110	2.477.924,99	BRERDVDBS0E8	brAAA	A2.br	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	04/03/22	15/06/25	ECORODOV	08873873000110	1.021.270,60	BRERDVDBS0E8	brAAA	A2.br	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	07/03/22	15/12/36	VIA BRAS	32321304000147	3.144.685,61	BRVIMTDBS019	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	07/03/22	15/12/36	VIA BRAS	32321304000147	2.517.096,07	BRVIMTDBS019	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	07/06/22	15/12/35	TESC	01115535000170	777.546,25	BRJCJENDBS009	-	-	A+(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	07/06/22	15/03/28	BRISANET	04601397000128	486.583,35	BRBRSTDBS001	brA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	15/12/35	IP SUL C	37070559000106	424.059,97	BRIPILDBS008	-	-	AA+(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	15/12/35	TESC	01115535000170	487.704,39	BRJCJENDBS009	-	-	A+(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	15/06/39	ANEMUS	38482780000126	257.911,85	BRANEMDBS007	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	13/06/22	15/09/31	SIMPAR	07415333000120	1.736.569,86	BRSIMHDBS044	brAA+	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	13/06/22	15/06/31	VAMOS	23373000000132	829.484,90	BRVAMODBS041	brAA+	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	13/06/22	15/06/31	VAMOS	23373000000132	67.673,59	BRVAMODBS041	brAA+	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	13/06/22	15/03/29	OMEGA GE	09149503000106	853.830,96	BROMGEDBS069	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	13/06/22	15/03/29	OMEGA GE	09149503000106	965.509,21	BROMGEDBS069	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	20/06/22	15/04/28	PAMPASUL	04739720000124	2.568.419,91	BRUTPSDBS005	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	21/06/22	15/07/34	RT BANDE	10647979000148	1.185.008,39	BRCRBDDBS041	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	27/06/22	07/07/24	LAGE	05040481000182	2.174.586,52	BRLAGELFI008	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	14/07/22	15/09/46	ENGIE	02474103000119	46.889,73	BREGIEDBS0B3	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	14/07/22	15/09/46	ENGIE	02474103000119	2.755.240,38	BREGIEDBS0B3	-	-	AAA(bra)	-



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/01/2023

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS							INFORMAÇÕES DE RATING			
Fundo	DataAquisição	DataVencimento	Emissor	CNPJEmissor	Financeiro	Cód.ISIN	S&P	Moody's	Fitch	Austin
FIM EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	15/07/34	RT BANDE	10647979000148	2.905.705,50	BRCRBDDBS041	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	15/10/31	VAMOS	23373000000132	1.974.581,73	BRVAMODBS074	brAA+	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	15/10/31	VAMOS	23373000000132	1.480.425,80	BRVAMODBS074	brAA+	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	25/07/22	22/07/27	CM HOSPI	12420164000157	1.621.179,33	BRVVEODBS044	-	AA.br	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	26/07/22	10/01/28	AMBIPAR	12648266000124	2.375.178,21	BRAMBPDBS024	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	26/07/22	26/04/26	GGSH PAR	10808204000107	2.403.328,48	BRGGSHDDBS016	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	27/07/22	15/03/44	GBS PART	41774224000138	2.825.160,45	BRGBSPDDBS002	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/07/22	18/07/25	1V11	42937550000181	1.638.610,87	BRVCESDBS003	brAAA(sf)	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	29/07/22	15/09/41	AESTUCAN	34623550000189	1.499.481,81	BRTCIDBS009	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	29/07/22	15/10/31	ENERGISA	00864214000106	1.810.094,61	BRENGIDBS000	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	29/07/22	15/10/36	UHESIMAO	27352303000120	1.537.952,79	BRUHSMDBS023	brAAA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	08/08/22	15/11/25	QUATA	60855574000173	1.163,32	BRQUATDDBS019	-	-	A(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	15/07/29	GUARIROB	04089570000150	489.203,71	BRGRRRDBS042	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	15/03/29	CAGECE	07040108000157	1.455.610,29	BRCAECDBS019	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	15/03/29	CAGECE	07040108000157	2.425.298,86	BRCAECDBS019	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	15/05/30	NORTE EN	12300288000107	1.574.228,13	BRNTENDBS005	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	15/05/30	NORTE EN	12300288000107	772.058,32	BRNTENDBS005	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	23/08/22	15/08/32	PETRJ	02031413000169	8.342.201,61	BRPEJADBS008	brAA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	30/08/22	15/08/29	TRBR	23438929000100	8.849.161,44	BRCONXDBS009	brA+	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	02/09/22	02/09/29	AEGEA SA	08827501000158	1.819.623,59	BRAEGPDDBS095	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	27/09/22	15/11/25	QUATA	60855574000173	50.022,66	BRQUATDDBS019	-	-	A(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/09/22	28/09/27	B.BRASIL	00000000000191	4.448.479,70	BRBBASLFINB9	-	AAA.br	AA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	06/10/22	13/09/32	NTRASSUD	04992714000184	1.766.024,64	BRNTSDDDBS055	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	14/10/22	15/11/25	QUATA	60855574000173	34.899,53	BRQUATDDBS019	-	-	A(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	03/11/22	15/03/29	ANET	01778972000174	2.288.387,35	BRANETDDBS002	brA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	03/11/22	15/11/36	ITAPOA T	01317277000105	4.329.901,98	BRITPODBS041	-	AA.br	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	08/11/22	27/10/27	CM HOSPI	12420164000157	1.029.727,25	BRVVEODBS069	-	AA.br	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	08/11/22	15/06/42	BRK AMBI	39590673000101	4.474.425,97	BRRRMSADBS024	-	AA-.br	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	09/11/22	15/04/38	RDVE	42596330000131	1.485.636,26	BRRDVEDBS003	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	09/11/22	15/07/39	UTE GNA	23449511000190	1.463.615,17	BRUNEGDDBS007	brAA	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	11/11/22	15/10/40	RAHOLD	40480481000102	2.588.483,39	BRRAHDDBS000	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	11/11/22	15/10/40	RAHOLD	40480481000102	9.599.085,39	BRRAHDDBS000	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	15/07/29	GUARIROB	04089570000150	3.598.365,05	BRGRRRDBS042	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	15/07/29	GUARIROB	04089570000150	1.619.807,83	BRGRRRDBS042	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	15/07/29	GUARIROB	04089570000150	1.326.285,61	BRGRRRDBS042	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	15/09/34	BRKA	24396489000120	1.316.751,30	BRBRKPDDBS055	-	Aa3.br	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	15/09/34	BRKA	24396489000120	1.602.867,82	BRBRKPDDBS055	-	Aa3.br	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	15/09/34	BRKA	24396489000120	1.312.649,27	BRBRKPDDBS055	-	Aa3.br	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	01/12/22	15/06/39	ANEMUS	38482780000126	1.599.505,96	BRANEMDDBS007	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	15/09/31	MOV_PART	21314559000166	2.012.012,84	BRMOVIDBS0H9	brAA+	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	15/09/31	MOV_PART	21314559000166	2.134.428,60	BRMOVIDBS0H9	brAA+	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	15/09/31	MOV_PART	21314559000166	1.556.877,33	BRMOVIDBS0H9	brAA+	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	15/10/36	PAMPASUL	04739720000124	2.267.105,08	BRUTPSDDBS039	brAAA	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/12/22	15/12/35	IP SUL C	37070559000106	2.927.073,92	BRPILDBS008	-	-	AA+(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	20/12/22	16/12/29	CSMG	17281106000103	2.026.820,04	BRCMSGDBS0K4	-	-	AA+(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	15/11/36	ITAPOA T	01317277000105	2.943.143,00	BRITPODBS041	-	AA.br	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	15/04/38	RDVE	42596330000131	1.719.252,31	BRRDVEDBS003	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	15/06/39	ANEMUS	38482780000126	3.005.578,03	BRANEMDDBS007	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	26/01/23	20/01/26	CELG	01540302000104	3.086.243,70	BRCGOSDDBS011	-	-	AA+(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	FIDC VERDECARD SN3	26.722.650/0001-34	2.468.500,99	BRVDRCCTF024	brAAA(sf)	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	FIDC CREDZ SN4	24.761.946/0001-39	10.436,08	BRCRDZCTF074	-	-	AAAsf(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	FIDC CREDZ SN6	24.761.946/0001-39	2.518.417,92	BRCRDZCTF040	brAA (sf)	-	A+sf(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	FIDC VERDECARD SN5	26.722.650/0001-34	466.937,65	BRVDRCCTF040	brAAA(sf)	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	FIDC VERDECARD SN6	26.722.650/0001-34	1.400.840,15	BRVDRCCTF057	brAAA(sf)	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	FIDC VERDECARD SN8	26.722.650/0001-34	1.500.868,07	BRVDRCCTF073	brAAA(sf)	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	RB CAP CREDIT AL SN3	32.724.252/0001-50	757.297,83	BR08LCTF045	brAA-(sf)	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	BR ELETRO FIDC S1	35.818.950/0001-02	3.434.269,87	BR0402CTF000	-	-	Aasf(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	INSS CONS PDL IFIDC	40.365.950/0001-34	1.911.995,31	BR082XCTF015	-	-	AAAsf(bra)	-

Observação: Em janeiro de 2023, dois ativos da carteira de crédito da EMBRAER PREV sofreram rebaixamentos de suas classificações de risco: o rating de LAMEA6 e BTOW15 (Americanas) foi revisado pela Fitch de AAA(bra) para D, portanto, abaixo da classificação mínima de crédito estabelecida pela Política de Investimentos do Plano Embraer Prev, e o rating de CELG12 (CELG D) foi revisado pela Fitch de AAA(bra) para AA+(bra), 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.



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 **4.236.867.608,15**

Tópico do Enquadramento	Limite	Aplicação Atual	Valor Limite	% Aplicado	Status
% do Segmento RF/PL PLANO	100,00%	3.528.996.914,79	4.236.867.608,15	83,29%	Enquadrado
% do PL em Títulos de Emissão do Tesouro Nacional e/ou do BACEN	100,00%	2.837.999.097,79	4.236.867.608,15	66,98%	Enquadrado
% do PL em Títulos RF1, exceto títulos do Tesouro Nacional	80,00%	690.997.817,00	3.389.494.137,03	16,31%	Enquadrado
% do PL em FIDC	20,00%	Verificar Rel. de Diversificação de FIDC's	847.373.534,26	0,00%	Enquadrado
% do PL em uma mesma pessoa jurídica não-financeira	10,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Não Financ.	423.686.767,13	0,00%	Enquadrado
% do PL em Instituições Financeiras	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Financ.	1.059.216.902,04	0,00%	Enquadrado
% de uma mesma Série de Debêntures	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Debêntures	1.059.216.902,04	0,00%	Enquadrado
% do PL em RV	70,00%	537.978.794,97	2.965.807.275,20	12,70%	Enquadrado
% do capital votante de uma empresa	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação RV	1.059.216.902,04	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Imobiliários	20,00%	102.668.833,39	847.373.534,26	2,42%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Empréstimos	15,00%	27.417.427,41	635.530.166,48	0,65%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Estruturados	20,00%	0,00	847.373.534,26	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos no Exterior	10,00%	28.661.481,87	423.686.767,13	0,68%	Enquadrado

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

6.2. Relatório de Túnel de Preços

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 02 DE JANEIRO DE 2023 À 31 DE JANEIRO DE 2023



FIM EMB I A

DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	TX. IND.	FONTE ANBIMA			FORA DO TÚNEL
									TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	
02/01/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/03/2023	Venda	0,0033%	0,0009%	-0,0871%	0,0479%	0,0024%	NÃO

FIM EMB II A

DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	TX. IND.	FONTE ANBIMA			FORA DO TÚNEL
									TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	
03/01/2023	FIM EMB II A	BNP	TERRA	LFT	01/09/2025	Compra	0,0563%	0,0566%	0,0425%	0,0917%	-0,0003%	NÃO
04/01/2023	FIM EMB II A	BNP	TERRA	LFT	01/09/2023	Compra	-0,0006%	-0,0010%	-0,0651%	0,0121%	0,0004%	NÃO

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

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



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
02-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBDC4	14,73	30.800,00	453.706,09	14,66	14,74	14,99	40.123,00
02-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	22,56	4.700,00	106.044,72	22,08	22,53	23,20	26.744,00
02-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	11,28	4.700,00	53.026,02	11,20	11,27	11,82	25.405,00
02-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,72	300,00	1.415,12	4,63	4,69	5,00	31.718,00
02-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,67	3.600,00	16.823,58	4,63	4,69	5,00	31.718,00
02-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	17,71	2.000,00	35.422,89	17,39	17,67	18,27	14.506,00
02-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	24,27	13.900,00	337.342,34	24,04	24,26	24,53	54.346,00
02-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	LREN3	19,39	1.800,00	34.905,47	19,06	19,37	20,33	26.620,00
02-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	LREN3	19,33	900,00	17.397,00	19,06	19,37	20,33	26.620,00
02-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	LWSA3	6,39	5.500,00	35.145,00	6,35	6,47	6,82	14.697,00
02-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	10,98	100,00	1.097,91	10,55	10,78	11,45	17.086,00
02-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ONCO3	5,59	3.000,00	16.760,16	5,54	5,68	5,96	4.098,00
02-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ONCO3	5,76	400,00	2.305,98	5,54	5,68	5,96	4.098,00



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO
E CONTROLE DE RISCO - JANEIRO DE 2023



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 02 DE JANEIRO DE 2023 À 31 DE JANEIRO 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
02-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	PETZ3	5,90	6.000,00	35.401,78	5,80	5,91	6,19	10.906,00
02-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	RDOR3	27,08	700,00	18.956,00	27,00	27,43	29,39	18.876,00
02-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	RDOR3	27,42	3.200,00	87.729,47	27,00	27,43	29,39	18.876,00
02-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	32,61	1.100,00	35.874,76	31,66	32,58	33,06	12.818,00
02-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	51,12	1.400,00	71.568,68	50,53	51,04	52,00	25.948,00
02-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	9,28	1.100,00	10.203,41	9,25	9,36	9,65	14.925,00
02-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	9,38	3.800,00	35.638,24	9,25	9,36	9,65	14.925,00
03-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	14,39	1.100,00	15.833,68	14,12	14,32	14,46	6.777,00
03-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBDC4	14,29	9.900,00	141.491,65	13,95	14,27	14,78	78.103,00
03-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	21,70	2.500,00	54.259,70	21,11	21,69	22,51	40.868,00
03-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	21,80	1.700,00	37.060,00	21,11	21,69	22,51	40.868,00
03-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	40,25	300,00	12.075,34	39,57	40,20	41,19	47.262,00
03-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	11,25	1.000,00	11.253,28	10,96	11,23	11,50	25.707,00
03-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENJU3	0,94	12.300,00	11.562,00	0,91	0,92	0,95	923,00
03-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQT13	25,86	700,00	18.103,53	25,36	25,76	26,32	24.807,00
03-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,51	1.700,00	7.667,00	4,50	4,65	4,80	80.780,00
03-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	17,14	2.000,00	34.281,87	16,58	17,02	17,68	20.652,00
03-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	24,10	3.100,00	74.720,44	23,83	24,06	24,65	59.832,00
03-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	LTRE3	19,01	2.800,00	53.224,00	18,68	19,05	19,64	38.546,00
03-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	10,32	1.200,00	12.385,67	10,08	10,40	10,84	24.120,00
03-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ONCO3	5,52	1.400,00	7.728,00	5,44	5,63	5,94	2.890,00
03-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	PETZ3	5,70	5.500,00	31.324,47	5,59	5,81	6,04	14.486,00
03-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	34,59	1.900,00	65.729,30	34,25	35,24	36,81	37.941,00
03-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	RDOR3	26,19	1.300,00	34.043,32	25,33	26,27	27,57	18.609,00
03-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	31,74	2.200,00	69.825,91	30,75	31,78	33,62	13.752,00
03-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	31,32	500,00	15.661,35	30,75	31,78	33,62	13.752,00
03-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	50,43	1.800,00	90.772,24	49,63	50,54	51,34	30.704,00
03-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	8,92	1.200,00	10.708,47	8,88	9,21	9,60	20.135,00
03-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	8,94	2.900,00	25.913,78	8,88	9,21	9,60	20.135,00
03-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	49,06	300,00	14.717,14	48,42	49,32	49,85	26.189,00
03-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	14,40	700,00	10.080,75	14,20	14,43	14,84	15.906,00
03-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	9,22	2.900,00	26.751,40	9,14	9,43	9,84	17.496,00
04-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ALSO3	15,54	2.400,00	37.297,74	15,35	15,54	15,75	9.663,00
04-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	14,36	1.500,00	21.532,87	14,00	14,30	14,50	13.156,00
04-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	33,07	300,00	9.920,70	32,56	32,95	33,26	34.374,00
04-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBDC4	13,89	8.700,00	120.833,72	13,66	13,92	14,23	86.316,00
04-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	21,93	8.700,00	190.803,78	21,38	21,92	22,33	29.998,00
04-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	BRML3	7,78	1.700,00	13.230,67	7,67	7,76	7,86	25.334,00
04-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	40,97	400,00	16.387,10	40,53	41,02	41,73	48.257,00
04-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	11,43	1.600,00	18.293,90	11,02	11,35	11,52	24.895,00
04-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENJU3	0,92	5.800,00	5.336,00	0,91	0,93	0,97	2.089,00
04-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENJU3	0,94	2.300,00	2.162,28	0,91	0,93	0,97	2.089,00
04-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQT13	25,53	1.100,00	28.081,26	25,30	25,49	25,75	29.403,00
04-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,58	7.500,00	34.376,73	4,46	4,57	4,65	89.124,00
04-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	16,69	5.600,00	93.489,42	16,44	16,70	16,98	24.633,00
04-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	24,04	3.400,00	81.732,53	23,88	24,07	24,52	60.055,00
04-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	LTRE3	19,01	1.800,00	34.226,55	18,78	19,07	19,39	46.802,00
04-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ONCO3	5,58	6.900,00	38.532,74	5,39	5,56	5,67	4.370,00
04-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	PETZ3	5,79	1.400,00	8.099,95	5,59	5,78	5,91	20.479,00
04-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	PETZ3	5,74	4.300,00	24.691,24	5,59	5,78	5,91	20.479,00
04-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	34,23	1.400,00	47.924,37	33,10	34,13	34,75	41.119,00
04-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	34,25	1.300,00	44.526,22	33,10	34,13	34,75	41.119,00
04-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	26,31	500,00	13.157,00	25,55	26,31	26,93	21.611,00
04-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	30,97	1.600,00	49.553,59	30,05	31,17	31,86	13.809,00
04-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	31,36	1.500,00	47.033,90	30,05	31,17	31,86	13.809,00
04-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	31,34	700,00	21.938,00	30,05	31,17	31,86	13.809,00
04-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	50,50	1.500,00	75.756,70	49,86	50,56	51,16	27.298,00
04-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	9,37	3.300,00	30.931,04	9,00	9,35	9,62	23.143,00
04-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	49,96	600,00	29.974,06	49,70	50,06	50,73	18.006,00
04-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	14,64	1.200,00	17.563,16	14,23	14,55	14,75	22.481,00
04-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	9,18	3.700,00	33.970,93	8,93	9,13	9,35	22.090,00
04-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	LTRE3	19,31	2.667,00	51.490,18	18,78	19,07	19,39	46.802,00
04-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	LTRE3	19,00	5.366,00	101.938,75	18,78	19,07	19,39	46.802,00
04-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	LTRE3	19,08	2.074,00	39.582,06	18,78	19,07	19,39	46.802,00
04-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	LTRE3	19,26	889,00	17.120,75	18,78	19,07	19,39	46.802,00
04-01-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	RCRB11	118,40	369,00	43.688,09	117,17	119,01	122,46	1.057,00
05-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBDC4	14,47	7.400,00	107.075,02	14,07	14,36	14,71	65.627,00
05-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	24,64	4.700,00	115.814,73	24,02	24,63	24,91	61.434,00
05-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	LTRE3	18,50	2.300,00	42.550,00	18,38	18,65	19,41	68.761,00
05-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	LTRE3	18,53	3.400,00	62.996,37	18,38	18,65	19,41	68.761,00
05-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	34,79	200,00	6.958,62	34,13	34,84	35,29	28.300,00
05-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	34,93	900,00	31.441,37	34,13	34,84	35,29	28.300,00
05-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	31,19	1.500,00	46.789,17	29,85	30,92	32,09	22.068,00
05-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	31,80	200,00	6.360,36	29,85	30,92	32,09	22.068,00
05-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	9,58	11.900,00	114.052,74	9,26	9,57	9,72	30.545,00
05-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	9,53	2.900,00	27.651,00	9,26	9,57	9,72	30.545,00
05-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	9,50	3.500,00	33.245,49	9,26	9,57	9,72	30.545,00
05-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	LTRE3	18,47	1.264,00	23.346,08	18,38	18,65	19,41	68.761,00
05-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	LTRE3	18,60	263,00	4.891,80	18,38	18,65	19,41	68.761,00
05-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	LTRE3	18,45	4.505,00	83.114,59	18,38	18,65	19,41	68.761,00
05-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	LTRE3	18,56	3.918,00	72.707,11	18,38	18,65	19,41	68.761,00
05-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	LTRE3	18,58	785,00	14.586,49	18,38	18,65	19,41	68.761,00
05-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	LTRE3	18,62	5.371,00	100.021,27	18,38	18,65	19,41	68.761,00
05-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	LTRE3	18,63	2.040,00	38.002,94	18,38	18,65	19,41	68.761,00
05-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	LTRE3	18,75	158,00	2.962,50	18,38	18,65	19,41	68.761,00



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



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 02 DE JANEIRO DE 2023 À 31 DE JANEIRO 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
05-01-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	TRXF11	104,73	4.780,00	500.594,58	102,09	104,53	104,80	3.643,00
06-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	16,64	1.700,00	28.293,99	16,25	16,67	17,00	14.171,00
06-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	14,51	1.900,00	27.577,94	14,45	14,58	14,73	9.165,00
06-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	22,83	5.400,00	123.295,90	22,50	22,84	23,12	19.433,00
06-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	BRML3	8,23	1.400,00	11.526,28	8,09	8,23	8,29	18.064,00
06-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	41,07	700,00	28.748,34	40,86	41,11	41,85	30.843,00
06-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	40,99	3.500,00	143.477,64	40,86	41,11	41,85	30.843,00
06-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	41,14	1.900,00	78.172,11	40,86	41,11	41,85	30.843,00
06-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,25	3.200,00	39.196,84	11,69	12,23	12,45	27.357,00
06-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,25	2.100,00	25.735,36	11,69	12,23	12,45	27.357,00
06-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,28	17.200,00	211.136,93	11,69	12,23	12,45	27.357,00
06-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	25,62	1.400,00	35.874,84	25,48	25,62	25,84	21.721,00
06-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGT11	17,91	2.700,00	48.370,06	17,27	17,84	18,10	18.958,00
06-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB8	25,24	2.400,00	60.569,61	24,80	25,05	25,31	50.676,00
06-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	19,26	2.400,00	46.224,97	18,78	19,23	19,58	37.786,00
06-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	LWSA3	6,44	1.600,00	10.301,71	6,35	6,52	6,85	25.248,00
06-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	12,22	1.000,00	12.223,00	11,54	12,05	12,34	24.687,00
06-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	5,88	2.200,00	12.945,53	5,82	5,93	6,16	3.441,00
06-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	6,13	2.400,00	14.721,23	5,95	6,18	6,33	14.485,00
06-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	34,83	1.900,00	66.182,48	33,90	34,80	35,41	27.066,00
06-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	31,30	1.100,00	34.430,00	30,87	31,45	31,87	8.209,00
06-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	31,44	1.100,00	34.585,91	30,87	31,45	31,87	8.209,00
06-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	10,04	2.500,00	25.108,45	9,61	10,03	10,29	16.560,00
06-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	50,12	800,00	40.094,92	49,60	50,12	50,70	11.867,00
06-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	14,82	1.700,00	25.198,87	14,61	14,82	15,06	12.348,00
06-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	9,72	1.800,00	17.491,96	9,36	9,68	9,81	12.008,00
06-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	BRML3	8,23	13.576,00	111.794,93	8,09	8,23	8,29	18.064,00
06-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	BRML3	8,25	6.517,00	53.759,73	8,09	8,23	8,29	18.064,00
06-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	ELET3	41,03	2.598,00	106.592,83	40,86	41,11	41,85	30.843,00
06-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	ELET3	41,28	1.576,00	65.058,94	40,86	41,11	41,85	30.843,00
06-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GGPS3	11,26	3.222,00	36.293,16	11,00	11,30	11,55	9.572,00
06-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GGPS3	11,40	368,00	4.196,63	11,00	11,30	11,55	9.572,00
06-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	LREN3	19,22	1.879,00	36.115,64	18,78	19,23	19,58	37.786,00
06-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	LREN3	19,27	6.886,00	132.712,10	18,78	19,23	19,58	37.786,00
06-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	21,48	1.809,00	38.865,35	20,81	21,32	21,57	16.294,00
06-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	21,42	551,00	11.802,42	20,81	21,32	21,57	16.294,00
06-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	21,27	1.546,00	32.889,89	20,81	21,32	21,57	16.294,00
06-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	21,17	250,00	5.291,71	20,81	21,32	21,57	16.294,00
09-01-23	FIA RVA EMB II	Compra	AMER3	10,99	45.900,00	504.439,00	10,07	10,75	11,21	28.803,00
09-01-23	FIA RVA EMB II	Compra	BPAC11	22,83	10.900,00	248.844,58	22,23	22,60	22,99	18.421,00
09-01-23	FIA RVA EMB II	Compra	ELET3	41,51	17.100,00	709.797,62	40,74	41,35	41,88	27.946,00
09-01-23	FIA RVA EMB II	Compra	ENEV3	12,23	93.400,00	1.142.369,70	11,98	12,13	12,61	21.263,00
09-01-23	FIA RVA EMB II	Compra	GGBR4	31,11	14.900,00	463.581,69	30,21	30,96	31,35	32.157,00
09-01-23	FIA RVA EMB II	Compra	JBSS3	22,87	32.600,00	745.723,79	21,92	22,70	23,02	21.948,00
09-01-23	FIA RVA EMB II	Compra	LREN3	19,56	56.100,00	1.097.567,93	18,78	19,36	19,84	33.621,00
09-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	RENT1	10,22	464,00	4.740,80	9,51	10,16	10,75	115,00
09-01-23	FIA RVA EMB II	Compra	TOTS3	28,29	10.200,00	288.521,86	27,22	28,01	28,57	23.453,00
09-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	22,74	3.100,00	70.492,35	22,23	22,60	22,99	18.421,00
09-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	41,04	100,00	4.104,31	40,74	41,35	41,88	27.946,00
09-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	41,29	200,00	8.258,61	40,74	41,35	41,88	27.946,00
09-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	41,25	100,00	4.125,43	40,74	41,35	41,88	27.946,00
09-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,16	4.400,00	53.510,63	11,98	12,13	12,61	21.263,00
09-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	25,94	2.700,00	70.043,20	25,33	25,94	26,36	19.264,00
09-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	25,88	1.400,00	36.234,37	25,33	25,94	26,36	19.264,00
09-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,22	37.600,00	158.762,04	4,14	4,34	4,70	139.076,00
09-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	12,29	5.800,00	71.253,43	11,86	12,26	12,49	22.442,00
09-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ONCO3	5,73	3.000,00	17.175,73	5,54	5,76	5,88	5.061,00
09-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETRA	23,77	3.200,00	76.068,18	23,25	23,77	24,00	62.802,00
09-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	35,97	2.000,00	71.932,51	35,63	36,02	36,65	28.547,00
10-01-23	FIA RVA EMB II	Compra	ABEV3	14,52	23.000,00	333.870,00	14,25	14,43	14,60	27.700,00
10-01-23	FIA RVA EMB II	Compra	ENEV3	12,40	98.700,00	1.223.692,92	11,80	12,30	12,52	25.238,00
10-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	GMAT3	6,32	153.100,00	967.766,32	6,08	6,26	6,42	14.233,00
10-01-23	FIA RVA EMB II	Compra	RENT3	53,57	9.500,00	508.894,24	51,28	52,94	54,10	30.600,00
10-01-23	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	50,08	8.600,00	430.708,00	49,78	50,08	50,69	13.818,00
10-01-23	FIA RVA EMB II	Compra	VALE3	93,64	5.600,00	524.368,00	92,34	93,43	93,90	58.129,00
10-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,46	2.800,00	34.891,08	11,80	12,30	12,52	25.238,00
10-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,36	5.200,00	64.251,21	11,80	12,30	12,52	25.238,00
10-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,23	2.100,00	25.683,00	11,80	12,30	12,52	25.238,00
10-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	26,06	2.400,00	62.546,61	25,53	26,03	26,30	16.052,00
10-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	25,85	1.000,00	25.850,00	25,53	26,03	26,30	16.052,00
10-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	26,21	900,00	23.592,07	25,53	26,03	26,30	16.052,00
10-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,32	16.400,00	70.826,97	4,16	4,31	4,39	53.370,00
10-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	12,68	2.047,00	25.954,05	12,12	12,55	12,78	11.967,00
10-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	14,78	12.060,00	178.242,60	14,45	14,77	15,03	17.212,00
10-01-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	AIEC11	66,54	100,00	6.654,00	66,35	66,60	66,98	503,00
10-01-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	BMCL11	98,06	1.060,00	103.944,16	95,01	97,97	99,99	21,00
11-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	17,90	7.900,00	141.397,63	17,65	18,14	18,29	19.859,00
11-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	18,10	2.000,00	36.190,38	17,65	18,14	18,29	19.859,00
11-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,60	4.200,00	52.909,08	12,29	12,63	12,76	17.736,00
11-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	26,78	2.000,00	53.565,45	26,08	26,99	27,49	24.370,00
11-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	18,43	3.800,00	70.040,10	17,97	18,44	18,84	11.939,00
11-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	38,30	1.800,00	68.933,30	36,44	37,98	39,02	44.714,00
11-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	38,84	1.300,00	50.494,02	36,44	37,98	39,02	44.714,00
11-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	RDOR3	26,81	6.700,00	179.640,26	26,27	26,82	27,52	19.685,00
11-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	54,26	3.900,00	211.603,56	53,07	54,31	55,73	31.239,00



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



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

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

DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
11-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ALSO3	17,95	1.057,00	18.973,15	17,65	18,14	18,29	19.859,00
11-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ALSO3	17,72	1.649,00	29.220,28	17,65	18,14	18,29	19.859,00
11-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ALSO3	17,99	2.281,00	41.027,58	17,65	18,14	18,29	19.859,00
11-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	AURE3	14,64	936,00	13.705,99	14,13	14,61	14,83	10.234,00
11-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	AURE3	14,62	9.955,00	145.509,34	14,13	14,61	14,83	10.234,00
11-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	12,96	1.240,00	16.076,24	12,61	12,94	13,19	14.401,00
11-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	12,96	1.654,00	21.431,22	12,61	12,94	13,19	14.401,00
11-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	12,98	2.894,00	37.568,72	12,61	12,94	13,19	14.401,00
11-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	12,90	1.240,00	16.001,86	12,61	12,94	13,19	14.401,00
12-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	AMER3	2,63	58.500,00	154.124,90	2,40	2,75	2,95	154.569,00
12-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	14,95	1.300,00	19.435,00	14,68	15,05	15,29	18.322,00
12-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,03	9.400,00	141.320,15	14,68	15,05	15,29	18.322,00
12-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	27,85	1.900,00	52.909,61	27,24	27,69	28,19	22.941,00
12-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,56	7.800,00	35.548,44	4,35	4,48	4,69	39.705,00
12-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	LTRE3	21,45	3.600,00	77.202,39	20,01	21,15	21,96	71.712,00
12-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	12,33	3.000,00	37.002,00	12,06	12,32	12,60	22.607,00
12-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	PETZ3	6,31	200,00	1.262,00	6,12	6,31	6,48	11.602,00
12-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRIO3	39,48	900,00	35.535,32	38,83	39,45	39,80	24.084,00
12-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	33,51	1.600,00	53.613,93	32,12	33,18	34,01	15.104,00
12-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	50,37	1.800,00	90.674,26	49,06	50,07	50,60	33.734,00
12-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	BPAC11	22,86	12.313,00	281.495,75	22,49	22,86	23,28	54.372,00
12-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	LTRE3	21,38	9.837,00	210.309,90	20,01	21,15	21,96	71.712,00
13-01-23	FIA RVA EMB II	Compra	BBAS3	35,51	33.200,00	1.178.856,28	34,95	35,56	35,85	35.141,00
13-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	BBDC4	14,89	57.500,00	856.395,00	14,69	14,90	15,05	33.313,00
13-01-23	FIA RVA EMB II	Compra	BEEF3	15,03	17.900,00	268.966,83	14,34	15,07	15,35	29.096,00
13-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	CPFE3	32,17	15.900,00	511.497,04	31,93	32,13	32,33	4.400,00
13-01-23	FIA RVA EMB II	Compra	EGIE3	38,25	42.700,00	1.633.238,38	37,73	38,10	38,83	9.642,00
13-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	HAPV3	4,18	78.400,00	327.516,89	4,10	4,20	4,29	41.671,00
13-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	JBSS3	21,61	28.300,00	611.496,98	21,32	21,55	22,06	19.426,00
13-01-23	FIA RVA EMB II	Compra	LTRE3	20,99	26.000,00	545.638,96	19,97	20,73	21,76	42.896,00
13-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	SOMA3	9,83	56.800,00	558.420,36	9,64	9,77	9,95	12.987,00
13-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	TOTS3	28,09	28.300,00	794.966,74	27,78	28,11	28,49	15.415,00
13-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	17,71	1.900,00	33.644,43	17,53	17,75	18,06	10.275,00
13-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	14,70	5.600,00	82.332,12	14,61	14,78	15,05	7.229,00
13-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	35,69	500,00	17.845,00	34,95	35,56	35,85	35.141,00
13-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	22,37	12.200,00	272.959,11	21,95	22,33	22,90	34.306,00
13-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	41,64	1.000,00	41.635,00	41,42	41,70	42,19	31.361,00
13-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,63	5.700,00	71.976,90	12,30	12,59	12,68	13.324,00
13-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	27,07	4.100,00	111.003,73	26,95	27,11	27,40	15.158,00
13-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	18,03	3.600,00	64.922,55	17,93	18,18	18,75	14.906,00
13-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	18,29	1.900,00	34.748,19	17,93	18,18	18,75	14.906,00
13-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	25,78	3.100,00	79.913,00	25,14	25,68	25,89	37.135,00
13-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	LTRE3	20,18	2.600,00	52.476,09	19,97	20,73	21,76	42.896,00
13-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	12,33	1.600,00	19.723,45	11,97	12,36	12,65	20.425,00
13-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ONCO3	6,61	2.300,00	15.211,00	6,31	6,60	6,69	4.455,00
13-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	6,24	5.700,00	35.571,39	6,11	6,25	6,44	11.366,00
13-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRIO3	38,84	1.500,00	58.262,14	38,60	38,98	39,75	21.245,00
13-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	RDR03	26,36	600,00	15.813,00	26,07	26,32	26,55	9.602,00
13-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	32,81	1.400,00	45.936,70	32,55	32,83	33,37	5.896,00
13-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	53,59	1.600,00	85.747,45	52,77	53,31	53,85	32.144,00
13-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	9,74	4.100,00	39.921,29	9,64	9,77	9,95	12.987,00
13-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	50,54	5.400,00	272.940,51	49,90	50,55	51,06	18.860,00
13-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	14,79	4.600,00	68.052,63	14,67	14,82	15,03	23.363,00
13-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	9,27	2.400,00	22.241,80	9,12	9,28	9,55	11.235,00
13-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	9,24	2.000,00	18.480,91	9,12	9,28	9,55	11.235,00
13-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	BPAC11	22,20	2.316,00	51.415,20	21,95	22,33	22,90	34.306,00
13-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	BPAC11	22,28	1.565,00	34.870,20	21,95	22,33	22,90	34.306,00
13-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	BPAC11	22,34	4.068,00	90.879,72	21,95	22,33	22,90	34.306,00
13-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	ELET3	41,72	1.335,00	55.696,20	41,42	41,70	42,19	31.361,00
13-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	ELET3	41,65	2.670,00	111.213,09	41,42	41,70	42,19	31.361,00
13-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	ELET3	41,63	334,00	13.903,89	41,42	41,70	42,19	31.361,00
13-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	6,34	6.289,00	39.893,69	6,04	6,32	6,43	11.591,00
13-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	LTRE3	20,05	1.200,00	24.062,19	19,97	20,73	21,76	42.896,00
13-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	LTRE3	20,20	208,00	4.201,62	19,97	20,73	21,76	42.896,00
13-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	LTRE3	20,25	333,00	6.743,25	19,97	20,73	21,76	42.896,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ABEV3	13,88	15.500,00	215.140,06	13,77	13,89	14,05	38.305,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ALPA4	13,62	700,00	9.534,00	13,55	13,88	14,42	16.302,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ALSO3	17,66	1.200,00	21.192,00	17,53	17,75	18,06	10.275,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	AMER3	3,15	2.200,00	6.930,00	2,70	3,30	4,38	91.290,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ARZZ3	78,75	200,00	15.750,00	77,50	78,79	79,99	8.397,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ASAI3	19,96	3.300,00	65.868,00	19,63	20,01	20,31	16.602,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	AZUL4	11,66	1.200,00	13.992,00	11,60	11,91	12,29	13.616,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	B3SA3	13,16	20.900,00	275.044,00	12,92	13,12	13,28	33.366,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BBAS3	35,65	5.000,00	178.250,00	34,95	35,56	35,85	35.141,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BBDC3	13,11	5.300,00	69.483,00	12,80	13,05	13,21	6.910,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BBDC4	14,99	18.300,00	274.317,00	14,69	14,90	15,05	33.313,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BBSE3	34,20	2.400,00	82.800,00	33,93	34,22	34,40	16.369,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BEEF3	15,25	900,00	13.725,00	14,34	15,07	15,35	29.096,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BPAC11	22,21	4.300,00	95.503,00	21,95	22,33	22,90	34.306,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BPAN4	5,58	1.200,00	6.696,00	5,56	5,64	5,76	7.601,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BRAP4	31,74	900,00	28.566,00	31,53	31,69	31,93	5.974,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BRFS3	8,00	3.800,00	30.400,00	7,91	8,17	8,55	29.809,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BRKM5	23,38	900,00	21.042,00	23,06	23,30	23,74	9.342,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CCRO3	11,48	3.500,00	40.180,00	11,45	11,58	11,78	15.624,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CIEL3	4,81	3.900,00	18.759,00	4,78	4,87	5,00	28.891,00



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO - JANEIRO DE 2023



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 02 DE JANEIRO DE 2023 À 31 DE JANEIRO 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
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CMIG4	11,42	5.100,00	58.242,00	11,33	11,39	11,53	15.437,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CMIN3	4,58	3.900,00	17.862,00	4,49	4,55	4,60	6.885,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	COGN3	2,14	6.500,00	13.910,00	2,13	2,16	2,21	14.963,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CPFE3	32,05	700,00	22.435,00	31,93	32,13	32,33	4.040,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CPLE6	7,78	5.500,00	42.790,00	7,62	7,74	7,83	13.609,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CRFB3	14,76	1.900,00	28.044,00	14,16	14,54	14,77	10.636,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CSAN3	17,14	4.200,00	71.988,00	17,01	17,24	17,70	18.771,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CSNA3	16,89	2.100,00	35.469,00	16,81	16,91	17,09	12.853,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CVCB3	4,60	1.000,00	4.600,00	4,56	4,76	4,97	8.746,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CYRE3	13,76	1.000,00	13.760,00	13,62	13,80	14,06	9.344,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	DXCO3	6,94	1.000,00	6.940,00	6,83	6,92	7,09	11.478,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ECOR3	4,47	1.100,00	4.917,00	4,46	4,52	4,64	9.796,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	EGIE3	37,84	900,00	34.056,00	37,73	38,10	38,83	9.642,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ELET3	41,58	6.600,00	274.428,00	41,42	41,70	42,19	31.361,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ELET6	43,27	1.000,00	43.270,00	42,94	43,26	43,65	8.392,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	EMBR3	15,75	2.600,00	40.950,00	15,50	15,69	15,90	11.882,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ENBR3	19,74	900,00	17.766,00	19,61	19,85	20,05	9.597,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ENEV3	12,60	5.600,00	70.560,00	12,30	12,59	12,68	13.324,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ENG11	41,75	900,00	37.575,00	41,58	41,96	43,25	10.563,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	EQLT3	27,08	3.900,00	105.612,00	26,95	27,11	27,40	15.158,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	EZTC3	13,20	300,00	3.960,00	13,14	13,35	13,80	11.702,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	FLRY3	15,18	1.300,00	19.734,00	15,14	15,31	15,70	9.514,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	GGBR4	32,43	3.900,00	126.477,00	32,09	32,34	32,61	18.686,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	GOAU4	14,10	2.400,00	33.840,00	13,95	14,03	14,14	10.572,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	GOLL4	7,90	700,00	5.530,00	7,82	8,04	8,22	9.646,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	HAPV3	4,25	15.800,00	67.150,00	4,10	4,20	4,29	41.671,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	HYPE3	44,35	1.400,00	62.090,00	43,94	44,59	45,04	15.203,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	IGT11	18,11	800,00	14.488,00	17,93	18,18	18,75	14.906,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ITSA4	8,63	18.500,00	159.655,00	8,53	8,61	8,80	16.149,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ITUB4	25,85	17.000,00	439.450,00	25,14	25,68	25,89	37.135,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	JBSS3	21,50	4.000,00	86.000,00	21,32	21,55	22,06	19.426,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	KLBN11	20,04	2.500,00	50.100,00	19,68	19,84	20,05	13.328,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	LEN3	20,14	3.400,00	68.476,00	19,97	20,73	21,76	42.896,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	LWSA3	6,46	1.500,00	9.690,00	6,33	6,46	6,60	15.391,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	MGLU3	3,43	10.200,00	34.986,00	3,09	3,46	3,62	77.324,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	MRFG3	8,37	1.100,00	9.207,00	8,27	8,48	8,73	21.087,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	MRVE3	7,19	1.100,00	7.909,00	7,17	7,31	7,52	17.174,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	MULT3	21,91	1.000,00	21.910,00	21,84	22,01	22,34	10.594,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	NTCO3	12,24	3.000,00	36.720,00	11,97	12,36	12,65	20.425,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	PCAR3	18,38	600,00	11.028,00	18,21	18,47	18,78	9.452,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	PETR3	27,69	12.300,00	340.587,00	27,35	27,64	27,86	17.325,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	PETRA	24,57	16.200,00	398.034,00	24,25	24,47	24,66	57.448,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	PETZ3	6,17	1.200,00	7.404,00	6,11	6,25	6,44	11.366,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	PRI03	39,05	3.000,00	117.150,00	38,60	38,98	39,75	21.245,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	QUAL3	6,18	1.000,00	6.180,00	6,08	6,16	6,27	12.365,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	RADL3	23,98	4.200,00	100.716,00	23,53	23,99	24,21	19.958,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	RAIL3	18,37	4.300,00	78.991,00	17,77	18,26	18,65	25.003,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	RAIZ4	3,34	4.300,00	14.362,00	3,32	3,38	3,50	16.477,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	RDOR3	26,30	4.100,00	107.830,00	26,07	26,32	26,55	9.602,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	RENT3	53,71	2.700,00	145.017,00	52,77	53,31	53,85	32.144,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	RRRP3	44,21	700,00	30.947,00	43,80	44,24	44,98	17.078,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	SANB11	29,90	1.300,00	38.870,00	29,73	29,93	30,34	7.861,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	SBS3	54,70	1.200,00	65.640,00	54,33	54,83	55,29	10.338,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	SLCE3	46,54	300,00	13.962,00	45,35	46,07	46,92	5.312,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	SMT03	22,40	500,00	11.200,00	22,14	22,51	23,10	11.419,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	SOMA3	9,67	1.700,00	16.439,00	9,64	9,77	9,95	12.987,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	SUZB3	50,43	2.600,00	131.118,00	49,90	50,55	51,06	18.860,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	TAE11	34,77	800,00	27.816,00	34,62	34,88	35,08	8.049,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	TIMS3	11,63	2.900,00	33.727,00	11,55	11,67	11,96	13.880,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	TOTS3	28,16	1.800,00	50.688,00	27,78	28,11	28,49	15.415,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	UGPA3	12,59	3.900,00	49.101,00	12,58	12,72	12,99	10.638,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	USIM3	7,81	1.800,00	14.058,00	7,76	7,81	7,90	10.325,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	VALE3	93,82	12.000,00	1.125.840,00	93,36	93,84	94,28	41.230,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	VBRR3	14,77	4.000,00	59.080,00	14,67	14,82	15,03	23.363,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	VIA3	2,37	5.600,00	13.272,00	2,34	2,49	2,63	28.901,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	VIT3	38,13	1.500,00	57.195,00	37,91	38,13	38,80	17.730,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	WEGE3	38,97	4.700,00	183.159,00	37,92	38,70	39,36	14.467,00
13-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	YDUQ3	9,26	1.100,00	10.186,00	9,12	9,28	9,55	11.235,00
16-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	ABEV3	13,44	38.100,00	512.223,75	13,18	13,36	13,74	62.131,00
16-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	AMER3	2,40	79.649,00	191.159,60	1,80	1,94	2,41	58.794,00
16-01-23	FIA RVA EMB II	Compra	BEEF3	14,90	17.700,00	263.723,39	14,64	15,00	15,25	19.669,00
16-01-23	FIA RVA EMB II	Compra	EQLT3	26,81	19.500,00	522.797,45	26,65	26,89	27,41	20.157,00
16-01-23	FIA RVA EMB II	Compra	GGBR4	31,90	14.500,00	462.531,29	31,26	31,74	32,20	20.068,00
16-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	SOMA3	9,56	70.200,00	670.960,67	9,41	9,55	9,75	9.993,00
16-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	STBP3	8,32	35.400,00	294.427,00	8,26	8,41	8,56	8.376,00
16-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	21,42	3.600,00	77.112,00	21,10	21,35	21,96	46.908,00
16-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	21,36	3.800,00	81.177,14	21,10	21,35	21,96	46.908,00
16-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	LEN3	19,63	3.000,00	58.901,63	19,43	19,91	20,91	41.771,00
16-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	PETZ3	5,86	5.400,00	31.669,88	5,81	5,97	6,29	12.842,00
16-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	39,05	2.300,00	89.806,69	38,68	39,03	39,35	13.784,00
16-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	BPAC11	21,22	9.839,00	208.783,07	21,10	21,35	21,96	46.908,00
16-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	BPAC11	21,30	937,00	19.958,10	21,10	21,35	21,96	46.908,00
16-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	BPAC11	21,16	1.717,00	36.335,74	21,10	21,35	21,96	46.908,00
16-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	ELET3	40,88	886,00	36.216,31	40,76	41,19	41,84	26.068,00



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO
E CONTROLE DE RISCO - JANEIRO DE 2023



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

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

DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
16-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	ELET3	40,89	3.454,00	141.219,47	40,76	41,19	41,84	26.068,00
16-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	ENEV3	12,41	2.532,00	31.413,69	12,37	12,53	12,79	18.317,00
16-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	ENEV3	12,52	911,00	11.406,10	12,37	12,53	12,79	18.317,00
16-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	6,43	63.177,00	406.398,73	6,31	6,44	6,54	12.679,00
16-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	LREN3	19,64	54.715,00	1.074.812,17	19,43	19,91	20,91	41.771,00
16-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	53,73	8.007,00	430.211,13	53,12	53,62	54,26	20.327,00
16-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	53,75	1.238,00	66.536,80	53,12	53,62	54,26	20.327,00
16-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	53,75	128,00	6.880,00	53,12	53,62	54,26	20.327,00
16-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	53,75	1.183,00	63.586,25	53,12	53,62	54,26	20.327,00
16-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	53,75	1.183,00	63.586,25	53,12	53,62	54,26	20.327,00
16-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	53,56	6.847,00	366.755,99	53,12	53,62	54,26	20.327,00
16-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	53,75	710,00	38.162,50	53,12	53,62	54,26	20.327,00
16-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	53,53	5.917,00	316.747,88	53,12	53,62	54,26	20.327,00
17-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	14,89	600,00	8.932,27	14,82	15,00	15,24	10.250,00
17-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,07	900,00	13.561,28	14,82	15,00	15,24	10.250,00
17-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	26,74	800,00	21.395,67	26,32	26,69	26,99	29.931,00
17-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETRA	25,12	7.200,00	180.884,98	24,11	25,03	25,62	100.080,00
17-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	39,75	100,00	3.974,61	37,64	38,84	39,85	36.602,00
17-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	33,33	2.500,00	83.330,74	32,84	33,33	33,60	8.339,00
17-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	51,19	4.300,00	220.109,88	50,26	51,19	51,68	28.677,00
17-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	BPAC11	22,27	3.159,00	70.335,17	21,16	22,19	22,50	51.476,00
17-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	BPAC11	22,28	4.107,00	91.512,46	21,16	22,19	22,50	51.476,00
17-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	BPAC11	22,40	850,00	19.036,90	21,16	22,19	22,50	51.476,00
17-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	22,14	1.295,00	28.671,30	21,58	22,28	22,55	17.493,00
17-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	22,32	4.101,00	91.522,35	21,58	22,28	22,55	17.493,00
17-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	22,33	2.190,00	48.911,46	21,58	22,28	22,55	17.493,00
18-01-23	FIA RVA EMB II	Compra	EGIE3	38,97	18.000,00	701.467,00	38,67	38,96	39,18	7.606,00
18-01-23	FIA RVA EMB II	Compra	MGLU3	3,71	248.600,00	922.140,00	3,52	3,66	3,88	67.372,00
18-01-23	FIA RVA EMB II	Compra	PETRA	25,60	30.200,00	772.978,00	25,00	25,49	26,03	89.452,00
18-01-23	FIA RVA EMB II	Compra	PETZ3	6,24	156.700,00	977.633,00	6,03	6,15	6,29	14.875,00
18-01-23	FIA RVA EMB II	Compra	TOTS3	29,75	13.300,00	395.639,00	29,43	29,77	30,18	25.989,00
18-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	93,55	15.800,00	1.478.014,00	92,91	93,56	94,24	48.655,00
18-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ALSO3	17,75	4.300,00	76.346,00	17,60	17,94	18,26	17.226,00
18-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	14,74	3.500,00	51.590,00	14,57	14,73	15,18	11.621,00
18-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	14,65	1.700,00	24.898,62	14,57	14,73	15,18	11.621,00
18-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	14,68	200,00	2.935,28	14,57	14,73	15,18	11.621,00
18-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	22,73	1.000,00	22.734,62	22,26	22,80	23,25	41.561,00
18-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	41,78	500,00	20.889,00	41,35	41,81	42,16	17.588,00
18-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,93	600,00	7.755,38	12,51	12,94	13,15	23.522,00
18-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	13,01	13.000,00	169.193,34	12,51	12,94	13,15	23.522,00
18-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	27,25	1.800,00	49.053,75	26,81	27,28	27,63	18.865,00
18-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	27,56	2.900,00	79.910,00	26,81	27,28	27,63	18.865,00
18-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	27,51	1.300,00	35.765,60	26,81	27,28	27,63	18.865,00
18-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,25	3.100,00	13.179,00	4,13	4,20	4,29	33.553,00
18-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	18,55	1.200,00	22.257,00	18,40	18,59	18,90	24.176,00
18-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	26,55	900,00	23.890,54	26,20	26,47	26,64	49.979,00
18-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	20,94	4.200,00	87.936,94	20,29	20,81	21,30	44.964,00
18-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	NINJ3	2,87	500,00	1.436,00	2,82	2,86	2,91	401,00
18-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	6,21	6.500,00	40.364,46	6,03	6,15	6,29	14.875,00
18-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	39,15	1.900,00	74.386,51	38,92	39,17	39,78	25.166,00
18-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	34,08	2.300,00	78.381,26	33,68	33,98	34,69	6.780,00
18-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	57,90	2.800,00	162.132,69	56,20	57,86	58,39	65.753,00
18-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	9,96	900,00	8.961,07	9,60	9,84	10,15	20.252,00
18-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	50,06	3.600,00	180.216,18	49,38	50,07	51,70	29.622,00
18-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	15,28	1.400,00	21.385,00	15,22	15,46	15,81	20.985,00
18-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	6,64	93,00	617,42	6,52	6,66	6,76	16.936,00
18-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	6,65	3.160,00	21.023,08	6,52	6,66	6,76	16.936,00
18-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	6,65	93,00	618,29	6,52	6,66	6,76	16.936,00
18-01-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	MALL11	103,26	2.055,00	212.202,04	102,70	103,32	103,57	2.982,00
19-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	41,40	4.300,00	178.000,46	40,85	41,32	41,96	26.914,00
19-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,34	37.800,00	164.084,91	4,08	4,31	4,40	28.491,00
19-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	7,15	3.400,00	24.302,01	6,63	7,02	7,25	5.604,00
19-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	6,75	2.000,00	13.500,00	6,63	7,02	7,25	5.604,00
19-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	6,80	3.800,00	25.842,14	6,63	7,02	7,25	5.604,00
19-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETRA	25,49	7.200,00	183.553,65	24,79	25,55	25,95	84.959,00
19-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	5,95	12.200,00	72.548,92	5,88	5,95	6,05	12.211,00
19-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	40,25	2.300,00	92.574,28	38,52	39,86	40,54	23.368,00
19-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	34,00	900,00	30.597,16	33,24	33,90	34,14	4.149,00
19-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	BPAC11	22,08	1.552,00	34.262,80	21,84	22,07	22,54	29.846,00
19-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	BPAC11	22,00	5.043,00	110.948,07	21,84	22,07	22,54	29.846,00
19-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	BPAC11	21,96	1.164,00	25.557,73	21,84	22,07	22,54	29.846,00
19-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	ELET3	41,05	3.553,00	145.850,65	40,85	41,32	41,96	26.914,00
19-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	ELET3	41,07	2.665,00	109.441,56	40,85	41,32	41,96	26.914,00
19-01-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	RBRLL1	75,51	1.050,00	79.285,50	75,00	75,83	77,38	1.584,00
19-01-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	XPPR11	33,46	6.311,00	211.137,96	33,12	33,51	33,90	3.419,00
20-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	GMAT3	6,62	132.100,00	874.545,83	6,56	6,64	6,72	15.199,00
20-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ALSO3	17,35	1.900,00	32.962,76	17,22	17,40	17,74	14.411,00
20-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	14,76	3.100,00	45.743,87	14,66	14,78	14,92	5.567,00
20-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	40,05	600,00	24.027,17	39,11	39,96	40,30	72.699,00
20-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	21,43	1.700,00	36.439,40	21,24	21,48	22,13	36.797,00
20-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	40,85	1.000,00	40.851,99	40,65	40,99	41,69	28.513,00
20-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,53	4.700,00	58.892,57	12,44	12,56	12,91	18.782,00
20-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	26,98	2.400,00	64.759,90	26,81	26,97	27,35	20.740,00



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



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

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

DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
20-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,40	2.700,00	11.871,98	4,26	4,35	4,44	27.591,00
20-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	18,44	2.100,00	38.721,10	18,32	18,46	18,64	11.848,00
20-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	26,17	1.700,00	44.488,48	26,03	26,16	26,68	49.692,00
20-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	LREN3	20,65	2.500,00	51.618,64	20,45	20,78	21,28	46.716,00
20-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	NINJ3	2,92	100,00	292,24	2,85	2,91	2,95	346,00
20-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	12,14	1.200,00	14.570,33	11,79	12,13	12,45	36.917,00
20-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	7,09	200,00	1.418,88	6,91	7,12	7,32	3.266,00
20-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	PETR4	26,23	500,00	13.113,73	25,42	26,02	26,60	123.763,00
20-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	PETZ3	5,93	32.400,00	192.233,59	5,86	5,94	6,02	14.926,00
20-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	41,01	200,00	8.201,71	39,53	40,74	41,49	32.503,00
20-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	RDOR3	28,18	900,00	25.358,98	27,99	28,35	29,01	30.224,00
20-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	33,52	1.100,00	36.869,69	32,96	33,49	34,05	10.327,00
20-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	55,46	1.000,00	55.463,57	55,10	55,56	56,80	24.939,00
20-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	9,44	3.600,00	33.991,57	9,11	9,38	9,58	20.134,00
20-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	9,38	11.400,00	106.935,24	9,11	9,38	9,58	20.134,00
20-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	47,65	1.300,00	61.949,25	47,14	47,87	49,20	31.205,00
20-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	15,07	2.600,00	39.192,40	14,94	15,06	15,33	17.411,00
20-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	9,46	2.100,00	19.864,71	9,25	9,45	9,61	9.281,00
20-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	BPAC11	21,30	2.087,00	44.453,10	21,24	21,48	22,13	36.797,00
20-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	6,64	1.189,00	7.894,96	6,56	6,64	6,72	15.199,00
20-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	6,62	13.850,00	91.748,87	6,56	6,64	6,72	15.199,00
20-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	6,62	2.859,00	18.918,67	6,56	6,64	6,72	15.199,00
20-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	6,65	731,00	4.861,15	6,56	6,64	6,72	15.199,00
20-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	55,20	305,00	16.836,00	55,10	55,56	56,80	24.939,00
20-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	55,27	7.602,00	420.165,69	55,10	55,56	56,80	24.939,00
20-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	AMER3	0,71	30.442,00	21.613,32	0,64	0,78	1,18	56.282,00
23-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	40,60	4.400,00	178.642,05	39,13	40,45	41,25	53.353,00
23-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	20,86	3.400,00	70.934,25	20,60	20,94	21,60	34.883,00
23-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,24	10.800,00	132.179,07	12,03	12,19	12,47	20.269,00
23-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	25,54	5.600,00	143.004,84	25,20	25,55	26,17	70.228,00
23-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETR4	27,12	6.600,00	178.994,31	26,13	27,07	27,60	140.687,00
23-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	41,99	2.100,00	88.183,51	40,97	42,00	42,83	45.026,00
23-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	47,19	3.400,00	160.462,01	46,70	47,17	47,83	19.787,00
23-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	BBDC4	14,18	52.536,00	745.171,08	14,00	14,23	14,70	61.445,00
23-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	BBDC4	14,18	31.298,00	443.785,50	14,00	14,23	14,70	61.445,00
23-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	BBDC4	14,35	1.565,00	22.460,28	14,00	14,23	14,70	61.445,00
23-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	BBDC4	14,08	4.474,00	62.974,22	14,00	14,23	14,70	61.445,00
23-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	BBDC4	14,15	8.638,00	122.216,10	14,00	14,23	14,70	61.445,00
23-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	BBDC4	14,43	6.260,00	90.305,18	14,00	14,23	14,70	61.445,00
23-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	BBDC4	14,38	12.519,00	179.991,90	14,00	14,23	14,70	61.445,00
23-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	6,67	807,00	5.382,04	6,63	6,70	6,80	10.344,00
23-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	6,65	1.861,00	12.373,88	6,63	6,70	6,80	10.344,00
23-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	6,68	69.703,00	465.462,44	6,63	6,70	6,80	10.344,00
23-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	56,54	1.296,00	73.270,23	55,03	56,50	57,29	27.909,00
23-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	56,52	2.861,00	161.700,68	55,03	56,50	57,29	27.909,00
23-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	56,63	3.524,00	199.551,60	55,03	56,50	57,29	27.909,00
23-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	56,77	1.620,00	91.971,66	55,03	56,50	57,29	27.909,00
23-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	56,32	3.068,00	172.779,76	55,03	56,50	57,29	27.909,00
23-01-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	GTGL11	97,99	12.245,00	1.199.887,55	97,99	97,99	98,00	4,00
23-01-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	AMER3	0,83	1.551,00	1.287,37	0,74	0,81	0,88	34.584,00
24-01-23	FIA RVA EMB II	Compra	BSE3	35,74	53.500,00	1.912.169,89	35,28	35,62	35,97	19.314,00
24-01-23	FIA RVA EMB II	Compra	EGIE3	38,75	13.800,00	534.713,00	38,10	38,67	38,95	7.776,00
24-01-23	FIA RVA EMB II	Compra	GGBR4	32,27	7.700,00	248.503,00	32,02	32,31	32,78	24.024,00
24-01-23	FIA RVA EMB II	Compra	MGLU3	4,35	102.200,00	444.131,25	4,05	4,26	4,45	61.604,00
24-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	TIMS3	11,48	30.100,00	345.654,82	11,39	11,51	11,76	13.021,00
24-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	WEGE3	36,90	26.000,00	959.508,93	36,77	37,02	37,74	21.160,00
24-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	20,96	9.900,00	207.483,40	20,57	21,06	21,29	47.049,00
24-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	20,85	2.100,00	43.774,59	20,57	21,06	21,29	47.049,00
24-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,16	500,00	6.077,76	11,82	12,01	12,20	14.829,00
24-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	11,99	1.500,00	17.990,01	11,82	12,01	12,20	14.829,00
24-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	11,95	5.600,00	66.920,00	11,82	12,01	12,20	14.829,00
24-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	18,64	4.900,00	91.324,91	18,31	18,63	18,80	12.568,00
24-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	21,07	1.500,00	31.607,15	20,44	21,12	21,39	24.993,00
24-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	7,38	2.400,00	17.710,10	7,23	7,37	7,55	3.048,00
24-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	7,38	4.700,00	34.686,00	7,23	7,37	7,55	3.048,00
24-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	6,21	10.600,00	65.774,50	5,88	6,15	6,30	14.351,00
24-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	6,27	600,00	3.761,51	5,88	6,15	6,30	14.351,00
24-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	57,77	5.000,00	288.862,12	56,53	57,87	58,34	34.274,00
24-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	9,64	3.800,00	36.646,00	9,40	9,69	9,90	14.363,00
24-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	47,51	300,00	14.252,78	46,78	47,52	48,15	18.647,00
24-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	47,64	5.500,00	262.034,67	46,78	47,52	48,15	18.647,00
24-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	BPAC11	21,03	1.949,00	40.993,24	20,57	21,06	21,29	47.049,00
24-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	BPAC11	20,97	5.452,00	114.311,56	20,57	21,06	21,29	47.049,00
24-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	BPAC11	21,10	1.559,00	32.892,37	20,57	21,06	21,29	47.049,00
24-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	BPAC11	21,14	3.888,00	82.178,11	20,57	21,06	21,29	47.049,00
24-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	22,61	17.700,00	400.174,00	22,09	22,59	22,87	16.432,00
24-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	22,59	2.700,00	61.002,00	22,09	22,59	22,87	16.432,00
25-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	ABEV3	13,70	63.200,00	865.625,56	13,47	13,63	13,74	41.502,00
25-01-23	FIA RVA EMB II	Compra	EGIE3	38,88	23.900,00	929.172,80	38,46	38,80	39,11	6.921,00
25-01-23	FIA RVA EMB II	Compra	PETZ3	6,47	34.000,00	219.929,70	6,11	6,37	6,54	11.556,00
25-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,33	4.000,00	61.320,00	14,84	15,22	15,41	19.272,00
25-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,30	7.300,00	111.688,39	14,84	15,22	15,41	19.272,00
25-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	21,06	11.500,00	242.197,45	20,53	21,13	21,93	28.370,00
25-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,24	12.300,00	150.555,41	12,00	12,23	12,42	18.697,00
25-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,30	2.900,00	35.670,00	12,00	12,23	12,42	18.697,00



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

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

DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
25-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	EUCA4	11,41	5.900,00	67.337,85	10,20	11,59	14,07	3.805,00
25-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	21,68	2.600,00	56.370,39	20,80	21,53	21,88	32.875,00
25-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	13,26	5.500,00	72.907,78	12,87	13,19	13,50	25.201,00
25-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	7,61	9.500,00	72.250,94	7,36	7,62	7,87	4.573,00
25-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	58,78	3.200,00	188.104,38	57,00	58,68	59,64	28.951,00
25-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	46,67	2.000,00	93.341,26	46,32	46,66	47,39	21.804,00
25-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	15,85	11.700,00	185.456,36	15,41	15,78	16,03	22.012,00
26-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,35	3.200,00	49.133,23	15,06	15,23	15,44	17.880,00
26-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,33	1.200,00	18.390,74	15,06	15,23	15,44	17.880,00
26-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	21,53	10.400,00	223.962,16	21,15	21,53	21,89	28.063,00
26-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	42,77	4.400,00	188.171,38	42,59	42,77	43,04	19.822,00
26-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,10	3.000,00	36.296,92	11,98	12,08	12,36	18.221,00
26-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	EUCA4	10,48	600,00	6.285,70	9,97	10,46	11,30	863,00
26-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	EUCA4	11,10	500,00	5.551,28	9,97	10,46	11,30	863,00
26-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	12,94	1.000,00	12.942,10	12,66	12,87	13,43	21.860,00
26-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	6,35	4.600,00	29.203,82	6,30	6,38	6,57	9.660,00
26-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	45,63	2.400,00	109.506,19	44,82	45,59	46,26	30.503,00
26-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	15,94	11.600,00	184.871,71	15,81	15,97	16,30	18.362,00
26-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	42,47	1.179,00	50.076,29	42,08	42,46	42,94	24.540,00
26-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	42,57	1.685,00	71.730,70	42,08	42,46	42,94	24.540,00
26-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	42,46	1.618,00	68.697,65	42,08	42,46	42,94	24.540,00
26-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	42,49	276,00	11.728,22	42,08	42,46	42,94	24.540,00
26-01-23	FIC FIA EMB VIII ETF	Venda	BOVA11	110,01	92,00	10.120,92	109,86	110,37	111,10	53.183,00
27-01-23	FIA RVA EMB II	Compra	ASAI3	21,07	68.900,00	1.451.842,72	20,83	21,00	21,25	15.680,00
27-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	ITUB4	24,96	72.100,00	1.799.848,96	24,82	25,00	25,46	48.370,00
27-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	SOMA3	10,02	48.600,00	487.024,00	9,91	10,00	10,13	10.379,00
27-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ALSO3	17,74	2.300,00	40.791,16	17,60	17,76	18,10	8.031,00
27-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,32	11.200,00	171.621,55	15,22	15,35	15,62	15.200,00
27-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,39	3.600,00	55.409,08	15,22	15,35	15,62	15.200,00
27-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,53	400,00	6.213,81	15,22	15,35	15,62	15.200,00
27-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,49	700,00	10.842,92	15,22	15,35	15,62	15.200,00
27-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	21,16	3.700,00	78.282,84	21,09	21,23	21,71	15.368,00
27-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	11,98	6.200,00	74.304,26	11,90	11,98	12,09	12.773,00
27-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,04	1.500,00	18.060,00	11,90	11,98	12,09	12.773,00
27-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	EUCA4	10,68	300,00	3.205,12	10,17	10,90	11,31	751,00
27-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,66	6.500,00	30.290,00	4,40	4,58	4,72	18.885,00
27-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,64	12.800,00	59.387,99	4,40	4,58	4,72	18.885,00
27-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	19,15	700,00	13.403,27	19,03	19,25	19,53	11.646,00
27-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	7,80	9.000,00	70.200,00	7,56	7,77	7,88	3.423,00
27-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	6,57	1.000,00	6.570,00	6,27	6,45	6,60	11.930,00
27-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	6,50	5.500,00	35.730,18	6,27	6,45	6,60	11.930,00
27-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	6,56	2.000,00	13.120,00	6,27	6,45	6,60	11.930,00
27-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	42,82	2.100,00	89.914,35	41,61	42,51	43,79	31.113,00
27-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	30,26	4.300,00	130.123,08	29,58	30,23	30,65	15.965,00
27-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	30,37	300,00	9.111,00	29,58	30,23	30,65	15.965,00
27-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	15,80	5.000,00	79.016,92	15,66	15,81	16,03	17.550,00
27-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	15,80	800,00	12.640,00	15,66	15,81	16,03	17.550,00
27-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	9,50	2.000,00	19.000,00	9,34	9,48	9,61	4.909,00
27-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	9,50	800,00	7.600,00	9,34	9,48	9,61	4.909,00
27-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	9,45	12.800,00	120.974,90	9,34	9,48	9,61	4.909,00
27-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	58,80	1.729,00	101.665,20	58,56	58,87	59,40	21.342,00
27-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	58,81	2.773,00	163.080,13	58,56	58,87	59,40	21.342,00
27-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	58,89	47,00	2.767,71	58,56	58,87	59,40	21.342,00
27-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	58,92	1.261,00	74.298,02	58,56	58,87	59,40	21.342,00
30-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	ABEV3	13,53	12.000,00	162.360,00	13,44	13,54	13,70	61.493,00
30-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	ARZZ3	86,13	700,00	60.291,00	82,62	86,73	88,30	9.368,00
30-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	ASAI3	20,78	1.900,00	39.482,00	20,57	20,81	21,24	22.543,00
30-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	B3SA3	12,77	21.200,00	270.627,00	12,65	12,78	12,90	39.219,00
30-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	BBAS3	40,34	5.400,00	217.816,00	40,06	40,46	40,91	47.580,00
30-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	BRDC4	13,79	16.100,00	222.019,00	13,49	13,68	13,79	42.280,00
30-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	BBSE3	37,90	1.500,00	56.850,00	37,26	37,81	38,03	20.167,00
30-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	BEFF3	14,22	3.400,00	48.348,00	14,08	14,28	14,72	16.943,00
30-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	BPAC11	21,19	4.100,00	86.879,00	20,68	20,92	21,41	29.990,00
30-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	CIEL3	4,98	14.500,00	72.210,00	4,97	5,03	5,30	24.065,00
30-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	CPFE3	33,28	2.800,00	93.185,00	33,07	33,32	33,53	9.452,00
30-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	CSAN3	16,39	2.800,00	45.892,00	16,23	16,42	17,00	27.768,00
30-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	EGIE3	38,94	2.700,00	105.144,00	38,75	38,91	39,15	5.550,00
30-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	ELET3	40,70	4.000,00	162.800,00	40,42	40,81	41,77	32.024,00
30-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	ELET6	42,47	2.000,00	84.940,00	42,23	42,67	43,87	14.579,00
30-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	ENEV3	11,83	5.200,00	61.516,00	11,80	11,94	12,20	11.655,00
30-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	ENGI11	42,59	1.400,00	59.620,00	42,40	42,71	43,58	6.199,00
30-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	EQLT3	27,50	3.300,00	90.750,00	27,24	27,53	27,96	20.486,00
30-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	GGBR4	32,49	4.100,00	133.193,00	32,04	32,43	32,67	16.480,00
30-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	GMAT3	7,02	9.900,00	69.468,00	6,87	6,99	7,11	15.664,00
30-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	HAPV3	4,70	20.500,00	96.350,00	4,50	4,66	4,75	34.851,00
30-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	HYPE3	44,89	2.100,00	94.269,00	44,60	44,91	45,24	18.701,00
30-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	INTB3	30,89	2.100,00	64.863,00	30,44	30,96	31,84	3.562,00
30-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	ITSA4	8,50	14.500,00	123.250,00	8,39	8,45	8,50	18.578,00
30-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	ITUB4	24,94	16.000,00	399.040,00	24,53	24,73	25,06	53.853,00
30-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	JBSS3	20,91	5.000,00	104.550,00	20,77	21,21	21,82	15.195,00
30-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	LREN3	21,40	8.100,00	173.357,00	21,04	21,33	21,70	20.029,00
30-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	MGLU3	4,36	9.500,00	41.420,00	4,28	4,50	4,65	51.314,00
30-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	MULT3	23,36	2.700,00	63.072,00	23,15	23,32	23,42	11.691,00
30-01-23	FIA RVA EMB II	Compra	NTCO3	14,69	100.000,00	1.469.184,80	13,45	14,02	14,94	69.904,00



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 02 DE JANEIRO DE 2023 À 31 DE JANEIRO 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
30-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	PETR3	28,99	6.500,00	188.435,00	28,66	28,97	29,32	16.536,00
30-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	PETR4	25,75	12.900,00	332.175,00	25,51	25,73	26,07	77.701,00
30-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	PETZ3	6,79	5.200,00	35.308,00	6,52	6,75	6,95	19.447,00
30-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	PRI03	41,50	4.300,00	178.450,00	41,02	41,41	42,01	18.891,00
30-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	RADL3	25,23	5.200,00	131.196,00	25,12	25,26	25,40	10.774,00
30-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	RENT3	58,79	24.300,00	1.428.581,97	58,25	58,67	59,55	21.494,00
30-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	RENT3	58,50	2.400,00	140.400,00	58,25	58,67	59,55	21.494,00
30-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	RRRP3	45,28	1.300,00	58.864,00	44,60	45,22	45,95	14.907,00
30-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	SBSP3	54,06	1.600,00	86.496,00	53,58	54,27	55,05	10.851,00
30-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	STBP3	8,77	7.600,00	66.665,00	8,65	8,77	8,95	10.780,00
30-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	SUZB3	45,86	3.500,00	160.518,00	44,58	45,97	46,54	26.702,00
30-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	THMS3	11,56	5.500,00	63.580,00	11,41	11,51	11,56	11.121,00
30-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	TOTS3	29,42	3.100,00	91.205,00	29,02	29,47	29,64	14.187,00
30-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	95,34	11.600,00	1.105.987,00	94,19	94,99	96,30	60.540,00
30-01-23	FIA RVA EMB II	Venda	WEGE3	37,35	3.900,00	145.665,00	37,09	37,29	38,03	25.489,00
30-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	14,90	200,00	2.980,50	13,45	14,02	14,94	69.904,00
30-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	14,12	15.800,00	223.070,84	13,45	14,02	14,94	69.904,00
30-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	14,29	1.400,00	20.006,00	13,45	14,02	14,94	69.904,00
30-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	6,81	5.400,00	36.800,72	6,52	6,75	6,95	19.447,00
30-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	41,50	400,00	16.600,00	41,02	41,41	42,01	18.891,00
30-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	41,32	1.800,00	74.374,40	41,02	41,41	42,01	18.891,00
30-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	30,55	3.000,00	91.653,43	30,19	30,50	30,85	14.291,00
30-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT9	42,25	537,00	22.688,25	58,25	58,67	59,55	21.494,00
31-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ALSO3	18,04	1.900,00	34.271,59	17,83	18,00	18,12	8.395,00
31-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ALSO3	18,03	2.200,00	39.674,00	17,83	18,00	18,12	8.395,00
31-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,28	700,00	10.696,60	15,10	15,37	15,50	16.365,00
31-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,26	500,00	7.631,42	15,10	15,37	15,50	16.365,00
31-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	40,87	400,00	16.348,71	40,42	40,81	41,20	32.984,00
31-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	21,62	2.300,00	49.719,00	21,10	21,56	21,89	30.386,00
31-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	40,67	1.500,00	60.998,00	40,25	40,65	41,14	33.061,00
31-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	11,88	1.000,00	11.876,47	11,80	11,93	12,05	21.675,00
31-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	11,95	5.000,00	59.734,00	11,80	11,93	12,05	21.675,00
31-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENUJ3	1,07	4.200,00	4.488,75	1,04	1,06	1,07	576,00
31-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	28,01	3.600,00	100.848,00	27,40	27,92	28,15	30.277,00
31-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	EUCA4	10,46	1.100,00	11.505,00	10,27	10,49	10,67	509,00
31-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	5,08	35.700,00	181.188,35	4,70	5,03	5,23	50.041,00
31-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	19,55	3.700,00	72.324,00	19,09	19,44	19,65	18.071,00
31-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	19,39	2.800,00	54.290,82	19,09	19,44	19,65	18.071,00
31-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	25,41	2.600,00	66.074,06	25,09	25,41	25,59	63.999,00
31-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	LENB3	21,58	1.300,00	28.054,00	21,25	21,52	21,83	33.048,00
31-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	NINJ3	2,97	3.500,00	10.385,00	2,93	2,96	3,02	620,00
31-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	14,57	10.900,00	158.765,62	13,67	14,57	14,92	53.748,00
31-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	ONCO3	7,92	4.200,00	33.268,93	7,66	7,88	8,01	6.432,00
31-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	7,16	14.200,00	101.645,94	6,76	7,10	7,27	25.740,00
31-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	7,22	1.000,00	7.216,80	6,76	7,10	7,27	25.740,00
31-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	7,03	2.600,00	18.278,00	6,76	7,10	7,27	25.740,00
31-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	42,30	1.300,00	54.984,60	40,96	42,15	42,70	26.506,00
31-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	31,69	4.600,00	145.788,06	30,26	31,57	32,18	20.925,00
31-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	31,62	1.000,00	31.619,00	31,43	31,83	32,55	8.690,00
31-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	59,33	900,00	53.401,44	58,29	59,21	59,85	32.367,00
31-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	10,55	3.500,00	36.917,00	10,14	10,49	10,62	14.080,00
31-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	46,29	2.000,00	92.579,00	45,98	46,58	47,33	29.862,00
31-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	16,52	8.800,00	145.342,17	15,93	16,36	16,58	21.234,00
31-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	16,55	1.700,00	28.135,00	15,93	16,36	16,58	21.234,00
31-01-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	16,55	2.600,00	43.033,20	15,93	16,36	16,58	21.234,00
31-01-23	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	10,29	3.300,00	33.946,00	9,61	10,04	10,36	19.541,00
31-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	ELET3	40,60	68,00	2.760,62	40,25	40,65	41,14	33.061,00
31-01-23	FIA RVA EMB IV	Venda	ELET6	42,42	3.066,00	130.064,86	42,25	42,54	43,19	11.419,00
31-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	59,21	1.457,00	86.268,97	58,29	59,21	59,85	32.367,00
31-01-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	59,35	3.430,00	203.587,33	58,29	59,21	59,85	32.367,00

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.