



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO



Dezembro/2022





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



RELATÓRIO DE CONTROLE DE RISCO
E RENTABILIDADE - DEZEMBRO DE 2022



Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS
CNPJ: 10679245000140
Data: 30/12/2022

Table with 6 columns: Metric (PL, VAR, ETL), Value, and other metrics (VAR/PL, ETL/PL, C/D, Limite Fundo, Status, Benchmark, ENQUADRADO, Duração DC, Duração DU, values).

Table with 6 columns: Scenario Name, Scenario Value, Scenario Name, Scenario Value, Scenario Name, Scenario Value.

Table with 4 columns: Model (Modelo, Int. Confiança, Horizonte), VaR paramétrico, Modelo Volatilidade, EWMA.

Main table with columns: Produto, MM, VAR Tot., Comp. VAR, Comp. VAR (%), and various scenario values (Cenário Alta -09999, Cenário Baixa -10000, etc.).



**RELATÓRIO DE CONTROLE DE RISCO
E RENTABILIDADE - DEZEMBRO DE 2022**



Data: 30/12/2022

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS
CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais							
PL:	4.110.551.447,85	VAR / PL:	2,6097%	Limite Fundo:	0,00%	Dutation DC:	1.867,29
VAR:	107.274.550,36	ETL / PL:	3,2727%	Status:	ENQUADRADO	Dutation DU:	1.283,18
ETL:	134.526.614,00	VAR / CDI:	0,0293%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	190.792.966,01	Cenário Baixa - 10000 (-):	295.918.235,24	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	382.183.590,50	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	33.770.182,15
Cenário Alta - 09999 (-):	(183.531.522,37)	Cenário Baixa - 10000 (+):	(204.517.138,27)	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	(87.821.935,15)	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(365.709.436,17)
Cenário Alta - 09999:	7.261.443,64	Cenário Baixa - 10000:	91.401.096,97	CENÁRIO BRADESCO 1:	294.361.565,36	CENÁRIO BRADESCO 2:	(331.939.254,02)

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
CMN3	99.990,06	15.034,69	-7.943,94	-0,01%	-388,06	317,36	685,11	-1.003,33
CNES11	498.247,20	40.784,01	-23.574,92	-0,02%	-112,92	117,46	532,69	-810,73
CNDR11	9.176.866,92	224.313,09	208.701,50	0,19%	818.972,47	-644.381,09	-1.332.349,58	1.948.155,69
CON3	70.479,40	17.469,99	15.387,50	0,01%	-493.469,16	593.637,85	708.640,93	-999.053,52
COMPROMISSADA_PRE	736.577.135,95	0,00	0,00	0,00%	-191.735,46	158.898,99	273.855,24	-371.808,49
CONTAS A PAGAR RECEBER	9.889.347,18	0,00	0,00	0,00%	-7.795.135,44	6.638.288,06	11.372.815,63	-14.866.369,46
COMK12	9.353.962,32	178.871,94	166.767,40	0,18%	-115.572,15	102.995,20	176.574,41	-213.936,06
CPFE3	4.050.034,80	287.778,82	107.991,76	0,16%	6.740.320,53	-5.195.959,40	-10.790.749,63	12.127.447,05
CPGT14	153.670,07	90,83	-31,33	0,00%	-32.385,50	30.765,06	54.142,63	-56.508,17
CPGT16	305.872,79	257,24	-124,48	0,00%	-25.964,41	26.436,11	116.268,03	-176.319,80
CPLE6	249.220,37	36.194,09	-1.678,60	0,00%	234.947,72	-238.685,77	-719.619,45	1.083.965,67
CPMG23C100000	2,78	0,10	0,10	0,00%	-32.738,83	25.843,84	51.463,14	-74.565,19
CREDZM24	2.144.571,93	175.501,54	115.424,21	0,1%	32.2181,10	-19.208,12	-463.343,55	68.107,92
CRFB3	437.207,18	53.238,44	39.926,77	0,04%	-41.752,77	32.971,02	63.381,01	-91.008,16
CRMG15	4.430.452,17	83.656,39	78.067,38	0,07%	673.593,40	-549.733,12	-961.880,03	1.331.898,96
CSAN23	1.162.847,16	3.420,99	1.823,81	0,00%	-1.228,86	1.010,50	2.254,93	-3.328,12
CSAN3	2.168.573,28	222.143,45	-22.715,84	-0,02%	-18.256,93	14.539,60	26.895,66	-38.259,47
CSMG47	2.105.057,26	2.448,30	1.294,94	0,00%	-115.621,92	131.326,18	-152.861,83	154.109,59
CSNA3	218.671,95	27.576,29	-10.687,73	-0,01%	-1.074.588,96	1.179.620,69	-1.439.517,12	1.447.574,00
CVCB3	23.442,29	5.813,05	5.053,06	0,00%	4.905,33	-5.886,69	2.876,49	-2.900,03
CYRE3	66.735,42	14.696,07	13.300,10	0,01%	5.721,59	-5.721,59	3.355,14	-3.382,60
DAPK23	-12.588,11	356.054,37	254.610,16	0,24%	-4.453,24	-3.081,69	19,92	-27,04
DAPK25	-8.104,93	444.598,03	368.297,66	0,35%	37.835,30	-37.835,30	30.814,75	-31.066,89
DAPK27	-426,18	38.215,71	34.778,73	0,03%	-718.174,92	713.312,63	683.279,03	-795.441,01
DAPK35	148,86	15.707,17	-14.883,23	-0,01%	316,23	-293,95	-791,02	1.206,05
DAPQ24	-17.816,03	763.889,85	656.908,27	0,61%	-2.644,64	2.147,63	4.013,11	-5.671,03
DAPQ26	-8.868,98	531.032,39	478.040,44	0,45%	-4.823.426,56	4.823.464,73	2.357.047,78	-2.376.341,82
DAPQ28	5.087,31	335.027,17	-308.694,60	-0,29%	-663.139,12	575.638,75	541.104,55	-696.404,60
DAPQ30	2.035,84	158.485,37	-146.223,40	-0,14%	1.251.262,09	-1.251.262,09	611.450,07	-615.655,12
DASAA2	2.646.221,09	186,22	86,40	0,00%	50.743,26	-50.743,26	29.755,85	-29.999,42
DHF23	-0,30	0,46	0,46	0,00%	18.623,60	-15.493,21	15.141,54	-15.265,48
DHF24	-6.897,70	404.626,91	-186.238,66	-0,17%	2.751.039,27	-1.090.006,37	-1.098.928,66	
DHF25	9.844,34	301.953,28	161.875,71	0,15%	490.681,46	-557.359,89	371.404,36	-374.444,51
DHF26	5.341,10	107.641,92	57.137,41	0,05%	-375.531,54	334.526,18	319.405,91	-402.887,22
DHF27	196.992,32	4.075.986,25	2.919.051,43	2,04%	-53.975,09	43.016,37	38.857,59	-51.114,02
DHF29	3.244,95	55.707,42	29.901,23	0,03%	76.893,68	-46.164,40	25.055,99	-25.261,09
DHF31	-217.437,32	3.136.830,56	-1.686.917,32	-1,57%	-34.572,87	27.656,32	205.566,71	-32.938,25
DHF33	1.423,94	14.821,69	7.978,70	0,01%	-1.570.622,91	1.369.025,75	1.293.960,64	-1.654.112,86
DIF23	174,30	1.507,32	202,47	0,00%	-333,47	272,16	587,98	-961,31
DIJ23	273,21	26.231,73	-5.081,43	0,00%	5.707.277,88	-5.707.277,88	4.183.434,69	-4.217.678,36
DIJ24	277,29	18.871,36	9.164,58	0,01%	-88.059,17	65.828,91	58.950,23	-77.858,44
DINH23	-83,01	4.836,05	-1.382,11	0,00%	-304.351,97	227.519,26	202.517,38	-269.090,00
DINH24	656,54	26.213,96	13.072,23	0,01%	-136,29	116,29	274,11	-406,35
DINH25	-18.022,80	392.382,52	-209.560,69	-0,20%	-76.412,47	61.206,96	49.666,27	-66.307,75
DIV23	33,26	456,29	188,64	0,00%	-175.253,98	132.868,70	124.361,83	-163.969,03
DIV24	446,44	11.329,12	5.897,11	0,01%	9,75	43,81	93,81	-66,59
DOLF23	0,06	0,00	0,00	0,00%	-350,57	300,37	744,44	-1.107,01
DOLG23	-4,01	541.519,62	48.822,74	0,05%	115.869,60	-115.871,31	21.233,10	-21.406,91
DXCO3	19.821,32	3.048,29	1.914,23	0,00%	4.773,02	-7.159,53	3.498,63	-3.527,26
ECOR3	22.886,35	4.216,79	2.194,44	0,00%	27.405,21	-27.405,21	20.088,02	-20.252,45
EGE3	210.196,12	12.827,76	3.337,70	0,00%	579.425,00	-579.425,00	168.887,41	-171.278,03
EGIEA0	7.294.549,48	233.463,09	215.256,88	0,20%	1.346.385,15	-1.346.385,15	394.760,13	-397.991,45
ELEK27	555.039,16	61,71	-16,66	0,00%	-2.151.019,02	2.574.555,61	2.152.925,31	-2.791.491,20
ELET13	2.092.115,66	1.489,63	770,60	0,00%	-185.482,01	165.497,75	157.743,14	-199.159,16
ELET3	16.078.086,52	1.791.591,24	1.152.251,49	1,07%	-905.940,38	858.939,74	835.367,06	-990.076,17
ELET6	4.170.873,63	603.251,24	376.995,75	0,35%	-69.820,47	46.893,98	35.404,62	-47.776,39
EMBR3	202.973,04	21.224,41	-6.972,27	-0,01%	989.445,93	-989.445,93	580.211,09	-584.960,43
ENBR3	103.284,72	6.008,25	4.811,24	0,00%	2.165.982,97	-2.165.982,97	705.629,12	-711.405,07
ENEV3	7.435.241,27	504.613,75	242.499,72	0,23%	2.498,72	2.027,14	3.961,46	-5.673,28
ENGH1	2.533.454,05	279.023,55	220.419,99	0,21%	1.647.425,68	-1.464.378,38	1.341.736,89	-1.352.719,53
ENGA5	5.760.628,88	129.481,49	120.671,49	0,1%	49.018,82	-40.849,02	23.953,86	-24.149,94
ENJU3	170.914,00	24.777,44	16.515,96	0,02%	15.519,70	-9.053,16	3.791,98	-3.823,02
EQTL13	1.473.756,07	158,70	73,61	0,00%	-544,03	440,26	825,35	-1.168,60
EQTL3	28.536.389,42	3.547.705,19	2.875.461,70	2,68%	-751.225,30	646.911,66	612.903,29	-788.228,91
ERDV17	3.575.058,03	53.581,29	46.685,85	0,04%	-753.065,03	648.495,93	614.404,28	-790.258,27
ERDV18	1.378.708,53	47,27	19,41	0,00%	214.000,00	-214.000,00	31.372,40	-31.629,77
ERDV38	5.485.341,77	98.170,59	88.273,27	0,08%	-4.943,17	4.041,57	7.473,38	-10.457,65
ERDVA0	2.194.012,76	0,51	0,07	0,00%	2.393.559,04	-2.393.559,04	1.462.065,65	-1.474.033,44
ETEN13	3.461.650,68	107,92	42,30	0,00%	-505.024,11	451.055,32	439.324,53	-542.202,41
EUCA4	144.837,00	28.930,65	10.825,05	0,01%	2.482.445,31	-2.482.445,31	363.928,48	-366.905,42
EZIC3	33.865,11	5.143,26	4.530,56	0,06%	-277.706,82	247.577,42	236.229,27	-298.035,73
FLRY3	97.026,05	20.005,09	19.592,22	0,01%	0,00	0,00	0,00	0,00
FVPI11	1.158.850,00	106.482,41	75.598,69	0,07%	4.400.250,36	-4.400.250,36	1.290.153,41	-1.300.714,01
GALG11	2.692.770,30	64.846,56	16.087,00	0,01%	1.067.991,48	-975.122,65	680.728,48	-686.300,61
GASPI9	2.852.463,31	63.923,25	59.596,71	0,06%	-143.585,47	127.063,25	122.543,46	-153.301,36
GBSPI11	9.910.608,49	291.750,75	269.314,19	0,25%	-395.596,94	2.092.294,86	6.728.687,56	-396.096,38
GGRA4	3.957.783,72	540.162,75	-453.006,94	-0,05%	3.270.188,74	-12.874.512,17	-40.344.842,38	32.784.860,40
GGP3	4.813.295,49	553.614,00	468.983,68	0,44%	-3.025.675,11	9.199.745,16	28.346.490,18	-3.041.124,24
GGSH12	2.462.823,09	1.361,57	687,36	0,00%	-1.566.476,00	71.653,37	71.653,37	-5.206.383,04
GMA3	9.152.364,88	1.799.471,94	1.343.944,23	1,25%	1.526.736,74	-51.078,92	-51.078,92	5.167.657,40
GOAU4	163.396,06	21.415,40	-3.549,39	0,00%	-327.746,52	3.834.617,21	9.630.880,74	-327.746,52
GOLL4	25.865,16	3.804,60	2.870,04	0,00%	1.133.490,77	-10.437.604,87	-25.927.846,10	1.133.490,77
GRRB14	1.117.619,73	305,56	157,03	0,00%	-790.120,45	5.854.629,97	14.419.033,79	-790.120,45
GRRB24	14.352.579,37	288.322,40	269.587,19	0,25%	-147.914,98	129.348,61	12.661,97	-156.684,48
GTLG11	214.000,00	5.315,85	-371,75	0,00%	5.949,66	-4.680,14	-8.667,24	12.603,66
GUAR15	2.684.138,10	2.746,59	1.425,93	0,00%	1.033.617,20	-1.033.617,20	757.641,41	-763.843,11
HAPV3	9.973.162,68	2.692.616,15	2.156.721,89	2,01%	3.325.662,68	-3.325.662,68	2.597.461,24	-2.607.070,41
HARG11	7.143.270,05	171.947,04	159.821,30	0,15%	0,00	0,00	0,00	0,00
HBRH11	2.482.							



RELATÓRIO DE CONTROLE DE RISCO E RENTABILIDADE - DEZEMBRO DE 2022



Relatório de Risco de Mercado



FUNDO: **EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS** CNPJ: **10679245000140** Data: 30/12/2022

Dados Gerais							
PL:	4.110.551.447,85	VAR / PL:	2,6097%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	1.867,29
VAR:	107.274.550,36	ETL / PL:	3,2277%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1.283,18
ETL:	134.526.614,00	VAR / CD:	0,0293%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	190.792.966,01	Cenário Baixa - 10000 (-):	295.918.235,24	CENARIO BRADESCO 1 (+):	382.183.500,50	CENARIO BRADESCO 2 (+):	33.770.182,15
Cenário Alta - 09999 (-):	(183.531.522,37)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(204.517.138,27)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(87.821.935,15)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(365.709.436,17)
Cenário Alta - 09999:	7.261.443,64	Cenário Baixa - 10000:	91.401.096,97	CENARIO BRADESCO 1:	294.361.565,36	CENARIO BRADESCO 2:	(331.939.254,02)

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
IDIJ2P349000	396.896,38	151.935,74	29.316,12	0,03%	-399,75	322,92	665,34	965,88
IDIJ2P349100	-3.278.660,40	1.077.140,56	-207.835,10	-0,19%	1.687.878,69	-1.697.878,69	711.168,62	-716.999,91
IDIJ2P348200	3.041.124,24	853.108,62	164.607,96	0,15%	-185.511,97	165.303,36	157.525,73	-199.134,83
IDIN23C359100	-71.653,37	142.578,49	40.747,88	0,04%	195.111,89	-156.089,51	114.413,61	-115.350,15
IDIN23C359200	51.078,92	111.836,40	-31.962,02	-0,03%	-500.002,74	449.166,28	424.330,98	-536.212,12
IDIN23P359000	3277,46,52	549.599,81	157.071,58	0,15%	-1.977,35	1.591,88	3.072,73	-4.397,14
IDIN23P359100	-1.133.480,77	1.711.338,67	-489.988,00	-0,46%	-586.151,68	521.168,16	496.966,14	-627.639,99
IDIN23P359200	700.120,45	1.071.339,92	306.198,21	0,29%	0,00	0,00	0,00	0,00
IGT437	2.164.666,15	3.668,91	-1.901,33	-0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
IGT111	5.168.086,00	632.351,85	521.908,33	0,49%	0,00	0,00	0,00	0,00
INDG23	0,00	3.858.312,45	2.546.124,34	2,37%	0,00	0,00	0,00	0,00
INSSN1	1.964.322,02	20.860,30	-11.884,55	-0,01%	0,00	0,00	0,00	0,00
INTE3	2.375.100,00	429.614,47	375.740,51	0,31%	0,00	0,00	0,00	0,00
PLI11	8.316.092,79	176.519,89	164.528,53	0,15%	0,00	0,00	0,00	0,00
IRBR12	10.511.793,66	196.821,43	180.797,31	0,17%	0,00	0,00	0,00	0,00
ITPO14	12.189.788,37	333.990,07	309.202,72	0,29%	2.082,57	-1.600,14	-3.166,37	4.865,44
ITS44	6.320.589,75	659.578,88	620.480,19	0,58%	0,00	0,00	0,00	0,00
ITUB4	31.035.825,00	3.331.039,83	3.737.338,45	3,48%	2.121,05	-1.625,09	2.582,20	-4.581,15
IWIA35	1.310.617,07	206,88	100,96	0,00%	4.133,47	-3.161,00	-6.042,78	9.285,54
JBS3	4.851.081,96	579.832,71	192.492,07	0,18%	6.280,56	-4.802,55	-9.176,05	14.100,59
JSMBL5	3.002.302,79	65.272,23	60.908,63	0,06%	4.219,93	-3.225,87	-6.147,30	9.447,55
KLBN11	780.447,57	128.990,83	65.675,19	0,06%	-15.176,32	12.523,83	22.508,42	-30.942,26
LCAMEA	7.885.451,32	174.381,25	162.599,05	0,15%	-204.539,24	158.912,86	140.540,69	-168.295,45
LCAM9A	2.022.460,40	1.095,79	552,65	0,00%	-88.568,20	68.051,85	63.156,86	-83.458,14
LCAMD1	9.177.087,75	203.217,74	189.522,67	0,18%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0021003Q1	2.101.902,44	0,00	0,00	0,00%	-6.480,04	6.914,25	15,23	-23,19
LF0021006S0	1.104.000,75	0,00	0,00	0,00%	-47.044,60	55.664,94	107,27	-163,31
LF0021006F1	1.148.067,25	0,00	0,00	0,00%	-26.662,34	34.345,44	66,81	-101,72
LF002100HDP	1.312.043,68	0,00	0,00	0,00%	-85.065,15	117.558,50	430,85	-656,94
LF002100HDQ	2.338.860,47	0,00	0,00	0,00%	-12.220,61	30.903,16	1.556,00	-2.366,18
LF002100ISJ	2.506.432,37	0,00	0,00	0,00%	-309,49	622,42	8,55	-922,71
LF00220018H	1.118.666,02	0,00	0,00	0,00%	-5.421,77	4.538,12	8.055,09	-10.851,73
LF002200D9	2.135.423,44	0,00	0,00	0,00%	-200.915,85	159.854,24	148.924,63	-185.432,55
LFSC10002GT	418.197,13	0,00	0,00	0,00%	-375.707,77	335.258,12	319.174,09	-402.644,25
LFSC1000089	6.599.731,69	0,00	0,00	0,00%	2.344.923,14	-2.344.923,14	1.718.828,66	-1.732.898,20
LFSC19000HY	406.600,65	0,00	0,00	0,00%	-373,84	303,77	644,25	-939,81
LFSC190054B	798.866,85	0,00	0,00	0,00%	-48.355,06	40.493,81	99.304,01	-148.088,93
LFSC190059S	1.206.996,98	0,00	0,00	0,00%	-779.067,88	688.923,94	1.160.027,87	-1.605.247,98
LFSC19005L1	788.805,34	0,00	0,00	0,00%	-241.975,18	217.876,91	211.201,99	-260.153,79
LFSC22002X	4.786.931,05	8.299,15	4.359,98	0,00%	550.876,25	-550.876,25	201.896,15	-203.548,77
LFNS210029N	3.470.779,58	0,00	0,00	0,00%	1.763.070,75	-1.763.070,75	516.932,34	-521.163,71
LFT20230301 - 210100	18.293.481,47	541,72	-210,86	0,00%	366.596,06	-366.596,06	179.143,27	-180.609,66
LFT20230901 - 210100	28.411.342,42	3.049,54	-44,94	0,00%	654.359,29	-654.359,29	191.889,70	-193.429,16
LFT20240301 - 210100	7.796.572,24	1.329,19	860,72	0,00%	61.975,51	-61.975,51	30.285,37	-30.533,27
LFT20240901 - 210100	17.459.185,74	3.836,32	3.107,43	0,00%	-428.911,14	382.795,51	373.561,15	-458.052,12
LFT20260901 - 210100	1.671.870,54	1.517,87	860,78	0,00%	-6.335,41	5.339,76	9.437,38	-12.565,64
LIGHB4	2.108.959,12	107,34	44,07	0,00%	-85,05	69,84	156,58	-231,06
LIGHD3	1.663.464,00	2.909,31	1.539,89	0,00%	-495.571,88	439.526,06	418.905,12	-529.444,04
LIGHD7	4.563.352,81	103.050,62	94.349,20	0,09%	28.880,52	-21.660,39	10.884,71	-10.671,35
LORTA7	5.748.070,24	129.250,40	120.485,06	0,1%	13.910,28	-13.910,28	6.771,49	-8.853,13
LTREN3	11.724.615,68	2.936.078,80	2.111.187,37	1,97%	-644.234,98	557.162,92	524.493,00	-670.381,04
LTREN11	1.142.569,10	186,10	88,86	0,00%	5.649,45	-4.409,21	-8.608,62	12.679,97
LTM20230701 - 100000	6.042.494,95	11.441,80	4.036,79	0,00%	1.207.073,25	-1.005.894,38	589.856,46	-594.684,76
LTM20250701 - 100000	14.719.955,10	464.011,11	247.920,36	0,23%	-17.919,66	13.965,92	308.383,07	-395.826,61
LTTES15	3.461.646,79	83.020,43	77.391,96	0,07%	-345.876,21	299.746,96	282.979,43	-363.740,98
LWSA3	1.377.190,62	278.414,68	221.516,15	0,21%	456.543,75	-456.543,75	133.898,63	-134.554,33
MALL11	3.526.141,50	175.463,13	111.481,11	0,10%	500.856,00	-500.856,00	73.425,49	-74.026,52
MATD3	1.221.986,85	177.104,66	151.444,43	0,14%	-177.501,60	177.501,60	43.369,56	-43.724,56
MAXR11	1.308.722,35	112.763,31	53.620,80	0,05%	467.758,19	-374.206,55	274.293,40	-276.538,64
MGLU3	206.585,04	57.258,73	43.901,69	0,04%	-446.066,16	371.420,39	354.853,49	-457.501,43
MGSPI12	6.010.466,75	144.081,08	124.913,35	0,12%	-575.231,97	553.454,07	332.246,39	-449.209,72
MOVI27	1.209.266,59	3.358,29	1.781,47	0,00%	-231.948,38	223.158,90	133.970,32	-181.132,95
MOVI33	786.200,17	34,05	14,65	0,00%	-299.457,27	322.603,92	236.353,98	-315.069,78
MOVI37	7.929.777,03	173.077,77	161.488,84	0,15%	-2.215.953,63	2.387.236,54	1.748.995,67	-2.331.484,69
MIRFG3	72.201,20	21.626,62	11.414,82	0,01%	-439.047,62	432.956,27	352.088,61	-466.277,70
MIRVE3	46.367,69	576.190,19	2.558,19	0,25%	-192.439,20	214.259,80	176.230,17	-230.448,55
MTRJ19	12.805.046,73	290.489,24	232.936,42	0,22%	-1.364.110,15	1.465.523,32	1.205.004,75	-1.576.255,50
MULP16	3.143.672,04	3.374,54	-1.660,95	0,00%	-310.744,00	369.033,72	294.630,44	-382.645,18
MULT3	4.023.577,50	469.077,75	399.525,34	0,37%	-326.491,24	397.300,33	326.396,25	-418.772,24
MVLV16	6.365.945,26	135.675,04	126.236,55	0,12%	-101.527,82	126.776,64	103.752,47	-130.914,25
NEWL11	913.887,50	48.338,58	36.228,11	0,04%	-1.380.561,27	1.698.917,39	1.390.373,53	-1.754.365,01
NEWU11	500.856,00	46.356,64	17.255,17	0,02%	-43.790,41	57.555,97	47.571,00	-95.095,71
NINJ3	295.836,00	57.586,15	16.990,29	0,02%	-24.489,99	32.284,23	27.032,16	-32.764,24
NTOC3	1.817.032,77	267.315,85	172.035,74	0,16%	-16.480.869,08	21.726.102,21	18.191.651,08	-22.049.133,52
NTEM11	9.678.155,78	185.951,81	172.851,68	0,16%	-139.639,67	172.519,64	172.730,33	-201.024,03
NTNB20230515 - 760199 - NEGOCIACAO	105.851.765,50	690.542,91	457.988,24	0,43%	-2.318.762,20	3.611.984,77	2.868.245,59	-3.338.069,69
NTNB20240915 - 760199 - NEGOCIACAO	16.111.363,32	299.481,92	162.504,25	0,16%	-122.189,15	114.126,75	85.195,24	-95.057,61
NTNB20250515 - 760199 - NEGOCIACAO	17.445.334,97	273.901,84	240.729,16	0,22%	-18.352.787,56	33.680.219,09	25.142.168,00	-28.847.789,96
NTNB20260815 - 760199 - NEGOCIACAO	9.533.205,05	96.640,97	87.669,46	0,08%	-1.273.001,72	2.429.797,92	1.803.072,07	-1.972.397,17
NTNB20270515 - 760199 - NEGOCIACAO	8.333.861,21	136.347,45	123.933,90	0,12%	-62.254.155,48	118.825.462,52	88.176.614,30	-96.456.799,63
NTNB20280815 - 760199 - NEGOCIACAO	7.459.816,58	124.556,48	112.714,04	0,11%	-176.946,32	361.677,29	260.421,98	-278.706,43
NTNB20300815 - 760199 - NEGOCIACAO	1.889.770,93	35.150,18	31.053,24	0,03%	-20.146.763,62	41.180.104,82	29.051.306,43	-31.733.159,42
NTNB2030815 - 760199 - NEGOCIACAO	706.207,40	14.703,34	12.671,41	0,01%	-44.947,99	93.306,38	66.957,72	-70.176,96
NTNB20350515 - 760199 - NEGOCIACAO	327.873,14	7.533,72	6.953,15	0,01%	-12.043,72	10.464,55	18.302,14	-23.033,82
NTNB20400815 - 760199 - NEGOCIACAO	1.661.324,61	44.417,04	42.743,70	0,04%	-13.916,21	11.672,37	20.777,59	-27.918,29
NTNB20450515 - 760199 - NEGOCIACAO	702.258,98	21.195,91	20.358,03	0,02%	-405.033,00			



Data: 30/12/2022

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO:	EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS						
CNPJ:	10679245000140						

Dados Gerais							
PL:	4.110.551.447,85	VAR / PL:	2,6097%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	1.867,29
VAR:	107.274.550,36	ETL / PL:	3,2727%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1.283,18
ETL:	134.526.614,00	VAR / CDI:	0,0293%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	190.792.966,01	Cenário Baixa - 10000 (-):	295.918.235,24	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	382.183.590,50	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	33.770.182,15
Cenário Alta - 09999 (-):	(183.531.522,37)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(204.517.138,27)	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	(87.821.935,15)	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(365.709.436,17)
Cenário Alta - 09999:	7.261.443,64	Cenário Baixa - 10000:	91.401.096,97	CENÁRIO BRADESCO 1:	294.361.565,36	CENÁRIO BRADESCO 2:	(331.939.254,02)

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
PASN12	9.771.059,52	155.560,90	144.951,60	0,14%	3.805.321,83	-4.566.385,95	2.231.440,60	-2.249.706,15
PATC11	9.799.412,00	740.762,91	476.297,09	0,44%	-281.622,13	230.621,95	177.198,50	-237.071,10
PCAR3	60.512,76	8.518,08	4.439,94	0,00%	784.977,40	-784.977,40	460.310,74	-464.078,64
PEJA11	10.556.015,04	223.215,47	208.493,23	0,19%	9.444.366,85	-9.444.366,85	2.307.573,63	-2.326.462,37
PETR3	9.537.105,00	1.730.949,52	1.197.886,86	1,12%	-81,88	66,94	148,53	-219,01
PETR4	15.221.286,50	3.079.788,42	2.099.358,28	1,96%	3.861.326,70	-3.861.326,70	1.132.140,99	-1.141.408,17
PETZ3	3.139.908,56	440.145,32	281.896,91	0,26%	7.855,95	-7.855,95	4.489,45	-4.526,20
PRIO3	15.740.611,41	2.497.678,30	1.793.909,87	1,67%	-144.102,34	110.530,29	103.288,35	-136.197,03
PRLG14	2.236.014,17	33,14	14,32	0,00%	-1.019.324,30	-1.019.324,30	747.164,72	-753.280,66
QAGR11	7.722.653,40	534.722,70	394.431,20	0,37%	-1.080.475,74	979.097,31	954.733,05	-1.164.515,05
QUAL3	30.623,79	6.446,07	2.730,53	0,00%	4.199.510,37	-3.079.727,86	1.368.123,49	-1.379.322,32
QAHT12	4.409.027,20	81.237,90	73.346,62	0,07%	26.394,68	-26.394,68	11.055,60	-11.146,10
RADL3	5.096.621,52	532.088,83	420.560,66	0,39%	0,00	0,00	0,00	0,00
RAHD11	14.057.462,31	363.938,11	337.575,62	0,31%	2.965.116,00	-2.965.116,00	434.686,01	-438.244,15
RAIL3	9.332.356,70	1.113.805,42	868.093,18	0,81%	0,00	0,00	0,00	0,00
RAIZ4	75.413,36	10.589,50	6.499,87	0,01%	-3.301,60	2.683,44	5.016,65	-7.073,54
RBGAPM2	716.153,31	3.191,02	-378,21	0,00%	-42.563,79	4.214,77	11.194,65	-16.155,30
RBLR11	2.965.116,00	133.958,22	77.633,37	0,07%	845.727,70	-845.727,70	413.278,93	-416.061,85
RCCB11	5.473.942,73	510.056,35	397.123,86	0,37%	-5.355,32	5.476,91	9.586,34	-12.259,24
RDCO10	2.177.656,70	1.832,91	942,38	0,00%	-272.229,79	243.461,30	237.008,84	-293.191,71
RDR03	2.819.092,32	393.664,76	163.648,87	0,15%	2.180.258,80	-2.180.258,80	532.709,90	-537.070,42
RDR09	1.150.919,12	3.247,83	1.731,56	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
RDVE11	3.845.515,96	83.559,88	66.891,27	0,08%	4.595.107,44	-3.620.397,68	2.041.341,67	-2.068.051,15
REC3	3.633.764,66	701.016,15	545.534,64	0,51%	655,84	1.351,15	1.959,69	-1.952,86
RENT1	13.008,84	14.024,97	2.312,65	0,00%	-581.172,09	545.149,36	535.538,01	-638.555,79
RENT3	13.924.568,00	2.797.829,57	2.448.843,51	2,28%	64.664,71	-64.664,71	18.959,69	-19.114,89
RLOG11	1.582.283,08	436,06	216,60	0,00%	1.371.933,15	-1.371.933,15	335.209,00	-337.952,87
RMSA12	5.603.395,00	182.970,78	168.173,85	0,16%	-562,43	471,90	925,91	-1.326,87
RNOG11	129.329,42	8.804,57	41,94	0,00%	-288.075,51	246.351,38	232.260,71	-288.166,42
RRRP3	2.286.555,25	658.298,37	603.801,71	0,56%	42.375,21	-42.375,21	31.061,03	-31.315,28
RSAN24	1.090.861,90	315,54	159,00	0,00%	-30.094,96	-20.826,06	134,64	-182,72
RSAN44	5.941.668,04	117.425,53	109.270,94	0,10%	-333,16	270,24	589,71	-868,44
SANB11	211.876,94	17.207,98	13.428,98	0,01%	1.002.086,25	-1.002.086,25	587.623,38	-592.433,39
SBC11	1.658.729,24	136,73	59,42	0,00%	-361.169,77	261.107,99	228.995,27	-305.091,80
SBS3	4.008.345,00	548.739,09	305.965,83	0,29%	53.139,65	-53.139,65	25.967,58	-26.180,13
SLEC3	177.132,16	15.290,69	-318,78	0,00%	57.442,32	-57.442,32	28.070,15	-28.299,92
SMT03	191.474,40	24.184,77	1.026,86	0,00%	-1.356,74	1.098,99	2.200,51	-3.173,27
SNOG18	2.489.922,64	719,99	357,68	0,00%	1.578.092,26	-1.578.092,26	771.161,08	-777.473,45
SOMA3	5.286.307,52	1.121.810,99	1.036.428,00	0,97%	862.692,68	-862.692,68	361.344,96	-364.302,76
STB3	2.464.836,00	436.570,75	348.272,28	0,32%	3.819.148,74	-3.055.318,89	2.239.548,82	-2.257.800,74
SUB3	15.276.594,96	3.004.100,80	1.006.996,62	0,94%	36.646,19	-36.646,19	21.689,33	-21.665,23
TAE11	146.584,76	10.810,98	7.045,46	0,01%	-138.010,39	117.228,57	92.477,24	-123.553,42
TCHI1	10.864.996,53	298.733,04	276.317,19	0,26%	-893.033,18	816.361,88	797.373,90	-965.632,76
TEND3	354.480,00	65.519,36	28.141,25	0,03%	124.068,00	-124.068,00	51.966,77	-52.392,14
TEPP11	7.935.123,17	843.846,29	701.148,13	0,63%	3.967.561,59	-3.967.561,59	1.163.289,06	-1.172.811,21
TMS3	3.106.671,20	317.692,49	151.227,23	0,14%	994.134,78	-714.534,38	455.438,00	-459.166,00
TNHL11	6.534.118,77	174.916,30	161.916,88	0,15%	-514.649,04	468.722,32	456.857,33	-554.903,43
TOT3	3.871.743,98	577.233,75	460.188,31	0,43%	774.348,80	-774.348,80	667.597,67	-572.243,76
TRF11	13.022.817,20	431.261,35	276.008,37	0,26%	6.511.308,60	-6.511.308,60	1.909.115,68	-1.924.742,82
TRF13	3.218.326,05	110.770,02	61.558,61	0,05%	0,00	0,00	0,00	0,00
UGEL11	880.519,42	733,59	380,33	0,00%	-1.324,05	1.082,40	2.011,13	-2.819,53
UGP3	4.578.602,73	542.104,36	110.929,90	0,10%	1.144.650,68	-915.720,55	671.223,16	-676.717,48
UHSM12	8.139.751,70	229.327,34	211.768,44	0,20%	-723.577,07	658.354,54	649.415,47	-789.821,44
UNEG11	6.643.811,62	185.317,22	171.626,30	0,16%	-576.218,07	526.314,63	517.449,91	-626.479,28
USIM3	158.307,60	13.634,99	-5.037,09	0,00%	61.739,96	-34.827,67	23.207,69	-23.397,86
UTPS11	3.988.380,96	62.131,14	57.372,31	0,05%	-134.244,39	109.133,27	101.123,07	-131.908,78
UTPS21	3.999.699,91	100.291,22	93.108,37	0,09%	-304.645,62	274.065,47	267.242,82	-329.745,98
UTPS22	9.499.102,35	245.013,22	227.182,55	0,21%	-752.489,87	679.083,93	663.280,43	-816.823,27
VALE3	46.045.883,84	5.125.913,89	-2.590.894,61	-2,42%	11.511.470,96	-11.511.470,96	6.750.326,57	-6.805.581,63
VAMO22	1.121.787,54	583,16	298,11	0,00%	-1.059,96	860,81	1.841,72	-2.330,57
VAMO33	7.127.881,64	158.364,39	147.729,85	0,14%	-452.362,69	402.175,15	302.598,93	-484.158,66
VAMO34	6.538.225,63	143.971,89	134.261,20	0,13%	-413.093,22	367.040,73	349.882,24	-441.929,15
VBBR3	8.315.689,05	1.060.347,96	866.479,83	0,81%	2.078.922,26	-2.078.922,26	1.219.080,02	-1.229.058,84
VCCS11	1.301.467,38	3.144,74	1.671,99	0,00%	-6.015,29	5.111,11	8.969,59	-11.783,21
VECS11	1.787.076,55	553,14	278,23	0,00%	-992,92	796,98	1.553,69	-2.233,14
VERDEC2	1.119.707,36	172.349,89	55.556,65	0,05%	0,00	0,00	0,00	0,00
VIA3	74.632,60	25.676,66	14.338,08	0,01%	33.584,76	-33.584,76	10.941,17	-11.030,73
VMT13	6.533.658,10	154.983,93	144.320,01	0,13%	-455.863,16	406.451,14	394.927,43	-489.405,03
VIVT3	629.860,40	32.688,14	15.809,46	0,01%	94.479,06	-94.479,06	92.337,54	-93.093,37
VIXL14	2.126.421,17	1.003,06	507,32	0,00%	-1.852,78	1.504,51	2.944,63	-4.214,49
VIRD12	4.480.808,58	102.210,47	95.257,49	0,09%	-292.380,37	258.843,54	249.714,39	-312.842,15
VVED15	1.813.099,91	1.652,42	870,40	0,00%	-2.997,75	2.462,02	4.456,98	-6.170,02
VVED16	1.076.497,86	1.141,74	599,92	0,00%	-2.074,43	1.712,75	3.088,55	-4.251,04
VWDF23	-0,05	0,00	0,00	0,00%	86.716,44	-98.494,63	114.661,38	-115.582,03
VWDOG23	-0,59	79.802,89	7.194,93	0,01%	-158.360,48	173.838,84	-212.139,37	213.326,70
WEGE3	8.563.199,13	1.463.184,94	959.869,60	0,89%	2.140.777,55	-2.140.799,78	1.255.364,99	-1.265.840,83
WING23	0,00	1.318.841,35	-970.311,59	-0,81%	-1.135.879,83	1.133.573,60	-897.856,06	891.144,07
XPIN11	3.189.983,66	254.276,78	211.586,20	0,20%	1.594.991,83	-1.594.991,83	467.651,61	-471.147,59
XXPR11	2.716.775,90	212.185,48	94.487,83	0,09%	1.358.387,95	-1.358.387,95	398.279,35	-401.539,48
YDUQ3	1.871.076,60	466.632,63	389.915,73	0,36%	729.719,87	-467.769,15	274.299,83	-276.545,12
Total Var:	4.159.606.016,24	158.549.624,32	107.274.550,36	99,92%	7.261.443,63	91.401.096,97	294.361.565,36	-331.939.254,02



bradesco

Data: 30/12/2022

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: EMBRAERPREV RENDA FIXA
CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais

PL:	2.456.197.068,08	VAR / PL:	1,9865%	Limite Fundo:	-	Duration DC:	2.623,81
VAR:	48.792.489,03	ETL / PL:	2,4912%	Status:	ENQUADRADO	Duration DU:	1.803,54
ETL:	61.187.749,71	VAR / CDI:	0,0223%	Benchmark:			

Cenários de STRESS

Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (+):	232.692.473,85	CENARIO BRADESCO 1 (+):	175.613.509,81	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
Cenário Alta - 09999 (-):	(133.484.396,90)	Cenário Baixa - 10000 (-):	-	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(197.013.310,98)
Cenário Alta - 09999:	(133.484.396,90)	Cenário Baixa - 10000:	232.692.473,85	CENARIO BRADESCO 1:	175.613.509,81	CENARIO BRADESCO 2:	(197.013.310,98)

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
CAIXA	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
FI RF EMB II	2.362.177.420,95	46.950.851,96	46.941.726,25	96,21%	-129.146.120,52	229.074.526,80	172.334.446,32	-192.736.480,69
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	142.634.403,97	2.069.337,73	1.850.762,78	3,79%	-4.338.276,38	3.617.947,05	3.279.063,49	-4.276.830,29
Total Var:	2.504.811.824,92	49.020.189,68	48.792.489,03	100,00%	-133.484.396,90	232.692.473,85	175.613.509,81	-197.013.310,98

Relatório de Risco de Mercado



bradesco

Data: 30/12/2022

FUNDO: EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL
CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais

PL:	556.947.111,72	VAR / PL:	6,7574%	Limite Fundo:	-	Duration DC:	3,19
VAR:	48.773.889,28	ETL / PL:	10,9821%	Status:	ENQUADRADO	Duration DU:	1,13
ETL:	61.164.424,87	VAR / CDI:	0,0985%	Benchmark:			

Cenários de STRESS

Cenário Alta - 09999 (+):	137.728.566,13	Cenário Baixa - 10000 (+):	-	CENARIO BRADESCO 1 (+):	73.388.594,72	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
Cenário Alta - 09999 (-):	-	Cenário Baixa - 10000 (-):	(134.637.646,18)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(73.989.074,26)
Cenário Alta - 09999:	137.728.566,13	Cenário Baixa - 10000:	(134.637.646,18)	CENARIO BRADESCO 1:	73.388.594,72	CENARIO BRADESCO 2:	(73.989.074,26)

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
CAIXA	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
FIA RVA EMB II	239.884.083,56	19.036.368,54	18.875.733,93	39,70%	57.934.455,83	-56.942.942,50	32.751.355,05	-33.015.690,50
FIA RVA EMB III	87.546.394,87	11.156.135,92	10.917.401,49	22,38%	25.930.541,23	-25.491.931,46	12.263.273,95	-12.367.671,39
FIA RVA EMB IV	90.078.380,03	9.747.810,74	9.523.179,63	19,53%	25.164.337,76	-23.844.561,96	12.191.060,39	-12.291.290,22
FIC FIA EMB VIII ETF	24.656.599,48	1.481.969,87	1.431.273,72	2,93%	0,00	0,00	0,00	0,00
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	112.626.617,11	8.180.083,27	8.026.300,50	16,46%	28.699.231,32	-28.358.210,26	16.182.905,33	-16.314.422,14
Total Var:	554.792.075,05	49.602.368,34	48.773.889,28	100,00%	137.728.566,13	-134.637.646,18	73.388.594,72	-73.989.074,26



Relatório de Risco de Mercado



FUNDO:		FI RF EMB II				Limite Fundo:		Dutacion DC:		2,725,43
CNPJ:		11005764000196				Status:		Dutacion DU:		1,873,44
Dados Gerais										
PL:	2.307.376.825,56	VAR / PL:	2,0348%	Limite Fundo:	ENQUADRADO	Dutacion DC:				
VAR:	46.950.851,96	ETL / PL:	2,5517%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:				
ETL:	59.878.262,52	VAR / CDI:	0,0229%	Benchmark:						
Cenários de STRESS										
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (-):	229.094.879,53	CENARIO BRADESCO 1 (+):	172.334.446,31	CENARIO BRADESCO 2 (+):				
Cenário Alta - 09999 (-):	(129.146.120,52)	Cenário Baixa - 10000 (+):	(20.352,74)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):				
Cenário Alta - 09999:	(129.146.120,52)	Cenário Baixa - 10000:	229.074.526,80	CENARIO BRADESCO 1:	172.334.446,31	CENARIO BRADESCO 2:	(192.736.480,69)			
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		
OSMGC3	15.553.894,69	159.848,64	132.201,01	0,25%	0,00	0,00	0,00	0,00		
ELET42	12.970.703,65	258.109,64	241.674,47	0,51%	0,00	0,00	0,00	0,00		
ENTV12	12.321.115,34	254.864,99	239.248,12	0,51%	-12.643,31	12.892,72	59.011,76	-89.814,19		
GASP17	50.073.506,97	941.188,09	481.570,96	1,03%	0,00	0,00	0,00	0,00		
IGSN15	2.995.972,92	52.919,95	49.867,65	0,11%	-274.281,33	185.416,80	168.287,11	-224.086,83		
NEOE16	6.587.005,81	132.639,55	124.442,23	0,27%	0,00	0,00	0,00	0,00		
NTNB20230515 - 760199	42.682.163,51	278.444,72	141.751,09	0,30%	-663.130,12	575.638,75	541.104,55	-696.404,60		
NTNB20240815 - 760199	119.222.467,72	1.550.138,46	1.256.657,43	2,68%	-678.576,95	591.478,27	559.046,90	-714.648,22		
NTNB20260815 - 760199	40.582.798,07	661.018,96	599.750,85	1,28%	-1.782.272,90	2.133.203,22	1.783.852,40	-2.312.949,85		
NTNB20300815 - 760199	25.056.559,84	471.043,11	437.414,71	0,93%	-147.914,98	129.348,61	124.661,97	-156.684,48		
NTNB20350515 - 760199	220.646.625,53	5.969.915,80	4.939.787,81	10,50%	-345.875,21	299.746,88	282.979,43	-363.740,98		
NTNB20400815 - 760199	27.586.838,14	737.559,49	736.408,06	1,57%	-231.948,38	223.158,90	133.970,32	-181.132,95		
NTNB20450515 - 760199	207.245.304,10	6.255.174,08	6.218.981,11	13,25%	-2.215.953,63	2.387.236,54	1.748.995,67	-2.331.484,69		
NTNB20500815 - 760199	663.947.925,23	21.147.642,38	21.040.239,03	44,81%	-1.364.110,15	1.465.525,32	1.205.404,75	-1.576.255,50		
NTNB20550515 - 760199	205.992.290,64	6.982.511,33	6.946.878,08	14,80%	-1.360.561,27	1.698.917,39	1.396.373,53	-1.754.365,01		
PETR45	17.552.115,13	180.150,36	147.959,33	0,32%	-16.480.869,98	21.725.107,21	18.191.651,08	-22.049.133,52		
SBESC7	7.220.458,47	19.437,64	4.397,14	0,01%	-2.318.762,30	3.811.984,77	2.868.243,59	-3.338.063,69		
SBSPC2	9.386.089,67	118.709,08	97.101,55	0,21%	-18.352.787,56	33.680.213,09	25.142.168,00	-28.347.787,96		
SBTOPIND	220.895.176,14	3.256.429,41	3.124.511,34	6,65%	-62.254.155,48	118.825.462,52	88.176.416,30	-96.456.799,63		
CAIXA	5.000,00	0,00	0,00	0,00%	-20.146.763,62	41.180.104,62	29.651.306,43	-31.733.150,42		
COMPROMISSADA_PRE	454.224.922,66	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00		
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-81.513,33	0,00	0,00	0,00%	-281.622,13	220.621,85	177.198,50	-237.071,10		
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-29.410,98	-20.352,74	131,58	-178,56		
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-204.471,15	147.822,08	129.642,43	-172.723,40		
Total Var:	2.362.177.420,92	48.527.745,68	46.950.851,96	100,02%	-129.146.120,52	229.074.526,80	172.334.446,31	-192.736.480,69		

Relatório de Risco de Mercado



FUNDO:		FI RF EMB V CREDITO PRIVADO				Limite Fundo:		Dutacion DC:		939,20
CNPJ:		20726178000121				Status:		Dutacion DU:		644,68
Dados Gerais										
PL:	148.820.242,52	VAR / PL:	1,3905%	Limite Fundo:	ENQUADRADO	Dutacion DC:				
VAR:	2.069.337,72	ETL / PL:	1,7437%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:				
ETL:	2.595.032,99	VAR / CDI:	0,0156%	Benchmark:						
Cenários de STRESS										
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (-):	3.621.502,07	CENARIO BRADESCO 1 (+):	3.279.063,49	CENARIO BRADESCO 2 (+):				
Cenário Alta - 09999 (-):	(4.338.276,38)	Cenário Baixa - 10000 (+):	(3.555,01)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(4.276.830,29)			
Cenário Alta - 09999:	(4.338.276,38)	Cenário Baixa - 10000:	3.617.947,05	CENARIO BRADESCO 1:	3.279.063,49	CENARIO BRADESCO 2:	(4.276.830,29)			
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		
JT7H04854	8.596.908,93	124.777,50	124.334,63	0,01%	-243.620,43	197.632,28	178.032,88	-233.852,35		
AEGP23	14.067.660,30	219.330,86	215.778,73	10,43%	-357.358,04	271.275,05	241.341,06	-320.446,54		
CCRDD1	5.950.254,83	68.012,14	66.819,03	3,23%	0,00	0,00	0,00	0,00		
CMDT33	2.021.004,84	18.023,68	17.697,84	0,86%	-111.846,82	89.947,55	73.207,84	-97.741,72		
ECPFT11	1.093.280,05	2.943,13	1.068,00	0,05%	-32.893,17	20.885,78	19.261,81	-25.676,00		
ENJG21	1.793.591,87	28.130,30	27.970,59	1,35%	-6,47	6,59	30,18	-45,93		
ENM121	1.116.693,36	17.912,57	17.813,50	0,86%	0,00	0,00	0,00	0,00		
ENTV12	16.197.132,88	335.041,27	328.428,26	15,87%	0,00	0,00	0,00	0,00		
ERDV17	12.356.191,35	185.188,78	182.020,95	8,80%	-4.453,24	-3.081,69	19,92	-27,04		
ERDV36	3.966.011,92	45.993,95	45.184,31	2,18%	-53.975,09	43.016,37	38.857,59	-51.114,02		
GASP17	10.960.035,92	194.726,57	124.161,40	6,00%	-34.572,67	27.656,32	25.056,71	-32.958,25		
GEP24	7.411.449,03	66.176,50	42.669,15	2,06%	-892.045,95	775.547,48	734.913,74	-939.654,64		
GRRB24	14.387.728,55	289.028,50	283.992,87	13,72%	-304.351,97	202.519,26	202.517,38	-269.096,00		
LFSN16000GM	1.570.575,85	138.299,24	135.690,10	6,56%	-75.412,47	61.206,96	49.666,27	-66.307,75		
LFSN1600DC5	2.766.750,77	53.077,65	52.411,87	2,53%	-368.746,12	441.352,39	369.072,91	-478.541,35		
OMGES1	12.072.800,66	219.097,80	217.311,79	10,50%	-89.820,47	46.393,98	35.404,62	-47.776,39		
RDCO34	5.491.809,12	19.558,41	11.683,25	0,56%	-753.065,03	648.495,83	614.404,28	-790.159,27		
SBESC7	167.917,64	452,04	167,11	0,01%	-204.550,24	156.912,86	140.543,69	-186.635,45		
SBSPC2	7.193.129,21	90.973,96	88.960,05	4,30%	-88.568,20	68.081,55	63.156,86	-83.458,14		
TAE33	7.846.954,36	86.726,02	85.154,30	4,12%	-405.033,00	309.343,34	290.547,96	-382.468,17		
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00		
COMPROMISSADA_PRE	232.307,79	0,00	0,00	0,00%	-42.563,79	4.214,77	11.194,65	-15.155,30		
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-26.785,29	0,00	0,00	0,00%	-683,98	-473,32	3,06	-4,15		
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-156.698,63	113.285,01	99.352,85	-132.368,40		
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-138.010,39	117.228,57	92.477,24	-123.553,42		
Total Var:	142.634.403,93	2.203.472,87	2.069.337,72	100,00%	-4.338.276,38	3.617.947,06	3.279.063,49	-4.276.830,29		



Data: 30/12/2022

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIM EMB I A
CNPJ: 20725946000122

Dados Gerais							
PL:	334.191.503,66	VAR / PL:	0.2939%	Limite Fundo:	ENQUADRADO	Dutacion DC:	275,99
VAR:	982.229,34	ETL / PL:	0.3686%	Status:		Dutacion DU:	188,37
ETL:	1.231.755,21	VAR / CDI:	0.0033%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	14.213.005,00	Cenário Baixa - 10000 (-):	30.357.492,61	CENARIO BRADESCO 1 (+):	72.684.098,51	CENARIO BRADESCO 2 (+):	25.565.002,88
Cenário Alta - 09999 (-):	(15.583.678,29)	Cenário Baixa - 10000 (+):	(30.885.002,42)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(79.798.269,31)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(27.046.124,42)
Cenário Alta - 09999:	(1.370.673,29)	Cenário Baixa - 10000:	(527.509,81)	CENARIO BRADESCO 1:	(7.114.170,80)	CENARIO BRADESCO 2:	(1.481.121,54)

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
ANIB10	738.966,38	176,53	50,73	0,01%	-322,72	262,91	503,82	-715,77
BCBF14	270.953,63	81,82	22,43	0,00%	-154,27	125,36	253,05	-365,28
CAIXA	6.935,89	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CBAN22	2.381.652,77	8.987,55	2.405,21	0,24%	-23.253,55	22.797,18	36.475,37	-38.328,53
CGBP13	2.260.038,58	3.180,95	985,73	0,10%	-5.972,62	5.011,56	8.943,07	-12.014,87
COMPROMISSADA PRE	179.921.497,76	0,00	0,00	0,00%	-5.008,10	5.106,89	23.374,95	-35.575,99
CONTAS A PAGAR_RECEBER	-59.258,85	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPMG23C100000	14.751,48	2,78	0,01	0,00%	-2,78	18,00	48,01	-72,78
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DHF23	0,07	0,10	0,00	0,00%	24,79	-25,78	-116,93	177,97
DHF24	-7.402,04	434.212,54	-100.834,22	-10,26%	878.354,33	-691.497,12	-1.428.768,69	2.200.601,48
DHF25	-4.612,38	141.474,61	-44.724,62	-4,55%	231.205,83	-185.368,78	-332.020,58	468.088,01
DHF26	1.432,98	28.879,54	8.975,08	0,91%	-11.441,22	42.631,44	73.473,36	-99.753,50
DHF27	194.070,82	4.015.537,30	1.263.663,92	12,85%	-7.679.529,62	6.539.838,87	11.204.150,99	-14.645.893,65
DHF31	-219.152,80	3.161.578,73	-963.901,46	-9,81%	6.793.498,60	-6.244.842,71	-10.875.883,75	12.233.127,11
DHJ23	174,30	1.507,32	81,43	-0,01%	-25.964,41	26.336,11	116.268,03	-176.319,80
DHJ23	274,13	26.320,35	1.285,04	0,13%	235.741,45	-239.492,14	-722.050,60	1.087.627,72
DOLF23	0,05	0,00	0,00	0,00%	-86.716,44	98.494,63	-114.661,38	115.582,03
ELET13	2.092.115,66	1.489,63	439,24	0,04%	-2.644,64	2.147,63	4.013,11	-5.671,03
EQTL13	1.473.756,07	158,70	37,54	0,00%	-333,47	272,16	587,90	-861,31
ETEN13	1.349.221,85	42,06	6,72	0,00%	-136,64	117,07	230,16	-431,47
GRRB14	1.117.619,73	305,56	88,88	0,01%	-544,03	440,25	825,35	-1.168,60
IDJ23P348000	396.096,38	151.935,74	-7.417,98	-0,76%	-395.596,94	2.092.294,86	6.728.687,56	-396.096,38
IDJ23P348100	-3.278.660,40	1.077.140,56	52.589,38	5,35%	3.270.188,74	-12.874.512,17	-40.344.842,38	3.278.660,40
IDJ23P348200	3.041.124,24	853.108,62	-41.651,44	-4,24%	-3.025.675,11	9.199.745,18	28.346.490,18	-3.041.124,24
IDN23C359100	-71.853,37	142.578,49	5.976,11	0,61%	-1.566.476,00	71.853,37	71.853,37	-5.206.383,04
IDN23C359200	51.078,92	111.836,40	-4.687,57	-0,48%	1.526.736,74	-51.078,92	-51.078,92	5.167.657,40
IDN23P359000	327.746,52	549.599,81	23.036,23	2,35%	-327.746,52	3.834.617,21	9.630.880,74	-327.746,52
IDN23P359100	-1.133.480,77	1.711.338,67	-71.730,00	-7,30%	1.133.480,77	-10.437.604,87	-25.927.846,10	1.133.480,77
IDN23P359200	790.120,45	1.071.399,92	44.907,25	4,57%	-790.120,45	5.854.626,97	14.419.031,79	-790.120,45
IVIA35	1.310.617,07	206,98	54,27	0,01%	-399,75	323,92	665,34	-965,88
LF002100ES0	1.104.001,75	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002100HDP	1.312.043,68	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002100HDQ	2.338.860,47	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002100ISJ	2.506.432,37	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF00220018H	1.118.666,02	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFSC1900089	3.299.965,84	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20230301 - 210100	18.293.481,47	541,72	-300,42	-0,03%	-6.480,04	6.914,25	15,23	-23,19
LFT20230901 - 210100	2.523.209,81	270,83	-56,33	-0,01%	-4.178,03	4.943,60	9,53	-14,50
MOV13	786.200,17	34,05	6,76	0,00%	-85,05	69,84	156,58	-231,06
NTNB20230515 - 760199	91.778.731,40	588.734,96	487.754,58	49,66%	-498.754,66	479.854,79	288.074,10	-389.487,11
NTNB20500815 - 760199	11.540.495,92	367.577,59	322.054,06	32,75%	-1.082.070,14	2.065.363,89	1.532.837,72	-1.676.563,14
OMGE13	1.078.642,59	1.563,00	475,69	0,05%	-2.929,27	2.456,86	4.373,55	-5.876,62
OUTRAS DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PRLG14	2.236.014,17	33,14	6,65	0,00%	-91,88	66,94	148,53	-219,01
VAMO22	1.121.787,54	583,16	167,86	0,02%	-1.059,96	860,81	1.641,72	-2.330,57
WDOF23	-0,05	0,00	0,00	0,00%	86.716,44	-88.494,63	114.661,38	-115.582,03
WDOG23	0,21	28.501,03	2.635,43	0,27%	56.557,31	-62.085,30	75.764,06	-76.188,11
Total Var:	334.004.368,46	14.490.920,84	982.229,34	100,00%	-1.370.673,29	-527.509,81	-7.114.170,80	-1.481.121,54



Relatório de Risco de Mercado

Data: 30/12/2022

FUNDO: FIM EMB II A
CNPJ: 20725957000102

Dados Gerais							
PL:	197.588.997,37	VAR / PL:	1,0835%	Limite Fundo:	ENQUADRADO	Duração DC:	629,72
VAR:	2.140.797,78	ETL / PL:	1,3587%	Status:		Duração DU:	431,91
ETL:	2.684.846,78	VAR / CDI:	0,0122%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	2.586.582,27	Cenário Baixa - 10000 (-):	6.250.246,93	CENARIO BRADESCO 1 (+):	6.831.811,18	CENARIO BRADESCO 2 (+):	2.698.221,86
Cenário Alta - 09999 (-):	(5.805.896,35)	Cenário Baixa - 10000 (+):	(2.445.141,69)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(2.267.363,85)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(8.521.163,13)
Cenário Alta - 09999:	(3.219.314,08)	Cenário Baixa - 10000:	3.805.105,24	CENARIO BRADESCO 1:	4.564.447,33	CENARIO BRADESCO 2:	(5.822.941,27)

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
AEGP13	657.892,11	0,07	0,04	0,00%	1,33	1,42	6,25	-9,50
CAIXA	9.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	48.193.915,17	0,00	0,00	0,00%	-1.341,47	1.367,94	6.261,23	-5.929,41
CONTAS A PAGAR_RECEBER	-89.676,10	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPGT14	153.670,07	90,83	-58,32	0,00%	338,47	-286,99	-674,40	1.026,53
CPGT16	305.872,79	257,24	-189,61	-0,01%	479,88	-383,05	-773,23	1.145,51
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DHF23	4.997.460,49	0,56	-0,03	0,00%	-137,71	143,24	649,62	-988,69
DHF24	3.000.887,36	29.585,62	21.385,58	1,00%	-59.881,86	47.116,04	97.419,11	-142.445,79
DHF25	15.048.510,01	403.308,23	310.466,40	14,50%	-659.109,16	528.439,36	946.506,42	-1.334.400,15
DHF26	2.101.485,54	78.762,36	60.204,00	2,81%	-140.294,24	116.287,56	290.261,89	-272.055,00
DHF27	1.866.525,53	86.355,64	66.300,51	3,10%	-165.151,18	140.641,70	240.943,48	-314.965,46
DHF29	882.275,07	55.707,42	42.492,92	1,98%	-115.572,15	102.595,20	176.574,41	-213.936,06
DHF31	309.288,86	24.748,17	18.859,56	0,88%	-53.178,07	48.883,31	85.134,12	-95.680,06
DHF33	152.827,36	14.821,69	11.285,14	0,53%	-32.385,50	30.765,96	54.142,63	-56.508,17
DHJ23	290.381,51	88,52	46,59	0,00%	-793,74	806,37	2.431,15	-3.662,05
DHJ24	1.286.858,46	18.871,36	13.936,22	0,65%	-32.738,83	25.843,84	51.463,14	-74.565,19
DHJ25	-2.814.482,29	4.836,05	-2.883,82	-0,13%	22.181,10	-19.208,12	-46.343,55	69.107,92
DHJ24	1.334.646,20	26.213,96	19.560,66	0,91%	-41.752,77	32.971,02	63.381,01	-91.008,16
DHJ25	-13.259.381,19	423.297,51	-324.842,97	-15,17%	726.664,39	-593.045,43	-1.037.664,52	1.436.836,45
DIV23	90.863,44	456,28	315,85	0,01%	-1.226,86	1.010,50	2.254,93	-3.328,12
DIV24	486.119,74	11.326,12	8.613,81	0,40%	-18.256,93	14.539,60	26.895,66	-38.259,47
ERDV18	1.378.708,53	47,27	32,63	0,00%	-136,29	115,77	274,11	-406,35
INDG23	10.110.373,00	2.127.917,78	1.461.512,09	68,27%	1.832.713,90	-1.628.992,87	1.432.533,71	-1.437.838,83
LFSC19002GT	418.197,13	0,00	0,00	0,00%	2.082,57	-1.600,14	-3.166,37	4.865,44
LFSC1900689	3.299.855,84	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFSC19000HY	406.600,65	0,00	0,00	0,00%	1.121,95	-1.625,09	-2.982,20	4.581,15
LFT20230901 - 210100	25.446.570,90	2.731,31	869,10	0,04%	-42.135,42	49.856,21	96,07	-146,27
LFT20240301 - 210100	7.796.572,24	1.329,19	903,03	0,04%	-26.662,34	34.345,44	66,81	-101,72
LFT20240901 - 210100	16.399.524,17	3.697,41	3.093,68	0,14%	-79.903,17	110.423,45	404,70	-616,13
LFT20260901 - 210100	1.671.870,54	1.517,87	398,12	0,02%	-12.220,61	30.903,16	1.556,00	-2.366,18
LTN20230701 - 100000	6.042.494,95	11.441,80	7.420,06	0,35%	-48.355,06	40.493,81	99.304,01	-148.088,93
LTN20250701 - 100000	14.719.955,10	464.011,11	356.324,96	16,64%	-779.067,88	688.923,94	1.160.027,87	-1.605.247,98
NTNB20230515 - 760199	13.988.475,10	91.256,32	39.475,96	1,84%	-76.017,80	73.137,17	43.906,88	-59.363,76
NTNB20240815 - 760199	16.010.059,48	208.163,86	190.131,96	8,88%	-297.574,36	320.875,47	234.867,85	-313.088,71
NTNB20250515 - 760199	16.883.746,81	265.084,58	248.615,02	11,61%	-424.914,10	419.018,84	340.754,41	-451.267,61
NTNB20260815 - 760199	4.468.166,07	72.778,19	68.705,32	3,21%	-150.188,53	161.354,04	132.715,06	-173.545,73
NTNB20270515 - 760199	7.677.084,06	125.602,15	117.609,37	5,49%	-286.254,81	339.950,81	271.411,13	-352.489,58
NTNB20280815 - 760199	2.864.796,47	47.833,48	44.348,27	2,07%	-125.382,57	152.575,41	125.346,09	-160.821,28
NTNB20300815 - 760199	1.869.770,93	35.150,18	32.419,31	1,51%	-101.527,82	126.776,64	103.752,47	-130.914,25
NTNB20320815 - 760199	706.207,40	14.703,24	13.414,82	0,63%	-43.790,41	57.588,27	47.571,20	-58.959,27
NTNB20350515 - 760199	327.873,14	7.533,72	6.939,66	0,32%	-24.489,99	32.284,23	27.032,16	-32.764,24
NTNB20400815 - 760199	1.661.324,61	44.417,04	39.239,55	1,83%	-139.639,67	217.519,64	172.730,33	-201.024,03
NTNB20450515 - 760199	702.258,98	21.195,91	18.257,58	0,85%	-62.189,15	114.126,75	85.195,24	-96.057,61
NTNB20500815 - 760199	2.036.307,81	64.859,17	55.815,74	2,61%	-190.931,58	364.434,03	270.434,35	-295.830,03
NTNB20550515 - 760199	1.809.192,43	61.326,11	52.630,50	2,46%	-176.345,32	361.677,29	260.421,98	-278.706,43
NTNB20600815 - 760199	447.078,88	15.515,22	13.261,23	0,62%	-44.947,99	93.306,38	66.857,72	-70.116,96
OUTRAS DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
WDOG23	-2.023.108,64	108.303,92	29.700,79	1,39%	-214.917,79	235.924,14	-287.903,43	289.514,80
WING23	-6.286.209,20	1.318.841,35	-905.816,29	-42,31%	-1.135.879,83	1.133.573,60	-887.856,06	891.144,07
Total Var:	215.888.607,52	6.293.989,04	2.140.797,78	99,97%	-3.219.314,09	3.805.105,24	4.564.447,33	-5.822.941,27



Relatório de Risco de Mercado



FUNDO: FIM EMB VI A CRED PRIV **Data:** 30/12/2022
CNPJ: 4183766000109

Dados Gerais								
PL:	171.806.144,70	VAR / PL:	1.4450%	Limite Fundo:	ENQUADRADO	Duration DC:		970,59
VAR:	2.482.662,80	ETL / PL:	1.8121%	Status:		Duration DU:		666,30
ETL:	3.113.359,31	VAR / CDI:	0,0162%	Benchmark:				

Cenários de STRESS								
Cenário Alta - 09999 (+):	1.535.141,87	Cenário Baixa - 10000 (-):	5.349.041,24	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	28.156.697,31	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	5.006.525,16	
Cenário Alta - 09999 (-):	(5.021.373,43)	Cenário Baixa - 10000 (+):	(1.381.376,64)	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	(5.019.519,68)	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(28.993.100,08)	
Cenário Alta - 09999:	(3.486.231,56)	Cenário Baixa - 10000:	3.967.664,60	CENÁRIO BRADESCO 1:	23.137.177,63	CENÁRIO BRADESCO 2:	(23.986.574,92)	

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

Produto	MM	VAR Tcd	Comp VAR	Comp VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
AEGPA1	1.959.860,30	4.625,35	3.209,89	0,13%	-2.715,51	7.341,76	12.977,57	-17.231,40
ALSCA0	1.573.823,91	652,03	-402,12	-0,02%	1.844,56	-1.514,36	-3.409,81	5.137,68
AMBP13	2.738.970,22	3.328,27	2.310,64	0,09%	-6.063,15	4.981,58	9.080,77	-12.579,48
APRB28	1.308.138,30	417,54	289,84	0,01%	-757,45	619,63	1.141,42	-1.594,22
BCBF15	2.594.370,69	911,38	626,76	0,03%	-1.695,04	1.376,55	2.747,49	-3.997,00
BKR18	1.462.066,43	177,86	116,33	0,00%	-364,91	296,72	636,66	-931,82
BRELETRO	3.679.090,82	65.382,21	14.131,11	0,57%	0,00	0,00	0,00	0,00
BRKPA0	2.439.793,61	3.671,27	2.554,66	0,10%	-6.647,69	5.477,86	9.897,53	-13.665,87
CAIXA	10.001,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CART13	876.615,82	20.109,75	18.956,93	0,76%	-57.765,36	51.163,85	49.396,11	-61.810,43
CBANZ2	4.954.321,24	18.695,94	10.163,31	0,41%	-48.372,11	47.422,77	75.876,18	-79.317,13
CCPRA3	42.434,31	1,43	0,87	0,00%	4,55	3,90	9,30	-14,16
CEAB11	1.705.216,45	430,05	292,21	0,01%	-829,77	671,83	1.375,89	-1.996,81
CEAB22	547.362,65	716,05	497,52	0,02%	-1.308,45	1.080,86	1.961,06	-2.699,92
COMPROMISSADA_PRE	34.785.387,22	0,00	0,00	0,00%	-968,25	987,35	4.519,23	-6.878,14
CONTAS A PAGAR RECEBER	13.105,95	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CSAN23	1.162.847,16	3.420,99	2.381,92	0,10%	-6.692,83	5.767,09	10.093,17	-12.910,44
CSMGA7	2.105.657,26	2.448,30	1.698,61	0,07%	-4.890,26	3.842,08	6.823,11	-9.151,71
DAPK23	-12.588,11	356.054,37	212.175,35	8,55%	146.648,26	93.161,66	6.046.711,41	-6.095.718,80
DAPK25	-8.104,93	444.598,03	439.208,55	17,69%	-475.888,27	579.269,53	4.432.046,61	-4.452.931,65
DAPK27	-628,18	38.215,71	36.765,91	1,46%	-76.912,90	60.105,20	382.453,76	-381.895,57
DAPK35	148,86	15.707,17	-13.960,75	-0,56%	52.591,02	-53.118,02	-131.055,46	124.889,67
DAPQ24	-17.816,03	763.889,85	753.154,65	30,34%	-672.603,06	956.497,67	9.350.357,67	-9.409.436,40
DAPQ26	-8.868,98	531.032,39	517.829,62	20,86%	-882.235,42	964.650,66	5.220.974,08	-5.224.242,66
DAPQ28	5.987,31	335.827,17	-316.017,23	-12,73%	814.946,71	-820.178,21	-3.324.100,16	3.298.449,16
DAPQ30	2.025,84	153.485,37	-145.850,14	-5,87%	443.016,68	-443.900,82	-1.449.236,40	1.424.235,96
DASAA2	2.646.221,09	188,22	123,39	0,00%	317,56	-388,66	695,11	-1.003,33
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DHF25	1.307,99	40.119,67	28.516,04	1,15%	-65.565,83	52.567,27	94.155,09	-132.741,38
DHF27	-1.252,07	25.906,69	-17.866,20	-0,72%	49.545,35	-42.192,51	-27.284,85	94.489,64
DIWZ5	7.419,96	30.914,99	21.739,59	0,88%	-53.071,00	43.312,31	75.784,49	-104.937,49
ELEK27	55.059,15	51,71	-29,98	0,00%	316,23	-293,95	-791,02	1.206,05
ERDVA0	2.194.012,76	0,51	0,19	0,00%	-9,75	9,93	43,81	-66,59
ETEM13	2.112.428,83	65,86	39,77	0,00%	-213,83	183,30	454,29	-675,54
GBSP11	2.434.995,27	71.681,95	65.591,43	2,64%	-222.364,66	211.037,92	205.246,21	-243.257,60
GOSH12	2.463.322,09	1.361,57	938,77	0,04%	-2.498,72	2.027,14	3.961,46	-5.673,28
GUARI5	2.694.138,10	2.746,59	1.988,25	0,08%	-4.943,17	4.041,57	7.933,38	-10.467,65
HARG11	3.265.257,84	78.598,65	73.723,01	2,97%	-230.851,41	206.181,75	200.819,49	-247.845,97
HZTC14	2.240.001,83	50.520,27	47.552,52	1,92%	-143.585,47	127.063,35	122.543,46	-153.301,36
IGTA37	2.164.666,15	3.668,91	-2.572,06	-0,10%	5.949,66	-4.680,14	-8.667,24	12.603,66
INSSSN1	1.964.322,02	20.860,30	-5.749,97	-0,27%	0,00	0,00	0,00	0,00
ISM165	3.002.302,79	65.272,23	61.528,41	2,48%	-186.511,97	165.303,36	167.525,73	-199.134,83
LCAMA0	2.022.460,40	1.095,78	755,75	0,03%	-1.977,35	1.591,88	3.072,73	-4.397,14
LCAMD1	4.619.145,72	102.286,52	96.168,91	3,87%	-295.030,42	262.320,96	250.140,25	-315.907,88
LF0021003Q1	2.101.902,44	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0021001F	1.148.067,25	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0022000B	2.135.423,44	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFSC190054B	796.866,85	0,00	0,00	0,00%	4.133,47	-3.161,00	-6.042,78	9.285,54
LFSC190095S	1.206.996,98	0,00	0,00	0,00%	6.280,56	-4.802,55	-9.176,05	14.100,59
LFSC190051L	798.505,34	0,00	0,00	0,00%	4.219,93	-3.225,87	-6.147,30	9.447,55
LFSC22002X	4.796.931,05	8.299,15	5.767,13	0,23%	-15.176,32	12.523,83	22.506,42	-30.942,26
LFSA21002N	3.470.779,59	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20240901 - 210100	1.059.661,56	238,91	201,25	0,01%	-5.162,97	7.135,05	26,15	-38,81
LIGHB4	2.108.959,12	107,34	66,56	0,00%	-309,49	262,88	622,42	-922,71
LIGHD3	1.663.464,00	2.909,31	2.018,81	0,08%	-5.421,77	4.538,12	8.055,09	-10.851,73
LRENB1	1.432.569,10	186,10	125,16	0,01%	-373,84	303,77	644,25	-939,81
MOVZ27	1.209.266,59	3.358,29	2.327,72	0,09%	-6.335,41	5.339,76	9.437,38	-12.565,84
MTR119	3.241.661,60	63.412,60	61.116,82	2,46%	-163.091,31	141.048,58	132.778,03	-169.705,25
MULP16	3.143.672,04	3.374,54	-2.312,41	-0,09%	5.649,45	-4.409,21	-8.608,62	12.679,67
NTEM11	3.297.249,32	63.351,89	61.491,81	2,48%	-151.970,21	128.583,29	120.894,98	-155.866,09
NTNB20230515 - 760199	84.559,00	551,64	323,82	0,01%	-459,52	442,11	265,41	-358,85
NTNB20230815 - 760199	101.303,84	1.317,16	1.300,83	0,05%	-1.882,91	2.028,45	1.496,13	-1.391,07
NTNB20250515 - 760199	561.588,16	8.817,26	8.727,68	0,35%	-14.133,52	13.837,43	11.334,19	-15.010,09
NTNB20260815 - 760199	1.465.039,01	23.862,78	23.294,59	0,94%	-49.244,38	52.905,46	43.515,11	-56.902,82
NTNB20270515 - 760199	656.777,14	10.745,31	10.294,74	0,41%	-24.489,20	29.082,91	23.219,31	-30.155,60
NTNB20280815 - 760199	4.595.020,08	76.723,01	71.689,67	2,89%	-201.108,67	244.724,92	201.050,16	-257.950,96
NTSD35	1.905.302,40	6.079,52	4.192,98	0,17%	-12.043,72	10.664,85	18.892,14	-23.833,82
OWDE13	4.045.709,91	6.862,40	4.065,91	0,16%	-10.986,94	9.215,42	16.404,04	-22.041,67
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
OVSA10	1.509.034,79	1.198,24	831,62	0,03%	-2.134,34	1.725,54	3.243,37	-4.598,40
PASN12	2.161.321,01	34.409,48	33.581,12	1,35%	-80.575,97	66.135,98	62.155,69	-80.336,08
RAHD11	3.099.667,20	80.248,27	74.901,08	3,02%	-238.244,65	215.890,73	210.518,42	-256.775,30
RBCAPZ2	716.153,31	3.191,02	-362,30	-0,01%	0,00	0,00	0,00	0,00
RDCO10	2.177.656,70	1.832,91	1.270,71	0,05%	-3.301,60	2.683,44	5.016,65	-7.073,54
RDRB9	1.150.919,12	3.247,83	2.242,36	0,09%	-6.355,32	5.476,81	9.586,34	-12.259,24
RLOG11	1.582.283,08	436,06	298,85	0,01%	-822,48	665,84	1.351,15	-1.952,86
RSAN24	1.090.861,90	315,54	217,34	0,01%	-582,43	471,90	925,91	-1.326,87
RSAN44	802.224,65	15.814,89	15.300,09	0,52%	-38.798,05	33.178,64	31.230,90	-40.157,09
SBFC11	1.658.729,24	136,73	87,52	0,00%	-333,16	270,24	589,71	-968,44
NGO18	2.489.922,64	719,99	493,07	0,02%	-1.356,74	1.098,99	2.200,51	-3.173,27
UGEL11	880.519,42	733,59	509,73	0,02%	-1.324,05	1.082,40	2.011,13	-2.819,53
UNEG11	4.907.539,60	136.887,02	125.993,45	5,07%	-425.631,12	388.769,21	382.221,24	-462.757,23
VAMQ33	1.360.948,92	30.237,86	28.483,40	1,15%	-86.373,46	76.990,73	73.852,87	-92.444,54
VCCS11	1.301.467,38	3.144,74	2.175,54	0,09%	-6.015,29	5.111,11	8.969,59	-11.783,21
VECS11	1.077.876,55	553,14	381,59	0,02%	-992,92	796,98	1.553,69	-2.233,14
VERDECS2	405.364,69	62.395,37	27.232,03	1,10%	0,00	0,00	0,00	0,00
VIXL14	2.126.421,17	1.003,06	691,95	0,03%	-1.852,78	1.504,51	2.944,63	-4.214,49
VYCO15	1.813.099,91	1.662,42	1.156,75	0,05%	-2.997,75	2.462,02	4.456,98	-6.170,02
VVEO16	1.076.497,86	1.447,74	794,22	0,03%	-2.074,43	1.712,75	3.068,55	-4.251,04
Total Var:	179.401.611,14	3.921.855,89	2.482.662,80	100,01%	-3.486.231,56	3.967.664,61	23.137.177,63	-23.986.574,91



Relatório de Risco de Mercado

Data: 30/12/2022

FUNDO: FIM EMB VII A CRED PRIV
CNPJ: 41687175000104

Dados Gerais					
PL:	325.324.107,78	VAR / PL:	2.5538%	Limite Fundo:	ENQUADRADO
VAR:	8.307.973,44	ETL / PL:	3.2025%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	10.418.533,86	VAR / CDI:	0.0287%	Benchmark:	
				Dutacion DC:	2.212,31
				Dutacion DU:	1.520,52

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (-):	20.498.411,12	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	19.740.393,12
Cenário Alta - 09999 (-):	(23.076.957,69)	Cenário Baixa - 10000 (+):	-	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	-
Cenário Alta - 09999:	(23.076.957,69)	Cenário Baixa - 10000:	20.498.411,12	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	19.740.393,12
				CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(24.581.133,58)
				CENÁRIO BRADESCO 2:	(24.581.133,58)

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

Produto	MM	VAR TOL	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
ANEM11	11.582.080,64	271.524,27	271.523,26	3,2%	-803.452,48	720.064,83	702.415,76	-860.088,25
ANET11	2.433.816,83	37.297,12	36.768,09	0,44%	-42.375,10	66.051,44	61.662,08	-80.295,68
BRKP28	12.093.643,67	304.657,66	303.600,30	3,65%	-938.411,91	842.332,48	823.517,98	-1.020.034,63
BRST11	6.320.441,69	116.215,21	114.521,66	1,38%	-244.371,46	199.632,49	185.941,53	-242.713,39
BTOW15	7.575.377,01	171.864,65	171.741,55	2,07%	-497.257,23	449.719,47	423.139,24	-533.776,80
CACC21	8.156.794,73	157.594,02	156.959,47	1,89%	-391.806,19	331.730,89	313.426,20	-404.522,33
CAIXA	1.000,16	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CART13	5.157.233,35	118.307,98	118.253,94	1,42%	-339.840,37	301.002,92	290.614,87	-363.637,98
CBAN32	9.177.703,77	207.268,31	207.088,32	2,49%	-606.686,36	536.416,36	518.943,61	-650.345,21
CBAN72	6.258.808,00	145.029,01	144.846,28	1,74%	-429.744,07	381.360,38	369.672,94	-462.204,18
CJENS13	4.286.413,96	97.698,09	97.664,76	1,16%	-277.926,21	245.852,61	237.418,20	-296.739,88
CNDR11	9.176.866,92	224.313,09	223.993,42	2,70%	-665.110,99	594.471,67	576.086,76	-717.331,80
COMPROMISSADA_PRE	423.255,61	0,00	0,00	0,00%	-11,78	12,01	54,99	-83,69
CONTAS A PAGAR_RECEBER	-171.562,15	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CONX12	9.353.962,32	178.671,94	177.970,30	2,14%	-443.959,86	373.111,76	353.860,67	-456.424,30
CREDZMZ4	2.114.571,93	175.501,54	175.062,20	0,98%	0,00	0,00	0,00	0,00
CRMG15	4.430.452,17	83.656,39	83.354,05	1,00%	-209.999,60	179.010,01	168.575,62	-216.067,94
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
EGIEA0	7.294.549,48	233.463,09	231.624,81	2,79%	-718.174,92	713.312,63	683.279,03	-795.441,01
ENGIAS	5.760.628,88	129.481,49	129.371,43	1,56%	-375.531,54	334.758,60	319.405,91	-402.987,22
ERDV17	3.575.058,03	53.561,29	53.392,54	0,61%	-88.059,17	65.828,91	58.595,03	-77.853,44
ERDV38	5.485.341,77	98.170,59	94.809,32	1,14%	-175.253,38	132.968,70	124.361,83	-163.969,03
GASP19	2.852.463,31	63.923,25	63.863,24	0,77%	-185.482,01	165.497,75	157.743,14	-199.159,06
GSP11	7.475.613,22	220.068,80	218.623,94	2,63%	-682.675,72	647.901,82	630.120,85	-746.818,57
GRRB24	14.352.579,37	288.322,40	287.450,10	3,48%	-751.225,30	646.911,66	612.903,29	-788.228,91
HARG11	3.878.012,21	93.348,38	93.231,60	1,12%	-274.172,71	244.873,57	238.505,04	-294.356,45
HBSA21	4.256.128,58	95.722,31	95.640,13	1,15%	-277.706,02	247.577,42	236.229,27	-298.035,73
IPIL11	8.316.092,79	176.519,89	176.396,18	2,12%	-477.596,58	417.820,62	400.173,61	-503.648,73
IRBR12	10.511.793,66	196.821,43	193.045,29	2,32%	-392.381,11	315.641,99	293.218,92	-384.282,34
ITPO14	12.189.788,37	333.990,07	332.662,73	4,00%	-1.026.203,98	928.210,57	907.546,42	-1.117.715,05
LAMEA6	7.885.457,32	174.381,25	174.269,61	2,10%	-500.002,74	449.166,28	424.330,98	-536.212,12
LCAMD1	4.557.942,04	100.931,22	100.857,76	1,21%	-291.121,27	258.945,21	246.825,89	-311.722,10
LIGHD7	5.463.352,81	103.050,62	100.843,17	1,21%	-200.915,85	159.854,24	148.924,63	-195.432,35
LORTA7	5.748.070,24	129.259,04	129.138,50	1,55%	-375.707,77	335.258,12	319.174,09	-402.964,25
LTTE15	3.461.646,79	83.020,43	82.939,57	1,00%	-241.975,18	217.876,91	211.201,99	-260.113,79
MGGP12	6.010.466,75	144.081,08	143.870,90	1,73%	-426.911,14	382.795,51	373.561,15	-458.062,12
MOVIST	7.929.777,03	173.078,77	172.979,66	2,08%	-495.571,88	439.526,06	418.905,12	-529.444,04
MTRJ19	9.563.385,13	187.076,63	186.591,36	2,25%	-481.143,68	416.114,34	391.714,98	-500.655,79
MVLV16	6.365.945,26	135.675,04	135.052,74	1,63%	-376.904,66	316.985,92	308.383,07	-395.826,61
NTE11	6.380.906,46	122.599,92	121.924,06	1,47%	-294.095,95	248.837,10	233.958,51	-301.635,34
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PASN12	7.609.738,50	121.151,43	119.956,16	1,44%	-283.697,80	232.856,43	218.842,33	-282.853,18
PEJA11	10.556.015,04	223.215,47	223.099,97	2,69%	-622.648,77	547.911,88	523.068,05	-662.722,37
QUAT12	4.409.027,20	81.237,90	78.586,04	0,95%	-144.102,34	103.930,29	103.288,35	-136.197,03
RAHD11	11.494.750,24	297.591,24	296.969,84	3,57%	-883.502,19	800.605,31	780.862,72	-952.220,91
RDVE11	3.645.515,90	93.559,68	93.440,78	1,12%	-272.229,79	243.461,30	237.008,84	-293.191,71
RMSA12	5.603.995,00	162.970,78	161.328,73	2,18%	-381.172,09	545.149,96	535.538,01	-638.555,79
RSAN44	5.141.443,39	101.610,64	101.211,45	1,22%	-249.277,46	213.172,74	200.979,80	-258.009,32
TCN11	10.864.998,53	298.733,04	297.869,45	3,59%	-893.033,18	816.361,88	797.373,90	-965.632,76
TNHL11	6.534.118,77	174.916,30	174.534,49	2,10%	-514.649,04	468.722,32	456.857,33	-554.903,43
UHSM12	8.139.751,70	229.327,34	227.913,12	2,74%	-723.577,07	658.354,54	649.415,47	-789.621,44
UNSG11	1.736.272,02	48.430,20	48.196,07	0,59%	-150.586,95	137.545,32	135.228,67	-163.722,05
UTPS11	3.808.380,96	62.131,14	61.186,72	0,74%	-134.244,30	109.133,27	101.123,07	-131.908,78
UTPS21	3.999.699,91	100.291,22	100.024,28	1,20%	-304.645,62	274.065,47	267.242,82	-329.745,98
UTPS22	9.499.102,35	245.013,22	244.169,23	2,94%	-752.489,87	679.083,93	663.280,43	-816.823,27
VAMO33	5.766.732,72	128.126,53	128.041,07	1,54%	-365.989,23	325.384,43	309.546,06	-391.714,13
VAMO34	6.538.225,63	143.971,89	143.885,71	1,73%	-413.093,22	367.040,73	349.882,24	-441.929,15
VERDEC2	714.342,67	109.954,51	25.851,82	0,31%	0,00	0,00	0,00	0,00
VMT13	6.533.658,10	154.983,93	154.826,40	1,86%	-455.863,16	406.541,14	394.927,43	-489.405,03
VRDN12	4.480.808,88	102.210,47	102.166,77	1,23%	-292.389,37	258.843,54	249.714,39	-312.842,15
Total Var:	364.761.846,04	8.525.693,25	8.307.973,44	99,98%	-23.076.957,69	20.498.411,12	19.740.393,11	-24.581.133,59



Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIM EMB III A IMOBILIÁRIO
CNPJ: 32711990000162

Dados Gerais					
PL:	93.153.114,54	VAR / PL:	5,0797%	Limite Fundo:	-
VAR:	4.731.929,71	ETL / PL:	6,3702%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	5.934.030,76	VAR / CDI:	0,0571%	Benchmark:	-
				Duration DC:	3,00
				Duration DU:	1,00

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	45.948.173,46	Cenário Baixa - 10000 (+):	5,11	CENARIO BRADESCO 1 (+):	12.001.552,20
Cenário Alta - 09999 (-):	(5,02)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(45.948.176,88)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-
Cenário Alta - 09999:	45.948.168,44	Cenário Baixa - 10000:	(45.948.171,76)	CENARIO BRADESCO 2 (+):	(12.099.803,40)
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	(12.099.803,40)

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
AIEC11	3.808.568,55	178.099,34	144.210,62	3,05%	1.904.284,28	-1.904.284,28	558.336,15	-562.906,43
BMLC11	2.863.471,24	181.509,13	96.862,12	2,04%	2.863.471,24	-2.863.471,24	419.784,88	-423.221,05
BPM11	1.004.648,09	101.475,36	71.630,83	1,51%	1.004.648,09	-1.004.648,09	147.281,41	-148.686,99
BTLG11	3.838.492,80	130.180,67	96.223,73	2,03%	1.919.246,40	-1.919.246,40	562.723,04	-567.329,24
CAIXA	999,82	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CEOC11	774.004,80	50.271,05	40.078,01	0,85%	387.002,40	-387.002,40	113.469,10	-114.397,91
CNES11	498.247,20	40.784,01	-27.351,84	-0,58%	249.122,06	-249.123,60	73.043,04	-73.640,94
COMPROMISSADA_PRE	180.184,52	0,00	0,00	0,00%	-5,02	5,11	23,41	-35,63
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-160.610,92	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
FVPQ11	1.158.850,00	106.482,41	86.258,02	1,82%	579.425,00	-579.425,00	169.987,41	-171.278,03
GALG11	2.892.770,30	54.346,56	22.375,00	0,47%	1.346.385,15	-1.346.385,15	394.760,13	-397.991,45
GTLG11	214.000,00	5.315,85	-1.265,09	-0,03%	214.000,00	-214.000,00	31.372,40	-31.628,20
HBRH11	2.482.445,31	299.776,36	208.195,00	4,40%	2.482.445,31	-2.482.445,31	363.926,48	-366.905,42
HSLG11	3.286.267,42	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
HSM11	8.800.500,72	770.156,34	684.362,96	14,46%	4.400.250,36	-4.400.250,36	1.290.153,41	-1.300.714,01
IMALL11	3.526.141,50	175.463,13	136.252,49	2,88%	1.763.070,75	-1.763.070,75	316.932,34	-321.163,71
MAXR11	1.308.722,35	112.763,31	66.365,67	1,40%	654.359,29	-654.361,18	191.858,70	-193.429,16
NEWU11	913.087,50	48.339,58	41.699,31	0,88%	456.543,75	-456.543,75	133.858,63	-134.954,33
NEWU11	500.856,00	46.356,64	24.348,19	0,51%	500.856,00	-500.856,00	73.425,49	-74.026,52
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PATC11	9.799.412,00	740.762,91	594.901,77	12,36%	4.899.706,00	-4.899.706,00	1.436.593,80	-1.448.353,09
QAGR11	7.722.653,40	534.722,70	443.398,42	9,37%	3.861.326,70	-3.861.326,70	1.132.140,99	-1.141.408,17
RBRL11	2.965.116,00	133.958,22	72.735,93	1,54%	2.965.116,00	-2.965.116,00	434.686,01	-438.244,15
RCRB11	5.473.942,73	510.056,35	460.699,58	9,74%	0,00	0,00	0,00	0,00
RNO11	129.329,42	8.804,57	-394,14	-0,01%	64.664,71	-64.664,71	18.959,69	-19.114,89
TEPP11	7.935.123,17	843.646,29	753.818,61	15,93%	3.967.561,59	-3.967.561,59	1.163.289,06	-1.172.811,21
TRXF11	13.022.617,20	431.261,55	328.282,65	6,94%	6.511.308,60	-6.511.308,60	1.909.115,68	-1.924.742,82
TRXF13	3.218.326,05	110.770,02	73.756,77	1,58%	0,00	0,00	0,00	0,00
XPM11	3.189.983,66	254.276,78	195.168,07	4,12%	1.594.991,83	-1.594.991,83	467.651,61	-471.479,59
XPRR11	2.716.775,90	212.185,48	129.517,04	2,74%	1.358.387,95	-1.358.387,95	398.279,35	-401.539,48
Total Var:	93.864.926,73	6.090.264,60	4.731.929,71	99,98%	45.948.168,44	-45.948.171,76	12.001.552,20	-12.099.803,40



Relatório de Risco de Mercado

Data: 30/12/2022

FUNDO: FIA RVA EMB II
CNPJ: 13294268000125

Dados Gerais					
PL:	233.217.905,99	VAR / PL:	8,1625%	Limite Fundo:	-
VAR:	19.036.368,53	ETL / PL:	10,2361%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	23.872.374,14	VAR / CDI:	0,0918%	Benchmark:	-
				Dutacion DC:	3,00
				Dutacion DU:	1,00

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	57.934.656,61	Cenário Baixa - 10000 (-):	204,77	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	32.751.355,04
Cenário Alta - 09999 (-):	(200,81)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(56.943.147,25)	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(33.015.690,49)
Cenário Alta - 09999:	57.934.455,80	Cenário Baixa - 10000:	(56.942.942,48)	CENÁRIO BRADESCO 1:	32.751.355,04
				CENÁRIO BRADESCO 2:	(33.015.690,49)

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
ABEV3	7.596.936,60	473.393,12	149.371,40	0,78%	1.063.571,12	-1.405.485,59	1.113.710,91	-1.122.827,23
AMER3	890.202,85	236.653,31	240.734,55	1,26%	320.473,03	-240.354,77	130.503,74	-131.571,98
ARZZ3	2.324.025,00	346.192,16	295.116,51	1,55%	697.207,50	-697.207,50	340.702,07	-343.600,90
B3SA3	10.423.073,09	2.029.785,40	1.493.294,30	7,84%	2.605.768,27	-2.605.768,27	1.528.022,52	-1.540.530,20
BBAS3	5.786.018,00	584.792,56	291.832,66	1,53%	1.446.504,50	-1.446.504,50	848.230,24	-855.173,46
BBDC4	9.939.612,00	1.636.988,38	948.979,16	4,99%	2.484.903,00	-1.987.922,40	1.457.147,12	-1.469.074,65
BEEF3	1.136.592,00	175.620,04	165.104,17	0,54%	284.146,00	-284.146,00	166.624,39	-167.988,30
BPAC11	3.392.722,00	509.690,33	480.707,16	2,53%	1.014.916,60	-1.183.952,70	495.907,05	-499.966,31
CAIXA	10.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CIEL3	2.824.360,00	559.975,84	358.908,66	1,89%	847.308,00	-706.090,00	414.051,18	-417.440,41
COMPROMISSADA_PRE	7.214.179,50	0,00	0,00	0,00%	-200,81	204,77	937,25	-1.426,46
CONTAS A PAGAR_RECEBER	9.031.773,13	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPFE3	3.924.200,00	279.548,07	192.874,19	1,01%	786.840,00	-706.840,00	576.753,72	-581.474,76
CSAN3	1.001.024,00	184.492,58	-1.347,25	-0,01%	450.256,00	-450.256,00	264.030,12	-266.191,35
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ELET3	5.514.434,64	614.456,25	419.640,43	2,20%	1.654.330,39	-1.654.343,48	808.416,12	-815.033,44
ELET6	3.371.940,00	487.698,07	334.347,21	1,76%	1.011.582,00	-1.011.582,00	494.326,40	-498.372,73
EN011	2.329.867,00	256.601,06	210.848,43	1,11%	396.072,12	-512.570,74	341.558,50	-344.354,34
EQTLL3	2.756.040,00	342.636,81	296.049,64	1,56%	551.208,00	-551.208,00	404.035,46	-407.342,71
GGBR4	3.392.235,00	462.976,03	2.300,99	0,01%	848.058,75	-848.058,75	497.301,65	-501.372,33
GMAT3	4.504.896,00	885.720,14	680.347,70	3,57%	810.881,28	-720.783,36	660.417,75	-665.823,63
HAPV3	4.271.711,04	1.153.303,83	875.322,03	4,60%	1.025.210,65	-1.025.210,65	626.232,84	-631.358,89
HYFE3	3.683.800,00	449.879,35	418.135,56	2,20%	847.274,00	-773.598,00	540.045,08	-544.665,64
INDO23	6.666.180,00	1.403.022,71	1.029.761,69	5,41%	1.208.382,79	-1.205.929,37	944.527,72	-948.025,60
INTB3	2.375.100,00	429.614,47	393.432,82	2,07%	1.210.950,00	-821.145,00	348.189,66	-351.039,78
ITSA4	4.571.929,42	477.097,57	456.287,13	2,40%	868.612,87	-868.666,59	670.244,85	-675.731,17
ITUB4	16.698.425,00	2.115.045,24	1.977.571,09	10,38%	3.339.885,00	-3.172.700,75	2.447.989,11	-2.468.027,22
JBS33	3.925.215,00	469.167,10	222.123,94	1,17%	1.373.825,25	-1.373.825,25	575.436,52	-580.146,78
LENS3	4.486.144,00	916.802,29	814.471,21	4,28%	897.228,80	-897.228,80	657.668,71	-663.052,08
LWSA3	1.073.358,00	216.991,47	155.584,40	0,82%	429.343,20	-429.343,20	157.354,28	-158.642,31
MULT3	2.170.290,00	253.017,31	216.252,61	1,14%	651.087,00	-542.572,50	318.164,51	-320.768,86
OUTRAS DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PETR3	6.695.952,00	1.215.290,69	766.855,18	4,03%	1.673.968,00	-2.008.909,48	981.626,56	-989.661,71
PETRA	11.019.095,50	2.229.541,02	1.342.353,74	7,05%	2.754.773,88	-3.305.728,65	1.615.399,40	-1.628.622,32
PRIO3	5.934.995,00	941.749,20	757.352,17	3,98%	3.560.997,00	-3.560.997,00	870.070,27	-877.192,26
RADL3	4.577.960,00	477.941,31	367.541,12	1,93%	915.592,00	-915.592,00	671.128,94	-676.622,49
RENT1	4.992,64	5.382,62	843,12	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
RENT3	5.655.160,00	1.136.277,54	1.044.567,15	5,49%	1.866.202,80	-1.470.341,00	629.046,48	-635.832,85
RRRF3	1.955.450,00	562.973,29	521.293,81	2,74%	1.173.270,00	-1.173.270,00	286.668,97	-286.668,97
SBP3	3.463.896,00	474.204,48	306.264,13	1,61%	865.974,00	-865.974,00	507.807,15	-511.963,83
SOMA3	1.780.584,00	379.726,60	356.413,52	1,87%	534.175,20	-534.175,20	261.033,61	-263.170,32
STBP3	2.464.836,00	436.570,75	333.431,47	1,75%	862.692,60	-862.692,60	361.344,96	-364.302,76
SUZB3	5.976.936,00	1.175.348,19	962.125,38	2,95%	1.494.234,00	-1.195.387,20	876.218,82	-883.391,14
TMS3	2.892.920,00	295.833,99	177.151,01	0,93%	625.734,40	-665.371,60	424.102,07	-427.573,58
TOTS3	3.244.880,46	483.775,41	424.653,31	2,23%	648.976,09	-648.976,09	475.699,48	-479.593,33
VALE3	39.533.379,60	4.400.929,74	-1.835.880,84	-9,64%	9.883.344,90	-9.883.344,90	5.795.593,45	-5.843.033,51
WEGE3	6.596.763,00	1.127.182,04	855.271,90	4,49%	1.649.173,62	-1.649.190,75	967.085,46	-975.001,57
Total Var:	239.884.083,47	33.354.528,66	19.036.368,53	100,01%	57.934.455,81	-56.942.942,48	32.751.355,04	-33.015.690,49



Relatório de Risco de Mercado

FUNDO:	FIA RVA EMB III
CNPJ:	38452593000108

Dados Gerais					
PL:	97.922.824,55	VAR / PL:	11,3928%	Limite Fundo:	3,00
VAR:	11.156.135,91	ETL / PL:	14,2870%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	13.990.244,52	VAR / CDI:	0,1281%	Benchmark:	
				Dutacion DC:	1,00
				Dutacion DU:	

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	27.034.153,94	Cenário Baixa - 10000 (-):	1.212.572,84	CENARIO BRADESCO 1 (+):	13.741.011,54
Cenário Alta - 09999 (-):	(1.103.612,71)	Cenário Baixa - 10000 (+):	(26.704.504,30)	CENARIO BRADESCO 2 (+):	1.486.101,35
Cenário Alta - 09999:	25.930.541,23	Cenário Baixa - 10000:	(25.491.931,46)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(1.477.737,58)
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	(13.853.772,74)
				CENARIO BRADESCO 2:	(12.367.671,39)

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
AL303	2.354.184,00	417.218,25	394.974,24	3,45%	706.255,20	-588.546,00	345.123,37	-347.948,40
AURE3	6.301.390,89	564.909,15	59.258,89	0,53%	1.575.347,72	-1.953.473,96	923.783,90	-931.345,57
BBAS3	1.924.042,00	194.462,83	66.455,11	0,60%	481.010,50	-481.010,50	282.064,56	-284.373,41
BBDC4	860.520,00	141.721,95	74.406,82	0,67%	215.130,00	-172.104,00	126.152,23	-127.184,86
BPAC11	4.309.200,00	649.172,39	624.825,08	5,60%	1.292.760,00	-1.508.220,00	631.728,72	-636.899,76
BRML3	2.500.931,10	362.678,33	348.353,32	3,12%	675.325,89	-625.232,78	366.636,50	-369.637,62
CAIXA	998,51	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CLSA3	163.270,00	27.404,71	19.011,73	0,17%	81.635,00	-81.635,00	23.935,38	-24.131,31
COMPROMISSADA_PRE	4.249.019,49	0,00	0,00	0,00%	-118,27	120,60	552,02	-840,16
CONTAS A PAGAR_RECEBER	-60.527,71	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
DOLF23	-260.884,98	0,00	0,00	0,00%	-28.905,48	32.831,54	-38.220,46	38.527,34
DOLG23	-10.115.543,21	541.519,62	10.669,31	0,10%	-1.074.588,96	1.179.620,69	-1.439.517,12	1.447.574,00
ELET3	5.348.060,64	595.917,71	473.418,26	4,24%	1.604.418,19	-1.604.430,89	784.025,69	-790.443,36
ENEV3	5.473.030,66	371.442,76	229.457,80	2,06%	2.025.021,34	-2.791.245,64	802.346,30	-808.913,93
ENJUS	170.914,00	24.777,44	17.810,51	0,16%	76.893,68	-48.164,40	25.055,99	-25.261,09
EQTLL3	8.596.980,42	1.068.795,06	987.704,61	8,85%	1.719.396,08	-1.719.396,08	1.260.317,33	-1.270.633,71
EUCA4	144.837,00	28.930,65	12.965,28	0,12%	115.869,60	-115.871,31	21.233,10	-21.406,91
HAPV3	1.647.952,00	444.924,60	348.279,25	3,12%	395.508,48	-395.508,48	241.589,76	-243.567,31
IGT11	4.947.029,50	605.304,03	453.291,45	4,06%	989.405,90	-989.405,90	725.234,53	-731.170,96
ITUB4	5.190.000,00	657.372,46	612.455,98	5,49%	1.038.000,00	-986.100,00	760.854,00	-767.862,00
IREN3	3.996.180,48	816.671,93	764.339,24	6,85%	799.236,10	-799.236,10	585.840,06	-590.635,48
LWSA3	249.210,00	50.380,62	34.096,57	0,31%	99.684,00	-99.684,00	36.534,19	-36.833,24
NINJ3	295.836,00	57.586,15	5.502,55	0,05%	177.501,60	-177.501,60	43.869,56	-43.724,56
NTCO3	1.390.007,25	198.591,38	119.260,11	1,07%	347.501,81	-278.001,45	203.775,06	-205.443,07
ONCO3	976.257,00	248.602,42	173.831,60	1,56%	341.689,95	-341.689,95	143.119,28	-144.290,79
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PETRA	580.650,00	117.485,41	46.866,31	0,42%	145.162,50	-174.195,00	85.123,29	-85.820,07
PETZ3	3.100.578,00	434.631,91	323.771,57	2,90%	775.144,50	-775.144,50	454.544,74	-458.265,43
PRIO3	1.402.817,00	222.595,27	195.585,95	1,75%	841.690,20	-841.690,20	205.652,97	-207.336,35
RBOR3	1.957.012,80	273.281,93	147.693,41	1,32%	587.103,84	-587.103,84	286.898,08	-289.246,49
RECV3	3.633.764,66	701.916,15	597.632,62	5,36%	2.180.258,80	-2.180.258,80	532.709,90	-537.070,42
RENT1	5.778,12	6.229,45	1.354,23	0,01%	0,00	0,00	0,00	0,00
RENT3	6.765.284,40	1.359.332,13	1.319.706,67	11,83%	2.232.543,85	-1.758.973,94	991.790,69	-999.909,03
SOMA3	3.263.183,82	695.905,22	682.451,71	6,12%	978.955,15	-978.955,15	478.382,75	-482.298,57
SUZB3	8.556.818,24	1.682.635,68	925.458,67	8,30%	2.139.154,56	-1.711.323,65	1.254.400,23	-1.264.868,18
TEND3	354.460,00	65.519,36	27.334,09	0,25%	124.068,00	-124.068,00	51.966,77	-52.392,14
VBR3	5.457.987,80	695.957,51	644.485,99	5,78%	1.364.496,95	-1.364.496,95	800.141,01	-806.690,60
YDUO3	1.815.345,00	452.733,58	423.566,99	3,80%	707.984,55	-453.836,25	266.129,58	-268.307,99
Total Var:	87.546.394,87	14.795.707,96	11.156.135,91	100,02%	25.930.541,23	-25.491.931,46	12.263.273,95	-12.367.671,40



Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIA RVA EMB IV
CNPJ: 38452613000132

Dados Gerais					
PL:	90.078.382,33	VAR / PL:	10,8215%	Limite Fundo:	ENQUADRADO
VAR:	9.747.810,74	ETL / PL:	13,5706%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	12.224.147,93	VAR / CDI:	0,1217%	Benchmark:	
				Dutacion DC:	3,00
				Dutacion DU:	1,00

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	25.164.521,01	Cenário Baixa - 10000 (-):	186,86	CENARIO BRADESCO 1 (+):	12.191.060,39
Cenário Alta - 09999 (-):	(183,24)	Cenário Baixa - 10000 (+):	(23.844.748,81)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-
Cenário Alta - 09999:	25.164.337,76	Cenário Baixa - 10000:	(23.844.561,95)	CENARIO BRADESCO 1:	12.191.060,39
				CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	(12.291.290,22)
				CENARIO BRADESCO 2:	(12.291.290,22)

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
AURE3	5.396.188,20	483.759,25	73.328,73	0,75%	1.349.047,05	-1.672.854,98	791.081,19	-797.556,82
B3SA3	4.782.337,04	931.310,55	744.516,74	7,64%	1.195.584,26	-1.195.584,26	701.090,61	-706.829,42
BBDC4	1.776.943,50	292.650,85	166.786,97	1,71%	444.235,88	-355.388,70	260.499,92	-262.632,25
BPAC11	4.082.153,04	614.968,22	593.647,05	6,09%	1.224.645,91	-1.428.753,56	598.443,64	-603.342,22
BRML3	4.146.937,00	634.540,90	584.060,86	5,99%	1.491.428,06	-1.036.734,33	607.941,01	-612.917,33
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	6.583.229,03	0,00	0,00	0,00%	-183,24	186,86	855,28	-1.301,71
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	341.319,40	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
ELET3	806.134,68	89.825,07	67.842,27	0,69%	241.840,40	-241.842,32	118.179,34	-119.146,71
ELET6	132.543,18	19.170,29	14.223,76	0,15%	39.762,95	-39.762,95	19.430,83	-19.589,88
ENEV3	908.851,26	61.581,77	39.647,54	0,41%	336.274,97	-463.514,14	133.237,60	-134.328,22
EQTLL3	15.520.369,06	1.929.525,60	1.745.224,02	17,90%	3.104.073,81	-3.104.073,81	2.275.286,10	-2.293.910,55
GGPS3	4.813.295,49	553.614,00	494.268,06	5,07%	2.165.982,97	-2.165.982,97	705.629,12	-711.405,07
GMAT3	4.647.468,88	913.751,79	803.952,46	8,25%	836.544,40	-743.595,02	681.318,94	-686.895,90
HAPV3	2.791.853,04	753.706,32	624.940,58	6,41%	669.998,73	-669.996,73	409.256,34	-412.506,32
ITUB4	6.825.700,00	864.552,45	815.322,14	8,36%	1.365.140,00	-1.296.883,00	1.000.647,62	-1.008.838,46
LREN3	2.137.251,84	436.775,41	406.158,51	4,17%	427.450,37	-427.450,37	313.321,12	-315.885,82
MATD3	1.221.986,85	177.104,66	164.588,62	1,69%	366.596,06	-366.596,06	179.143,27	-180.609,66
MULT3	1.721.734,20	200.723,66	188.851,88	1,94%	516.520,26	-430.433,55	252.406,23	-254.472,32
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PRI03	6.827.030,33	1.083.294,99	929.466,80	9,54%	4.096.218,20	-4.096.218,20	1.000.842,65	-1.009.035,08
RAIL3	8.398.302,19	1.002.327,15	895.235,38	9,18%	3.779.190,86	-2.771.484,85	1.231.191,10	-1.241.269,06
UGPA3	4.327.777,22	512.406,74	173.641,08	1,78%	1.081.944,31	-865.555,44	634.452,14	-639.645,47
VBBR3	1.888.174,30	240.764,39	222.307,29	2,28%	472.043,58	-472.043,58	276.806,35	-279.072,16
Total Var:	90.078.380,03	11.796.456,03	9.747.810,74	100,00%	25.164.337,76	-23.844.561,96	12.191.060,39	-12.291.290,22



Relatório de Risco de Mercado

Data: 30/12/2022

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

Dados Gerais

PL:	111.071.398,85	VAR / PL:	7.3647%	Limite Fundo:		Duration DC:	3,96
VAR:	8.190.083,27	ETL / PL:	9.2356%	Status:	ENQUADRADO	Duration DU:	1,67
ETL:	10.258.154,44	VAR / CDI:	0.0828%	Benchmark:			

Cenários de STRESS

Cenário Alta - 09999 (+):	28.699.978,31	Cenário Baixa - 10000 (-):	881,29	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	16.182.905,32	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	-
Cenário Alta - 09999 (-):	(747,00)	Cenário Baixa - 10000 (+):	(28.359.091,55)	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	-	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(16.314.422,14)
Cenário Alta - 09999:	28.699.231,31	Cenário Baixa - 10000:	(28.358.210,26)	CENÁRIO BRADESCO 1:	16.182.905,32	CENÁRIO BRADESCO 2:	(16.314.422,14)

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MM	VAR TOL	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
AREV3	3.565.923,24	222.205,82	63.792,25	0,75%	499.229,25	-559.720,38	522.764,35	-527.043,46
ALPA4	171.067,52	28.694,21	19.936,32	0,24%	-42.766,88	-42.766,88	25.078,50	-25.283,78
AMER3	329.962,45	110.476,40	87.362,01	1,07%	118.786,48	-89.089,86	48.372,50	-48.768,45
ARZZ2	265.971,75	39.611,76	32.441,77	0,40%	79.791,53	-79.791,53	38.991,46	-39.310,63
ASAJ3	1.019.858,07	69.626,14	26.100,07	0,32%	288.242,17	-263.812,62	149.511,19	-150.735,02
AZUL4	202.000,47	41.119,89	36.576,84	0,45%	90.900,21	-90.900,21	29.813,27	-29.855,67
B3SA3	4.368.097,86	850.641,76	616.322,60	7,53%	-1.092.024,47	1.092.024,47	640.363,15	-645.604,86
BBAS3	2.762.111,63	279.166,49	151.269,98	1,85%	690.527,91	-690.527,91	404.925,57	-408.240,10
BBDC3	1.137.096,99	177.326,76	87.504,16	1,07%	284.274,25	-227.419,40	166.698,42	-168.062,94
BBDC4	4.370.229,60	719.747,92	413.953,82	5,06%	1.092.557,40	-874.045,92	640.675,66	-645.919,94
BBSB3	1.267.125,19	84.019,48	-23.707,71	-0,29%	253.425,04	-253.425,04	195.760,55	-197.281,10
BEEF3	188.762,40	29.066,90	17.234,91	0,21%	-47.190,60	-47.190,60	27.672,57	-27.890,08
BPAC11	1.642.020,66	247.367,14	230.889,49	2,82%	492.606,20	-574.707,23	240.720,23	-242.690,65
BPAN4	115.985,56	15.022,12	12.210,42	0,15%	59.120,15	-37.489,90	17.003,48	-17.142,67
BRAP4	417.239,08	40.788,27	-16.570,07	-0,20%	104.309,77	-104.309,77	61.167,25	-61.667,94
BRFS3	498.650,28	128.547,80	102.676,09	1,26%	124.512,57	-124.516,59	73.014,17	-73.611,53
BRKM5	352.550,88	80.023,87	56.219,75	0,69%	113.902,88	-105.765,26	51.683,96	-52.107,02
BRML3	384.148,90	58.780,29	48.650,45	0,59%	134.452,12	-96.037,23	56.316,23	-56.777,21
CAIXA	20.724,70	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CASH3	43.436,98	6.881,74	-1.851,29	-0,02%	17.374,79	-17.374,79	6.367,86	-6.419,99
CCOR3	663.853,38	36.410,86	19.870,11	0,24%	158.963,35	-150.963,35	88.524,91	-89.249,53
CIEL3	320.504,60	63.545,31	40.884,93	0,50%	96.151,38	-80.126,15	46.985,97	-47.370,58
CMIG4	898.775,20	61.499,52	-5.893,59	-0,07%	248.316,90	-256.401,04	131.760,44	-132.838,98
CMN3	254.114,64	38.366,27	-13.868,40	-0,17%	90.621,77	-88.130,45	37.253,21	-37.558,14
COGN3	215.911,40	53.518,75	43.280,75	0,53%	53.977,85	-75.568,99	31.652,61	-31.911,71
COMPROMISSADA PRE	569.257,20	0,00	0,00	0,00%	-15,85	15,16	73,96	-112,56
CONTAS_A PAGAR_RECEBER	1.153.083,05	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPFE3	348.699,60	24.777,16	17.072,79	0,21%	69.739,92	-69.739,92	51.119,36	-51.537,80
CPLE6	692.726,16	100.604,10	7.304,44	0,09%	152.399,76	-152.399,76	101.553,66	-102.384,93
CRFB3	437.207,18	53.238,44	35.182,99	0,43%	109.301,80	-109.301,80	64.094,57	-64.619,22
CSAN3	1.122.301,60	114.965,88	4.525,31	0,06%	286.575,40	-280.575,40	164.529,42	-165.876,18
CSNA3	490.019,05	60.534,25	-10.536,24	-0,13%	216.483,64	-131.769,25	70.370,79	-70.846,82
CVCB3	69.321,11	17.189,76	15.031,32	0,18%	34.660,56	-34.660,56	10.162,48	-10.245,66
CYRE3	200.310,82	44.111,25	35.844,97	0,44%	64.099,46	-88.090,14	29.365,57	-29.605,94
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DAXO3	104.262,84	16.197,88	10.762,44	0,13%	26.065,71	-31.280,39	15.284,93	-15.410,05
ECOR3	327.372,15	14.255,45	7.076,99	0,09%	19.243,04	-19.243,04	11.432,76	-11.435,60
EGIE3	540.850,64	33.006,85	13.682,03	0,17%	97.353,12	-97.353,12	79.288,70	-79.937,73
ELET3	4.409.458,56	491.332,21	321.594,93	3,93%	1.322.837,57	-1.322.848,04	646.426,63	-651.717,98
ELET6	666.390,45	96.382,09	62.869,09	0,77%	199.917,14	-199.917,14	97.692,84	-98.492,51
EMBR3	588.141,00	61.500,82	-10.220,29	-0,12%	147.035,25	-147.035,25	86.221,47	-86.927,24
ENBR3	296.228,82	16.638,80	13.795,64	0,17%	54.244,10	-42.905,70	41.821,83	-42.275,06
ENEV3	1.053.359,35	71.489,22	36.806,61	0,45%	389.742,96	-537.213,27	154.422,48	-155.686,51
ENGH1	614.740,05	67.704,78	54.827,54	0,67%	104.504,42	-135.242,81	90.120,89	-90.858,58
EQTL3	1.662.999,94	206.747,72	170.043,20	2,08%	332.599,99	-332.599,99	243.795,79	-245.791,39
EZTC3	70.870,11	15.273,53	12.084,34	0,19%	14.174,02	-12.261,03	10.389,56	-10.474,60
FLRY3	394.195,05	44.419,89	31.102,04	0,38%	60.939,01	-60.939,01	44.594,99	-44.980,03
GGBR4	1.796.151,72	245.140,80	2.637,40	0,03%	449.037,93	-449.037,93	263.315,84	-265.471,22
GOAUI4	483.755,06	63.403,04	-2.970,60	-0,04%	145.126,52	-120.938,77	70.918,49	-71.499,00
GOLL4	78.046,22	11.479,66	8.928,47	0,11%	46.827,73	-27.316,18	11.441,58	-11.535,23
HAPV3	1.266.418,60	341.915,78	257.620,37	3,15%	303.940,46	-303.940,46	185.656,97	-187.176,67
HYPE3	1.131.391,20	123.816,94	115.427,09	1,39%	233.192,69	-212.115,05	148.534,98	-149.851,64
IGTI11	221.865,50	27.047,63	19.721,62	0,24%	44.211,30	-44.211,30	32.406,88	-32.672,15
INDG23	1.555.442,00	327.371,97	232.220,38	2,84%	281.955,99	-281.383,52	220.389,80	-221.205,97
ITSA4	2.491.489,72	259.996,07	242.336,58	2,96%	473.353,77	-473.353,77	368.252,39	-368.242,18
TUB4	6.715.650,00	850.613,37	776.307,93	9,49%	1.343.130,00	-1.275.973,50	984.514,29	-992.573,07
URSS3	1.396.945,60	82.060,89	82.060,89	0,06%	488.265,96	-488.265,96	204.513,69	-205.167,14
ULDN11	794.201,93	129.611,34	81.030,89	0,99%	196.050,48	-156.840,39	114.960,10	-115.905,05
LFNT20230901 - 210100	441.561,72	47,40	-5,76	0,00%	-731,16	865,13	1,67	-2,54
LRN3	1.105.735,68	225.971,57	192.622,29	2,35%	221.147,14	-221.147,14	162.100,85	-163.427,73
LWSA3	164.745,36	33.305,14	23.420,73	0,29%	65.898,14	-65.898,14	24.151,67	-24.349,36
MGLU3	440.592,00	122.531,21	91.064,82	1,11%	132.177,60	-132.177,60	64.590,79	-65.119,50
MRFG3	153.981,98	46.123,37	27.805,58	0,34%	61.992,52	-46.194,39	22.733,66	-22.758,44
MRVE3	129.967,60	16.213,92	6.053,71	0,07%	38.990,28	-38.990,28	19.023,25	-19.209,21
MULT3	328.543,80	38.302,38	31.888,21	0,39%	98.563,14	-82.135,95	48.164,52	-48.558,77
NTOC3	542.988,09	77.577,12	52.000,92	0,64%	135.747,02	-108.597,62	79.802,65	-80.253,64
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PCAR3	14.838,56	20.529,97	10.585,30	0,13%	26.250,06	-23.344,17	21.379,93	-21.554,94
PETR3	5.466.902,72	992.222,76	669.926,61	8,19%	1.366.725,68	-1.640.090,31	801.447,94	-808.008,22
PETRA	6.261.685,50	1.266.953,78	815.958,00	9,97%	1.565.421,38	-1.878.505,65	917.963,09	-925.477,12
PETZ3	117.581,58	16.482,32	11.112,33	0,14%	29.395,40	-29.395,40	17.237,46	-17.378,56
PRIO3	1.748.451,35	277.122,25	214.275,74	2,62%	1.047.870,81	-1.047.870,81	256.029,77	-258.125,51
QUAL3	91.043,70	19.163,99	7.829,47	0,10%	22.760,93	-22.760,93	13.347,01	-13.456,26
RADL3	1.586.583,36	165.640,10	127.903,67	1,56%	317.316,67	-317.316,67	232.593,12	-234.497,02
RAIL3	1.266.373,28	151.140,11	127.007,51	1,55%	569.861,17	-417.909,99	185.650,32	-187.169,97
RAIZ4	251.305,56	35.288,18	24.795,35	0,30%	87.956,95	-87.956,95	36.841,40	-37.142,96
RDR3	1.993.777,20	265.764,20	142.377,17	1,74%	570.953,16	-570.953,16	279.005,78	-281.289,59
RENT1	2.230,08	2.412,90	350,86	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
RENT3	2.304.038,80	462.944,91	413.525,35	5,06%	760.332,80	-599.050,09	337.772,09	-340.536,94
RRR3	414.155,25	119.235,14	108.495,03	1,33%	248.493,15	-248.493,15	60.715,16	-61.212,15
SANB11	560.896,43	45.554,44	36.221,15	0,44%	112.179,29	-112.179,29	82.227,42	-82.900,49
SBSF3	1.087.697,64	148.904,90	91.350,79	1,12%	271.924,41	-271.924,41	159.456,47	-160.761,71
SLCE3	25.219,35	21.806,24	-676,43	-0,01%	75.783,11	-75.783,11	37.232,88	-37.358,91
SMTO3	212.690,40	26.864,52	5.502,45	0,07%	63.807,12	-63.807,12	31.180,41	-31.554,64
SOMA3	278.393,70	59.370,12	54.368,58	0,66%	83.518,11	-83.518,11	40.812,52	-41.146,59
SUZB3	1.961.583,12	385.739,98	174.008,58	2,13%	490.395,78	-392.316,62	287.568,09	-289.921,99
TAEI1	423.944,76	31.266,95	22.813,94	0,28%	105.986,19	-105.986,19	62.150,30	-62.659,04
TMS3	561.298,40	57.399,15	32.455,82	0,40%	179.615,49	-129.998,63	82.226,35	-82.959,50
TOTS3	804.857,28	120.010,13	103.207,88	1,26%	160.991,46	-160.991,46	118.006,74</	



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

31/12/2022

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING			
Fundo	DataAquisição	DataVencimento	Emissor	Financeiro	Cód.ISIN	S&P	Moody's	Fitch	Austin
FI RF EMB II	20/10/14	15/01/23	SABESP	839.018,66	BRBSBSPDBS130	brAAA	Aa2.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB II	21/10/14	15/01/23	SABESP	4.194.893,23	BRBSBSPDBS130	brAAA	Aa2.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB II	24/02/15	15/01/23	SABESP	2.180.054,83	BRBSBSPDBS130	brAAA	Aa2.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	25/05/15	15/04/23	RD COLIN	605.341,75	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	27/05/15	15/04/23	RD COLIN	605.206,06	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	27/05/15	15/04/23	RD COLIN	665.762,46	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	01/06/15	15/04/23	RD COLIN	780.749,49	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	12/08/15	16/07/23	DUKE GEP	1.469.567,54	BRGEPADBS079	-	Aaa.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	05/02/16	15/01/23	ECPT	18.643,38	BRASCPDBS003	-	A2.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	11/02/16	15/01/23	ECPT	64.650,88	BRASCPDBS003	-	A2.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	01/03/16	15/01/23	ECPT	310.832,85	BRASCPDBS003	-	A2.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	18/05/16	15/10/24	TRANS AL	1.193.320,83	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/24	TRANS AL	440.743,01	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/24	TRANS AL	264.445,81	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	20/06/16	15/10/24	TRANS AL	880.507,25	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	25/08/16	15/01/23	ECPT	162.422,86	BRASCPDBS003	-	A2.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	25/08/16	15/01/23	ECPT	104.468,07	BRASCPDBS003	-	A2.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	10/10/16	15/01/23	SABESP	167.696,48	BRBSBSPDBS130	brAAA	Aa2.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	24/03/17	15/01/23	ECPT	149.377,79	BRASCPDBS003	-	A2.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	16/05/17	15/01/23	ECPT	281.327,53	BRASCPDBS003	-	A2.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/07/17	15/04/23	RD COLIN	1.431.687,86	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-	-
FI RF EMB II	25/08/17	15/08/24	PETR	17.667.208,17	BRPETRDBS084	AAA	Aaa.br	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	18/12/17	06/11/27	RB CAPIT	3.675.622,75	BRBRACRI4G2	-	-	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	21/12/17	06/11/27	RB CAPIT	1.072.808,15	BRBRACRI4G2	-	-	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/01/18	06/11/27	RB CAPIT	3.821.066,19	BRBRACRI4G2	-	-	AAA(bra)	-
FI RF EMB II	19/02/18	15/02/25	SABESP	9.435.319,28	BRBSBSPDBS1A7	brAAA	-	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/02/18	15/02/25	SABESP	5.855.646,33	BRBSBSPDBS1A7	brAAA	-	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	11.915.303,35	BRENTVDBS008	brAA	-	AA(bra)	-
FI RF EMB II	23/05/18	15/05/28	COMGAS	26.847.623,37	BRCGASDBS093	-	-	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	586.235,90	BRENTVDBS008	brAA	-	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	586.235,90	BRENTVDBS008	brAA	-	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	586.235,90	BRENTVDBS008	brAA	-	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	584.872,63	BRENTVDBS008	brAA	-	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	586.235,90	BRENTVDBS008	brAA	-	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	12.019.253,59	BRERDVDBS0E8	brAAA	A2.br	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	28/07/18	15/07/25	AEGEA SA	13.847.579,55	BR AEGPDBS038	brA	Aa1.br	AA(bra)	-
FI RF EMB II	26/07/18	15/07/25	CSMG	15.508.314,29	BRCSMGDBS0E7	-	Aa3.br	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/04/23	RD COLIN	448.415,44	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/04/23	RD COLIN	254.506,06	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/04/23	RD COLIN	672.623,16	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/02/25	CEMIG	1.979.677,80	BRCMGDBS041	brA+	A1.br	AA-(bra)	-
FIM EMB II A	14/11/18	15/03/24	BRADESCO	333.413,39	BRBBDCLTR6K7	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	-
FIM EMB I A	04/01/19	07/06/24	MOV_PART	776.039,02	BRMOVDBS085	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB II A	17/01/19	16/09/24	ITAUUBB	305.895,57	BRBITALFIU67	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	-
FIM EMB I A	12/02/19	15/01/25	ITAUUBB	2.780.499,75	BRBITALFITJ2	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	-
FIM EMB II A	12/02/19	15/01/25	ITAUUBB	2.780.499,75	BRBITALFITJ2	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/05/26	OMEGA GE	551.311,81	BROMGEDBS028	-	-	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/05/26	OMEGA GE	3.490.757,98	BROMGEDBS028	-	-	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/05/26	OMEGA GE	1.987.903,17	BROMGEDBS028	-	-	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/05/26	OMEGA GE	6.010.093,94	BROMGEDBS028	-	-	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/07/29	GUARIROB	687.514,71	BRGRRBDBS042	-	-	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/07/29	GUARIROB	5.562.619,03	BRGRRBDBS042	-	-	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/07/29	GUARIROB	8.250.176,54	BRGRRBDBS042	-	-	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/07/29	GUARIROB	850.018,19	BRGRRBDBS042	-	-	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/05/26	OMEGA GE	602.997,29	BROMGEDBS028	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB I A	30/09/20	22/09/25	BCBF	265.589,39	BRBCBFDBS032	-	-	AA+(bra)	-
FIM EMB II A	08/01/21	15/04/24	ECORODOV	1.359.936,81	BRERDVDBS0F5	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB II A	20/01/21	15/07/23	AEGEA SA	379.446,26	BR AEGPDBS020	-	Aa1.br	AA(bra)	-
FIM EMB II A	20/01/21	23/07/23	COPEL GT	94.048,08	BRCPGTDBS032	-	-	AA+(bra)	-
FIM EMB II A	04/02/21	15/07/23	AEGEA SA	128.263,52	BR AEGPDBS020	-	Aa1.br	AA(bra)	-
FIM EMB II A	05/02/21	23/07/23	COPEL GT	59.107,34	BRCPGTDBS032	-	-	AA+(bra)	-
FIM EMB II A	05/02/21	15/07/23	AEGEA SA	176.362,35	BR AEGPDBS020	-	Aa1.br	AA(bra)	-



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/12/2022

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING			
Fundo	DataAquisição	DataVencimento	Emissor	Financeiro	Cód.ISIN	S&P	Moody's	Fitch	Austin
FIM EMB II A	05/02/21	15/07/24	COPEL GT	303.467,38	BRCPGTDBS057	-	-	AA+(bra)	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/12/30	ENTREVIA	5.816.048,96	BRENTVDBS008	brAA	-	AA(bra)	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/12/30	ENTREVIA	5.829.865,50	BRENTVDBS008	brAA	-	AA(bra)	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/05/29	ELETROB	4.047.478,04	BRELETDDBS032	brAAA	-	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/06/29	NEOENERG	583.668,21	BRNEOEDBS047	brAA+	-	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/06/29	NEOENERG	5.801.953,30	BRNEOEDBS047	brAA+	-	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/05/29	ELETROB	1.676.043,13	BRELETDDBS032	brAAA	-	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/05/29	ELETROB	3.212.364,70	BRELETDDBS032	brAAA	-	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/05/29	ELETROB	3.436.909,45	BRELETDDBS032	brAAA	-	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/07/34	IGUA SAN	2.631.404,78	BRIGSNDBS044	brAA	-	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/05/28	COMGAS	23.383.413,90	BRCGASDBS093	-	-	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	16/07/23	DUKE GEP	5.912.171,11	BRGEPADBS079	-	Aaa.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	449.457,30	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	791.044,86	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	898.914,61	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	449.457,30	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	550.135,74	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	461.954,82	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	1.340.294,44	BRTAEEDBS076	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	27/01/25	BRADESCO	12.897.445,24	BRBBDCLFRZJ5	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/11/24	CCR	5.974.205,44	BRCCRODBS0G5	brAAA	-	AA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/11/24	ECORODOV	3.981.742,98	BRERDVDBS0D0	brAA	A2.br	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/02/25	SABESP	1.375.210,51	BRSBSPDBS1A7	brAAA	-	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/05/28	COMGAS	10.392.628,40	BRCGASDBS093	-	-	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/06/27	JAGUARA	1.770.944,28	BRENJGDBS018	-	-	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/06/27	ENERGMIR	1.101.968,43	BRENMIDBS018	-	-	AAA(bra)	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	01/08/25	BRADESCO	4.183.681,32	BRBBDCLTRJ8	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	-
FIM EMB I A	28/05/21	28/11/23	B.ALFA	1.141.949,81	BRBRVLFII52	-	Aa1.br	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/34	VIARONDO	172.196,79	BRVRDNDBS012	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/09/34	BRKA	332.375,88	BRBRKPDBS055	-	Aa3.br	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/10/30	LAMEA	1.913.394,64	BRAMERDBS081	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/10/38	TAUBATE	3.147.196,09	BRLTTEEDBS048	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/26	IRB	2.465.722,93	BRIRBRDBS022	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/10/30	LAMEA	936.790,52	BRAMERDBS081	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/31	METRORIO	3.901.708,58	BRMGPRDBS068	brAA	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/03/28	BRISANET	3.174.716,07	BRBRSTDBS001	brA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/10/36	PAMPASUL	990.138,06	BRUTPSDBS013	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/10/30	LAMEA	439.120,56	BRAMERDBS081	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/31	METRORIO	3.657.851,80	BRMGPRDBS068	brAA	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/03/31	LOCALIZA	5.046.756,58	BRRENTDBS0K7	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/05/30	NORTE EN	285.520,10	BRNTEENDBS005	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/34	VIARONDO	1.557.166,09	BRVRDNDBS012	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	09/06/21	15/11/25	QUATA	1.709.063,92	BRQUATDBS019	-	-	A(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/06/21	15/12/35	MS 306	663.276,58	BRCNRDDBS004	-	-	A(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/08/25	CSAN	29.809,54	BRRLOGDBS006	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/11/24	DASA	429.404,98	BRDASADBS0G1	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/08/25	CSAN	804.857,57	BRRLOGDBS006	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	04/11/25	BCBF	503.760,36	BRBCFBDBS040	-	-	AA+(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	04/11/25	BCBF	503.760,36	BRBCFBDBS040	-	-	AA+(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	27/11/25	SANEAMEN	485.836,34	BRSNGODBS0J1	-	-	A+(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	27/11/25	SANEAMEN	987.472,24	BRSNGODBS0J1	-	-	A+(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	27/11/25	SANEAMEN	972.660,15	BRSNGODBS0J1	-	-	A+(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/11/24	DASA	1.744.013,59	BRDASADBS0G1	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/11/24	DASA	435.495,83	BRDASADBS0G1	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/08/25	CSAN	201.214,39	BRRLOGDBS006	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/08/25	CSAN	503.568,30	BRRLOGDBS006	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	04/11/25	BCBF	1.510.244,52	BRBCFBDBS040	-	-	AA+(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	14/06/21	19/06/24	BNBBM	563.771,41	BRBNBRLFIOF8	brAAA	AABr	AA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	14/06/21	12/06/24	BNBBM	855.433,64	BRBNBRLFIOE2	brAAA	AABr	AA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/06/21	29/06/24	SFB COME	480.366,40	BRSBFCDBS002	brA+	-	A+(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/06/21	29/06/24	SFB COME	1.150.173,08	BRSBFCDBS002	brA+	-	A+(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	15/06/21	15/12/30	B2W	453.918,67	BRAMERDBS008	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	15/06/21	15/09/34	BRKA	937.072,18	BRBRKPDBS055	-	Aa3.br	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	15/06/21	15/10/36	PAMPASUL	2.361.219,37	BRUTPSDBS039	brAAA	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	16/06/21	13/07/23	ECORODOV	2.166.369,36	BRERDVDBS0J7	brAAA	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	16/06/21	15/03/29	OMEGA GE	2.010.421,18	BROMGEDBS069	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	17/06/21	15/02/31	CORSAN	748.594,63	BRRSANDBS055	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	17/06/21	15/02/26	CORSAN	1.066.256,54	BRRSANDBS030	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	18/06/21	15/12/30	MG050	510.654,44	BRRDVIDBS061	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	21/06/21	15/04/28	PAMPASUL	1.153.429,73	BRUTPSDBS005	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	15/10/30	LAMEA	286.892,10	BRAMERDBS081	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	15/12/35	MS 306	1.447.681,72	BRCNRDDBS004	-	-	A(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	15/10/30	LAMEA	1.487.154,95	BRAMERDBS081	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	15/12/35	MS 306	79.124,30	BRCNRDDBS004	-	-	A(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	20/06/26	OURO VER	1.428.590,85	BROVSADBS0E8	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/06/21	15/09/34	BRKA	1.584.221,48	BRBRKPDBS055	-	Aa3.br	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	30/06/21	15/12/35	MS 306	2.930.529,79	BRCNRDDBS004	-	-	A(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	01/07/21	15/10/26	LIGHT	5.240.806,62	BRLIGHDBS0S5	brAA+	A+ br	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	01/07/21	15/12/35	MS 306	2.563.236,73	BRCNRDDBS004	-	-	A(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	02/07/21	18/02/25	RENNER	1.165.920,62	BRLRENDBS0B4	brAAA	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	02/07/21	18/02/25	RENNER	246.575,74	BRLRENDBS0B4	brAAA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	07/07/21	15/03/29	CAGECE	1.171.617,17	BRCAECDBS019	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	08/07/21	15/06/31	VAMOS	243.421,50	BRVAMODBS041	brAA+	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	08/07/21	15/03/29	CAGECE	2.670.172,35	BRCAECDBS019	-	-	AA-(bra)	-



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/12/2022

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING			
Fundo	DataAquisição	DataVencimento	Emissor	Financeiro	Cód.ISIN	S&P	Moody's	Fitch	Austin
FIM EMB VII A CRED PRIV	08/07/21	15/06/31	VAMOS	4.829.791,76	BRVAMODBS041	brAA+	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	12/07/21	12/07/26	BRDESCO	3.636.787,90	BRBBDCLTRQT4	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/07/29	GUARIROB	1.150.313,13	BRGRRBDBS042	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/26	IRB	1.936.721,33	BRIRBRDBS022	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/34	VIARONDO	214.453,67	BRVRDNDBS012	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/26	IRB	940.693,22	BRIRBRDBS022	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/30	B2W	1.634.554,42	BRAMERDBS008	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/09/34	BRKA	428.671,69	BRBRKPDBS055	-	Aa3.br	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/26	IRB	489.160,47	BRIRBRDBS022	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/30	B2W	1.442.253,90	BRAMERDBS008	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/30	B2W	2.115.305,72	BRAMERDBS008	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/30	B2W	1.057.652,86	BRAMERDBS008	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/09/34	BRKA	715.488,26	BRBRKPDBS055	-	Aa3.br	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/34	VIARONDO	1.804.368,85	BRVRDNDBS012	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/34	VIARONDO	282.064,69	BRVRDNDBS012	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/26	IRB	3.873.442,67	BRIRBRDBS022	brAA+	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	10/05/24	MULTIPLA	3.110.672,19	BRMULTDBS031	brAAA	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	20/09/24	IGUATEMI	383.580,38	BRIGTADBS072	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	20/09/24	IGUATEMI	383.580,38	BRIGTADBS072	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	20/09/24	IGUATEMI	1.367.547,44	BRIGTADBS072	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	15/07/27	RT BANDE	2.476.923,99	BRCRBDBS033	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	15/05/23	ELEKTRO	552.922,15	BREKTRDBS0F0	brAAA	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	15/09/23	SONAE	1.564.481,68	BRALSCDBS036	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	16/07/21	15/02/31	CORSAN	2.759.402,99	BRRSANDBS055	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	19/07/21	15/07/30	PARANAGU	673.572,63	BRPASNDBS018	brAA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	19/07/21	15/05/30	NORTE EN	1.822.569,95	BRNTEENBS005	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	19/07/21	15/10/30	LAMEA	1.894.658,83	BRAMERDBS081	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	21/07/21	15/10/36	PAMPASUL	1.912.878,10	BRUTPSDBS013	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	21/07/21	15/10/36	PAMPASUL	700.939,32	BRUTPSDBS013	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB I A	21/07/21	15/05/25	INTERVIA	1.282.702,77	BRVIADBS074	-	Aa2.br	-	-
FIM EMB I A	21/07/21	05/03/24	ENERG TR	1.330.918,99	BRETENBS061	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB I A	21/07/21	15/07/27	RT BANDE	1.190.712,61	BRCRBDBS033	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB I A	21/07/21	15/03/29	OMEGA GE	1.016.267,91	BROMGEDBS069	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB I A	21/07/21	20/08/26	VAMOS	1.080.883,18	BRVAMODBS017	brAA+	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	23/07/21	15/12/30	MG050	1.531.963,31	BRRDVIDBS061	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	27/07/21	15/06/28	MOVIDA L	1.636.654,93	BRMVLVDBS050	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	27/07/21	15/06/28	MOVIDA L	4.157.721,13	BRMVLVDBS050	brAA+	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	29/07/21	15/10/24	BKBR	1.421.895,25	BRBKBRDBS048	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	29/07/21	15/12/26	RD COLIN	2.090.807,19	BRCOLNDBS0C7	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	30/07/21	15/05/30	NORTE EN	1.011.217,01	BRNTEENBS005	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	1.054.044,47	BRUNEGDBS007	brAA	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	06/08/21	15/12/31	METRORIO	1.121.741,22	BRMGPRDBS068	brAA	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	11/08/21	15/08/31	CSAN	1.071.584,36	BRCNSANDBS040	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	11/08/21	15/06/27	AUTOPIST	1.267.880,20	BRAPRDBS023	brAAA	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	17/08/21	15/05/30	NORTE EN	3.066.961,70	BRNTEENBS005	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	18/08/21	15/12/31	METRORIO	1.137.591,91	BRMGPRDBS068	brAA	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	18/08/21	15/12/31	METRORIO	882.761,57	BRMGPRDBS068	brAA	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	27/08/21	20/08/31	S LUIZ A	1.054.242,23	BRRDORDBS0A0	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	06/09/21	15/08/31	COMGAS	2.670.301,32	BRCGASDBS0B7	-	AAA(bra)	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	08/09/21	15/05/30	NORTE EN	498.470,50	BRNTEENBS005	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB I A	16/09/21	15/07/26	GUARIROB	698.260,12	BRGRRBDBS034	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB I A	16/09/21	15/07/26	GUARIROB	62.530,76	BRGRRBDBS034	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB I A	16/09/21	15/07/26	GUARIROB	312.653,78	BRGRRBDBS034	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB I A	16/09/21	15/06/24	PROLAGOS	2.204.946,68	BRPRLGDBS037	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB I A	16/09/21	15/04/26	ELETROB	2.019.231,47	BRELETDDBS040	brAAA	-	-	-
FIM EMB I A	16/09/21	21/10/26	AUTOBAN	725.162,70	BRANHBDBS0F3	brAAA	-	-	-
FIM EMB I A	17/09/21	01/10/24	EQUATENE	1.449.472,74	BREQTLDBS036	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	17/09/21	15/03/28	BRISANET	1.414.530,11	BRBRSTDBS001	brA+	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	20/09/21	15/09/29	MOV_PART	1.077.588,30	BRMOVIDBS0G1	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	15/12/30	MG050	1.021.308,88	BRRDVIDBS061	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	15/12/30	MG050	1.021.308,88	BRRDVIDBS061	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	1.040.394,66	BRMOVIDBS0H9	brAA+	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/07/39	EDPM	1.982.979,51	BRMGSPDBS017	brAA+	-	AA+(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/02/31	CORSAN	769.388,93	BRRSANDBS055	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/02/31	CORSAN	769.388,93	BRRSANDBS055	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/02/31	CORSAN	255.769,83	BRRSANDBS055	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/02/31	CORSAN	255.769,83	BRRSANDBS055	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/04/26	ECORODOV	739.486,50	BRERDVBS0H1	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/04/26	ECORODOV	739.486,50	BRERDVBS0H1	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/04/26	ECORODOV	950.246,25	BRERDVBS0H1	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/04/26	ECORODOV	369.134,12	BRERDVBS0H1	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/04/26	ECORODOV	369.134,12	BRERDVBS0H1	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	4.000.337,95	BRLCAMDBS0R2	brAAA	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	4.054.054,17	BRLCAMDBS0R2	brAAA	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	24/09/21	15/03/24	CCPR	41.666,53	BRCCPRDBS0D1	-	A.br	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	24/09/21	20/05/25	CEA MODA	1.641.745,38	BRCEABDBS011	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	24/09/21	11/09/23	PANAMERI	1.170.905,75	BRBPANLFi654	brAAA	AAAbr	AA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	27/09/21	15/01/26	LOCAMERI	1.950.276,45	BRLCAMDBS0O9	brAAA	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	27/09/21	05/03/24	ENERG TR	2.083.772,70	BRETENBS061	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	27/09/21	01/04/24	CNH	2.175.736,06	BRCNHCLFI317	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	30/09/21	15/09/31	SIMPAR	804.308,50	BRSIMHDBS044	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	01/10/21	15/09/41	TUCANOHO	1.957.774,02	BRTNHLDBS002	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	04/10/21	15/12/31	METRORIO	602.326,26	BRMGPRDBS068	brAA	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	5.205.460,97	BRTCIDBS009	-	-	AA-(bra)	-



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/12/2022

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING			
Fundo	DataAquisição	DataVencimento	Emissor	Financeiro	Cód.ISIN	S&P	Moody's	Fitch	Austin
FIM EMB I A	20/10/21	20/10/25	DAYCOVAL	2.415.736,45	BRDAYCLFNKX1	brAA+	AA.br	AA(bra)	-
FIM EMB I A	20/10/21	20/10/24	DAYCOVAL	1.344.965,32	BRDAYCLFNKW3	brAA+	AA.br	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/10/21	15/12/35	CART	2.571.388,81	BRRPTADBS033	brAA+	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	22/10/21	15/12/35	CART	791.987,75	BRRPTADBS033	brAA+	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	25/10/21	15/03/26	VIX LOGI	1.036.378,30	BRVIXLDBS047	-	-	A+(bra)	-
FIM EMB I A	27/10/21	15/10/29	CONT GLO	2.147.947,13	BRGCBPDBS014	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	797.686,92	BRHARGDBS003	brAAA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	1.155.853,63	BRHARGDBS003	brAAA	-	-	-
FIM EMB I A	28/10/21	07/11/23	TOYOTA	2.543.354,28	BRBTOYLF2F4	brAAA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	29/10/21	15/10/31	ENERGISA	2.869.101,82	BRENGIDBS000	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	04/11/21	15/07/39	UTE GNA	3.153.833,86	BRUNEGDBS007	brAA	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/11/21	15/10/28	LIGHT	1.513.431,51	BRLIGHDBS020	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	12/11/21	15/10/31	VAMOS	2.036.488,20	BRVAMODBS074	brAA+	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	18/11/21	15/10/31	HIDRO BR	3.889.686,29	BRHBSADBS010	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	22/11/21	15/06/39	ANEMUS	1.705.229,31	BRANEMDBS007	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	26/11/21	15/07/29	GUARIROB	2.053.362,69	BRGRBDBS042	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	26/11/21	15/04/26	ECORODOV	2.105.160,92	BRERDVBS0H1	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	30/11/21	15/06/39	ANEMUS	2.218.165,93	BRANEMDBS007	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	30/11/21	15/03/28	BRISANET	806.175,80	BRBRSTDBS001	brA+	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	03/12/21	11/06/24	BNBBM	564.642,66	BRBNBRLFI005	brAAA	AAbr	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	06/12/21	15/12/35	TESC	2.492.691,57	BRJENDBS009	-	-	A+(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	09/12/21	15/11/25	QUATA	2.359.862,61	BRQUATDBS019	-	-	A(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	09/12/21	15/07/39	EDPM	3.451.136,09	BRMGSPDBS017	brAA+	-	AA+(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	20/12/21	15/11/35	HAZTEC	2.003.532,59	BRHZTCDBS013	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	06/01/22	15/09/41	TUCANOHO	1.631.478,35	BRTNHLDBS002	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	06/01/22	15/09/41	TUCANOHO	323.032,71	BRTNHLDBS002	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/01/22	15/03/26	VIX LOGI	1.017.323,34	BRVIXLDBS047	-	-	A+(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	13/01/22	15/07/30	PARANAGU	1.363.959,86	BRPASNDBS018	brAA	-	-	-
FIM EMB I A	19/01/22	19/01/24	BES INV	1.140.048,58	BRINTLLFI6T5	brAAA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/01/22	15/07/34	RT BANDE	337.463,15	BRRCRDBDS041	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/01/22	15/07/34	RT BANDE	5.646.690,98	BRRCRDBDS082	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	15/12/35	CART	329.137,77	BRRPTADBS033	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	15/12/35	CART	318.852,21	BRRPTADBS033	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	3.740.119,68	BRPILDBS008	-	-	AA+(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/02/22	15/10/36	HOLDARAG	2.113.077,94	BRHARGDBS003	brAAA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	14/02/22	15/12/35	CART	761.131,09	BRRPTADBS033	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	14/02/22	15/12/35	CART	678.846,65	BRRPTADBS033	brAA+	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	25/03/22	15/03/44	GBS PART	2.121.041,49	BRGBSPDBS002	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/03/22	15/03/44	GBS PART	3.612.479,42	BRGBSPDBS002	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/03/22	15/06/39	ANEMUS	1.017.894,23	BRANEMDBS007	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	12/04/22	08/04/27	UNIGEL P	840.403,03	BRUGELDBS001	brAA+	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	19/04/22	16/04/29	VERT-10	1.199.490,45	BRVCCSDBS007	-	-	AAAsf(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	26/04/22	15/04/24	LIGHT	2.059.787,76	BRLIGHDBS108	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	08/05/22	15/10/36	UHESIMAO	1.434.937,75	BRUHSMDBS023	brAAA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	06/05/22	15/07/30	PARANAGU	2.824.850,87	BRPASNDBS018	brAA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	06/05/22	15/07/30	PARANAGU	1.393.632,66	BRPASNDBS018	brAA	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	12/05/22	15/04/27	BRKA	2.285.484,95	BRBRKPDBS071	-	A+ br	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	12/05/22	15/07/30	PARANAGU	1.670.578,82	BRPASNDBS018	brAA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	12/05/22	15/10/36	UHESIMAO	2.877.600,61	BRUHSMDBS023	brAAA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	12/05/22	15/09/41	TUCANOHO	1.803.327,41	BRTNHLDBS002	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	19/05/22	13/05/28	CEA MODA	508.187,97	BRCEABDBS037	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	26/05/22	10/05/27	GUAR	2.532.464,13	BRGUARDBS071	-	-	A+(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	15/10/36	HOLDARAG	2.301.141,88	BRHARGDBS003	brAAA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	15/12/35	IP SUL C	527.074,36	BRPILDBS008	-	-	AA+(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	15/07/30	PARANAGU	1.284.832,38	BRPASNDBS018	brAA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	03/03/22	15/09/41	AESTUCAN	2.774.510,70	BRTCIDBS009	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	04/03/22	15/06/25	ECORODOV	2.439.710,76	BRERDVBS0E8	brAAA	A2.br	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	04/03/22	15/06/25	ECORODOV	1.005.520,70	BRERDVBS0E8	brAAA	A2.br	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	07/03/22	15/12/36	VIA BRAS	3.142.222,18	BRVIMTDBS019	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	07/03/22	15/12/36	VIA BRAS	2.515.124,27	BRVIMTDBS019	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	07/06/22	15/12/35	TESC	775.764,88	BRJENDBS009	-	-	A+(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	07/06/22	15/03/28	BRISANET	480.727,52	BRBRSTDBS001	brA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	15/12/35	IP SUL C	421.659,49	BRPILDBS008	-	-	AA+(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	15/12/35	TESC	486.587,05	BRJENDBS009	-	-	A+(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	15/06/39	ANEMUS	259.887,89	BRANEMDBS007	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	13/06/22	15/09/31	SIMPAR	1.731.379,87	BRSIMHDBS044	brAA+	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	13/06/22	15/06/31	VAMOS	828.792,27	BRVAMODBS041	brAA+	-	AA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	13/06/22	15/06/31	VAMOS	67.617,08	BRVAMODBS041	brAA+	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	13/06/22	15/03/29	OMEGA GE	845.382,11	BRMOMGDBS069	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	13/06/22	15/03/29	OMEGA GE	955.955,27	BRMOMGDBS069	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	20/06/22	15/04/28	PAMPASUL	2.547.613,29	BRUTPSDBS005	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	21/06/22	15/07/34	RT BANDE	1.231.740,50	BRRCRDBDS041	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	27/06/22	07/07/24	LAGE	2.148.361,99	BRLAGELFI008	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	14/07/22	15/09/46	ENGIE	1.799.309,82	BREGIEDBS0B3	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	14/07/22	15/09/46	ENGIE	1.894.061,23	BREGIEDBS0B3	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	14/07/22	15/09/46	ENGIE	2.840.608,41	BREGIEDBS0B3	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	15/07/34	RT BANDE	3.020.295,20	BRRCRDBDS041	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	15/10/31	VAMOS	1.969.284,09	BRVAMODBS074	brAA+	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	15/10/31	VAMOS	1.476.453,94	BRVAMODBS074	brAA+	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	25/07/22	22/07/27	CM HOSPI	1.722.931,46	BRVVEODBS044	-	AA.br	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	26/07/22	10/01/28	AMBIPAR	2.543.481,72	BRAMBPDBS024	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/07/22	28/04/26	GSSH PAR	2.376.802,16	BRGSHDDBS016	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	27/07/22	15/03/44	GBS PART	2.899.272,77	BRGBSPDBS002	-	-	AAA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/07/22	18/07/25	1V11	1.739.223,15	BRVCCSDBS003	brAAA(sf)	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	29/07/22	15/09/41	AESTUCAN	1.530.405,53	BRTCIDBS009	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	29/07/22	15/10/31	ENERGISA	2.459.230,13	BRENGIDBS000	-	-	AAA(bra)	-



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/12/2022

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING			
Fundo	DataAquisição	DataVencimento	Emissor	Financeiro	Cód.ISIN	S&P	Moody's	Fitch	Austin
FIM EMB VII A CRED PRIV	29/07/22	15/10/36	UHESIMAO	2.916.226,12	BRUHSMDBS023	brAAA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	08/08/22	15/10/36	PAMPASUL	189.067,50	BRUTPSDBS039	brAAA	-	AA+(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	08/08/22	15/11/25	QUATA	1.147,79	BRQUATDBS019	-	-	A(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	15/07/29	GUARIROB	3.493.941,75	BRGRRBDBS042	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	15/03/29	CAGECE	1.448.174,57	BRCAECDBS019	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	15/03/29	CAGECE	2.412.909,66	BRCAECDBS019	-	-	AA-(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	15/05/30	NORTE EN	1.554.894,86	BRNTENDBS005	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	15/05/30	NORTE EN	762.576,59	BRNTENDBS005	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	23/08/22	15/08/32	PETRJ	9.427.708,84	BRPEJADBS008	brAA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	30/08/22	15/08/29	TRBR	8.756.899,47	BRCONXDBS009	brA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	02/09/22	02/09/29	AEGEA SA	1.797.765,73	BRAEGPDBS095	brAA+	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	27/09/22	15/11/25	QUATA	49.355,10	BRQUATDBS019	-	-	A(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	28/09/22	28/09/27	B.BRASIL	4.389.829,61	BRBASLFBIN9	-	AAA.br	AA(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	06/10/22	13/09/32	NTRASSUD	1.737.472,17	BRNTSDDBS055	-	-	AA+(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	14/10/22	15/11/25	QUATA	34.433,79	BRQUATDBS019	-	-	A(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	03/11/22	15/11/36	ITAPOA T	2.760.884,49	BRITPODBS041	-	AA.br	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	03/11/22	15/03/29	ANET	2.265.754,47	BRANETDBS002	brA	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	03/11/22	15/11/36	ITAPOA T	4.928.273,76	BRITPODBS041	-	AA.br	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	08/11/22	27/10/27	CM HOSPI	1.018.739,24	BRVWEODBS069	-	AA.br	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	08/11/22	15/06/42	BRK AMBI	4.561.819,92	BRMSADBS024	-	AA-br	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	09/11/22	15/04/38	RDVE	1.493.700,05	BRRDVEDBS003	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	09/11/22	15/07/39	UTE GNA	1.488.734,08	BRUNEGDBS007	brAA	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	11/11/22	15/10/40	RAHOLD	2.590.207,71	BRRAHDDBS000	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	11/11/22	15/10/40	RAHOLD	9.605.479,83	BRRAHDDBS000	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	15/07/29	GUARIROB	3.558.445,29	BRGRRBDBS042	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	15/07/29	GUARIROB	1.601.837,91	BRGRRBDBS042	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	15/07/29	GUARIROB	1.311.571,98	BRGRRBDBS042	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	15/09/34	BRKA	3.596.079,21	BRBRKPDBS055	-	Aa3.br	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	15/09/34	BRKA	1.618.390,96	BRBRKPDBS055	-	Aa3.br	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	15/09/34	BRKA	1.325.361,76	BRBRKPDBS055	-	Aa3.br	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	01/12/22	15/06/39	ANEMUS	1.611.760,86	BRANEMDBS007	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	15/09/31	MOV_PART	2.016.813,43	BRMOVIDBS0H9	brAA+	-	AA+(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	15/09/31	MOV_PART	2.139.521,27	BRMOVIDBS0H9	brAA+	-	AA+(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	15/09/31	MOV_PART	1.560.591,99	BRMOVIDBS0H9	brAA+	-	AA+(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	15/10/36	PAMPASUL	5.975.807,54	BRUTPSDBS039	brAAA	-	AA+(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/12/22	15/12/35	IP SUL C	2.910.504,63	BRIPILDBS008	-	-	AA+(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	20/12/22	16/12/29	CSMG	2.001.918,25	BRCSMGDBS0K4	-	-	AA+(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	15/11/36	ITAPOA T	3.036.154,30	BRITPODBS041	-	AA.br	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	15/04/38	RDVE	1.728.584,12	BRRDVEDBS003	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	15/06/39	ANEMUS	3.028.605,80	BRANEMDBS007	-	-	AA(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	FIDC VERDECARD SN3	2.644.516,90	BRVDCRCTF024	brAAA(sf)	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	FIDC CREDZ SN4	11.595,65	BRCRDZCTF074	-	-	AAAsf(bra)	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	FIDC CREDZ SN6	2.515.788,40	BRCRDZCTF0A0	brAA (sf)	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	FIDC VERDECARD SN5	496.121,25	BRVDCRCTF040	brAAA(sf)	-	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	FIDC VERDECARD SN6	1.400.840,15	BRVDCRCTF057	brAAA(sf)	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	FIDC VERDECARD SN8	1.500.868,07	BRVDCRCTF073	brAAA(sf)	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	RB CAP CREDIT AL SN3	757.297,83	BR08ILCTF045	brAA-(sf)	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	BR ELETRO FIDC S1	3.679.090,81	BR0402CTF000	-	-	Aasf(bra)	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	INSS CONS PDL I FIDC	1.963.170,63	BR082XCTF015	-	-	AAAsf(bra)	-

Observação: Em dezembro de 2022, dois dos ativos da carteira de crédito da EMBRAER PREV sofreram rebaixamentos de suas classificações de risco. O ativo IRBR3 (IRB Brasil RE) teve o rating revisado pela S&P de brAAA para brAA+ e o ativo OMGE13 (Omega Geração) teve o rating revisado pela Fitch de AA(bra) para AA-(bra), porém, as novas classificações não ficaram abaixo do mínimo estabelecido na escala da Política de Investimentos de 2022. O ativo OVSA10 (Ouro Verde) teve o rating elevado pela Fitch de A+(bra) para AA-(bra).

4. RISCO OPERACIONAL

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



5. RISCO DE LIQUIDEZ

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

6. RISCO LEGAL

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

6.1. Relatório de Enquadramentos Legais



Bradesco

Relatório Resumo de Enquadramento

Patrimônio Líquido da Fundação **4.195.287.089,00**

Tópico do Enquadramento	Limite	Aplicação Atual	Valor Limite	% Aplicado	Status
% do Segmento RF/PL PLANO	100,00%	3.493.899.993,76	4.195.287.089,00	83,28%	Enquadrado
% do PL em Títulos de Emissão do Tesouro Nacional e/ou do BAC	100,00%	2.733.369.307,67	4.195.287.089,00	65,15%	Enquadrado
% do PL em Títulos RF1, exceto títulos do Tesouro Nacional	80,00%	760.530.686,09	3.356.229.721,21	18,13%	Enquadrado
% do PL em FIDC	20,00%	Verificar Rel. de Diversificação de FIDC's	839.057.430,30	0,00%	Enquadrado
% do PL em uma mesma pessoa jurídica não-financeira	10,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Não Financ.	419.528.715,15	0,00%	Enquadrado
% do PL em Instituições Financeiras	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Financ.	1.048.821.772,25	0,00%	Enquadrado
% de uma mesma Série de Debêntures	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Debêntures	1.048.821.772,25	0,00%	Enquadrado
% do PL em RV	70,00%	527.388.416,06	2.936.700.912,29	12,57%	Enquadrado
% do capital votante de uma empresa	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação RV	1.048.821.772,25	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Imobiliários	20,00%	103.682.038,15	839.057.430,30	2,47%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Empréstimos	15,00%	27.885.452,26	629.293.088,36	0,66%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Estruturados	20,00%	0,00	839.057.430,30	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos no Exterior	10,00%	28.734.573,26	419.528.715,15	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: 01 DE DEZEMBRO DE 2022 À 30 DE DEZEMBRO DE 2022



Bradesco

FIM EMB I A

DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	FUNTE ANBIMA				FORA DO TÚNEL
								TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	
02/12/2022	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	6,0295%	6,0052%	5,8423%	6,1988%	0,0243%	NÃO
15/12/2022	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	6,3695%	6,3572%	6,1503%	6,5270%	0,0123%	NÃO
16/12/2022	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Compra	6,5490%	6,2909%	5,8767%	7,9266%	0,2581%	NÃO
16/12/2022	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Compra	6,5991%	6,2909%	5,8767%	7,9266%	0,3082%	NÃO
19/12/2022	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Compra	6,3492%	6,3311%	5,5731%	7,6381%	0,0181%	NÃO
19/12/2022	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Compra	6,2492%	6,3311%	5,5731%	7,6381%	-0,0819%	NÃO
19/12/2022	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Compra	6,4992%	6,3311%	5,5731%	7,6381%	0,1681%	NÃO
20/12/2022	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Compra	6,3291%	6,3499%	5,5988%	7,6894%	-0,0208%	NÃO
20/12/2022	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Compra	6,2992%	6,3499%	5,5988%	7,6894%	-0,0507%	NÃO
20/12/2022	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Compra	6,2992%	6,3499%	5,5988%	7,6894%	-0,0507%	NÃO
20/12/2022	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Compra	6,3490%	6,3499%	5,5988%	7,6894%	-0,0009%	NÃO
21/12/2022	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Compra	6,2491%	6,2357%	5,6249%	7,7204%	0,0134%	NÃO
21/12/2022	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Compra	6,3492%	6,2357%	5,6249%	7,7204%	0,1135%	NÃO
21/12/2022	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Compra	6,3791%	6,2357%	5,6249%	7,7204%	0,1434%	NÃO
21/12/2022	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Compra	6,4191%	6,2357%	5,6249%	7,7204%	0,1834%	NÃO
21/12/2022	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Compra	6,3690%	6,2357%	5,6249%	7,7204%	0,1333%	NÃO
21/12/2022	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Compra	6,2592%	6,2357%	5,6249%	7,7204%	0,0235%	NÃO
21/12/2022	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Compra	6,2293%	6,2357%	5,6249%	7,7204%	-0,0064%	NÃO
21/12/2022	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Compra	6,2991%	6,2357%	5,6249%	7,7204%	0,0634%	NÃO
21/12/2022	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Compra	6,3690%	6,2357%	5,6249%	7,7204%	0,1333%	NÃO
21/12/2022	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Compra	6,3290%	6,2357%	5,6249%	7,7204%	0,0933%	NÃO
21/12/2022	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Compra	6,2391%	6,2357%	5,6249%	7,7204%	0,0034%	NÃO
22/12/2022	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Compra	6,2990%	6,2666%	5,5054%	7,6163%	0,0324%	NÃO
22/12/2022	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Compra	6,2491%	6,2666%	5,5054%	7,6163%	-0,0175%	NÃO
22/12/2022	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Compra	6,2691%	6,2666%	5,5054%	7,6163%	0,0025%	NÃO
26/12/2022	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	6,6011%	6,5203%	5,8678%	8,0098%	0,0808%	NÃO
26/12/2022	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	6,5013%	6,5203%	5,8678%	8,0098%	-0,0190%	NÃO
26/12/2022	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	6,4412%	6,5203%	5,8678%	8,0098%	-0,0791%	NÃO
26/12/2022	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	6,5013%	6,5203%	5,8678%	8,0098%	-0,0190%	NÃO
26/12/2022	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	6,6011%	6,5203%	5,8678%	8,0098%	0,0808%	NÃO
26/12/2022	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	6,5510%	6,5203%	5,8678%	8,0098%	0,0307%	NÃO
26/12/2022	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	6,5013%	6,5203%	5,8678%	8,0098%	-0,0190%	NÃO
26/12/2022	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	6,5612%	6,5203%	5,8678%	8,0098%	0,0409%	NÃO
26/12/2022	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	6,4513%	6,5203%	5,8678%	8,0098%	-0,0690%	NÃO
26/12/2022	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	6,4513%	6,5203%	5,8678%	8,0098%	-0,0690%	NÃO
26/12/2022	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	6,6011%	6,5203%	5,8678%	8,0098%	0,0808%	NÃO
26/12/2022	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	6,4010%	6,5203%	5,8678%	8,0098%	-0,1193%	NÃO
26/12/2022	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	6,4010%	6,5203%	5,8678%	8,0098%	-0,1193%	NÃO
26/12/2022	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2023	Venda	6,6011%	6,5203%	5,8678%	8,0098%	0,0808%	NÃO

FIM EMB II A

DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	FUNTE ANBIMA				FORA DO TÚNEL
								TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	
14/12/2022	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2023	Venda	6,7866%	6,8123%	6,0844%	8,1043%	-0,0257%	NÃO
14/12/2022	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2024	Venda	6,9146%	6,9849%	6,6444%	7,3709%	-0,0703%	NÃO
14/12/2022	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2024	Venda	6,9146%	6,9849%	6,6444%	7,3709%	-0,0703%	NÃO
14/12/2022	FIM EMB II A	BNP	TERRA	NTN-B	15/05/2025	Venda	6,6510%	6,6466%	6,3086%	6,9786%	0,0044%	NÃO
14/12/2022	FIM EMB II A	BNP	TERRA	NTN-B	15/05/2025	Venda	6,6510%	6,6466%	6,3086%	6,9786%	0,0044%	NÃO
14/12/2022	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2027	Venda	6,4385%	6,4775%	6,1327%	6,7104%	-0,0390%	NÃO
14/12/2022	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2027	Venda	6,4385%	6,4775%	6,1327%	6,7104%	-0,0390%	NÃO
14/12/2022	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2027	Venda	6,4385%	6,4775%	6,1327%	6,7104%	-0,0390%	NÃO
14/12/2022	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2028	Venda	6,3925%	6,4245%	6,0841%	6,6282%	-0,0320%	NÃO
14/12/2022	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2028	Venda	6,3925%	6,4245%	6,0841%	6,6282%	-0,0320%	NÃO
14/12/2022	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2028	Venda	6,3925%	6,4245%	6,0841%	6,6282%	-0,0320%	NÃO
14/12/2022	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,3523%	6,3602%	6,1603%	6,5190%	-0,0079%	NÃO
14/12/2022	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,3523%	6,3602%	6,1603%	6,5190%	-0,0079%	NÃO
15/12/2022	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2026	Venda	6,5165%	6,4563%	6,1677%	6,8217%	0,0602%	NÃO
15/12/2022	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2027	Compra	6,4737%	6,4075%	6,1016%	6,7497%	0,0662%	NÃO
15/12/2022	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2035	Venda	6,3643%	6,3374%	6,1023%	6,5476%	0,0269%	NÃO
15/12/2022	FIM EMB II A	BNP	CONCORDI	NTN-B	15/05/2035	Venda	6,3577%	6,3374%	6,1023%	6,5476%	0,0203%	NÃO
15/12/2022	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2035	Venda	6,3643%	6,3374%	6,1023%	6,5476%	0,0269%	NÃO
15/12/2022	FIM EMB II A	BNP	CONCORDI	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,3705%	6,3572%	6,1503%	6,5270%	0,0133%	NÃO

FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI

DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	FUNTE ANBIMA				FORA DO TÚNEL
								TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	
22/12/2022	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	BNP	RENASCEN	LFT	01/09/2023	Venda	0,0084%	0,0068%	-0,0542%	0,0212%	0,0016%	NÃO



RELATÓRIO DE CONTROLE DE RISCO
E RENTABILIDADE - DEZEMBRO DE 2022



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE DEZEMBRO DE 2022 À 30 DE DEZEMBRO DE 2022

DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FROVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
01-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	BPAC11	24,85	36.100,00	897.085,81	24,65	24,96	25,25	23.662,00
01-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	CSAN3	17,57	35.100,00	616.757,89	17,37	17,60	18,08	28.144,00
01-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	INTB3	32,15	12.800,00	411.527,31	31,53	32,15	32,39	4.465,00
01-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SBSP3	60,32	10.100,00	609.218,03	59,40	60,26	60,94	12.087,00
01-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	VALE3	86,08	12.600,00	1.084.629,58	84,73	85,99	86,75	88.532,00
01-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	17,55	100,00	1.754,80	17,23	17,49	17,92	5.925,00
01-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	17,38	1.600,00	27.800,42	17,23	17,49	17,92	5.925,00
01-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	GOAU4	13,40	16.800,00	225.170,83	13,25	13,40	13,62	19.379,00
01-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	18,50	1.100,00	20.351,66	18,28	18,55	18,93	24.170,00
01-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	18,61	100,00	1.861,06	18,28	18,55	18,93	24.170,00
01-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	10,75	6.900,00	74.192,45	10,57	10,91	11,39	30.959,00
01-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	52,95	2.300,00	121.794,30	52,36	52,93	53,59	20.486,00
01-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	52,98	200,00	10.596,20	52,36	52,93	53,59	20.486,00
01-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	16,24	5.578,00	90.608,12	16,01	16,24	16,59	24.413,00
01-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	16,26	8.811,00	143.262,70	16,01	16,24	16,59	24.413,00
01-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	16,20	1.859,00	30.123,49	16,01	16,24	16,59	24.413,00
01-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	16,30	1.240,00	20.211,74	16,01	16,24	16,59	24.413,00
01-12-22	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	HBRH11	92,72	154,00	14.278,83	90,31	92,16	93,39	50,00
01-12-22	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	MAXR11	77,20	479,00	36.978,80	77,20	77,20	77,31	85,00
01-12-22	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	NEWL11	96,25	88,00	8.469,91	94,12	95,13	97,20	159,00
01-12-22	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	PATC11	70,60	410,00	28.944,20	70,07	70,85	72,66	69,00
01-12-22	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	RCRB11	127,53	20,00	2.550,60	125,11	128,13	131,00	3.634,00
01-12-22	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	XPPR11	33,49	186,00	6.229,14	33,27	34,28	35,50	3.523,00
02-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	13,92	1.700,00	23.671,39	13,78	13,90	14,16	4.634,00
02-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	BMGB4	2,30	2.300,00	5.290,36	2,26	2,29	2,32	1.686,00
02-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	25,50	1.600,00	40.797,04	24,58	25,32	25,77	29.487,00
02-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	25,44	1.600,00	40.698,87	24,58	25,32	25,77	29.487,00
02-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	25,46	300,00	7.637,96	24,58	25,32	25,77	29.487,00
02-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,35	1.900,00	23.463,26	12,20	12,33	12,55	17.255,00
02-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	GOAU4	13,52	11.100,00	150.127,24	13,19	13,51	13,73	14.257,00
02-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	5,25	17.100,00	89.728,56	4,89	5,21	5,35	40.062,00
02-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	PETZ3	6,70	3.500,00	23.464,34	6,67	6,86	7,15	29.379,00
02-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	PETZ3	6,80	7.500,00	51.000,00	6,67	6,86	7,15	29.379,00
02-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	BBD4	15,60	80.251,00	1.251.635,28	15,15	15,52	15,75	45.883,00
02-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	BBD4	15,55	32.409,00	503.836,49	15,15	15,52	15,75	45.883,00
02-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	BBD4	15,53	4.630,00	71.915,24	15,15	15,52	15,75	45.883,00
02-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	16,51	914,00	15.088,38	15,94	16,47	16,89	25.525,00
02-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	16,58	4.572,00	75.825,74	15,94	16,47	16,89	25.525,00
02-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	16,65	11.192,00	186.331,94	15,94	16,47	16,89	25.525,00
02-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	16,73	914,00	15.290,87	15,94	16,47	16,89	25.525,00
02-12-22	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	HBRH11	92,58	16,00	1.481,22	91,75	92,34	93,38	15,00
02-12-22	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	MAXR11	77,20	248,00	19.145,60	77,20	77,21	77,87	42,00
02-12-22	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	NEWL11	95,25	649,00	61.819,74	94,00	95,80	99,00	182,00
02-12-22	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	PATC11	69,87	897,00	62.673,15	69,09	71,98	71,98	65,00
02-12-22	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	XPPR11	33,70	2.936,00	98.932,07	33,46	33,81	34,50	1.944,00
05-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	ALSO3	17,16	3.100,00	53.202,39	17,10	17,24	17,69	3.861,00
05-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	13,56	1.000,00	13.559,96	13,41	13,52	13,79	6.357,00
05-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	BBA53	35,13	1.900,00	66.755,22	35,02	35,30	35,96	37.077,00
05-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	BBD4	14,85	1.900,00	28.219,60	14,78	14,96	15,31	60.304,00
05-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	BMGB4	2,28	3.400,00	7.758,58	2,27	2,28	2,32	2.213,00
05-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	24,44	3.100,00	75.754,39	24,23	24,68	25,61	24.626,00
05-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	24,53	4.000,00	98.120,03	24,23	24,68	25,61	24.626,00
05-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	BRML3	8,40	7.200,00	60.498,15	8,37	8,43	8,58	11.596,00
05-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	43,12	2.400,00	103.487,05	42,46	42,97	43,80	43.436,00
05-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	42,95	2.600,00	111.680,23	42,46	42,97	43,80	43.436,00
05-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,08	10.500,00	126.858,01	12,00	12,12	12,38	24.955,00
05-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	26,39	7.100,00	187.389,69	26,27	26,49	27,17	20.176,00
05-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	GOAU4	13,36	7.200,00	96.202,18	13,27	13,43	13,73	18.264,00
05-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,99	9.300,00	46.418,37	4,93	5,00	5,19	33.686,00
05-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	18,36	6.800,00	124.821,93	18,22	18,44	18,82	11.151,00
05-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	25,59	1.100,00	28.151,00	25,44	25,72	26,14	47.503,00
05-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	IREN3	20,99	4.600,00	96.573,37	20,57	21,12	22,02	55.401,00
05-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	11,98	3.800,00	45.535,62	11,85	12,07	12,44	23.857,00
05-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	ODPV3	8,45	2.000,00	16.909,00	8,37	8,46	8,68	3.024,00
05-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	ONCO3	7,46	3.400,00	25.370,24	7,40	7,47	7,73	2.674,00
05-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	PETRA	25,67	1.800,00	46.214,63	25,55	25,95	26,58	78.095,00
05-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	PETZ3	6,87	7.200,00	49.495,84	6,73	6,87	7,09	12.130,00
05-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	PETZ3	6,81	8.600,00	58.539,50	6,73	6,87	7,09	12.130,00
05-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	PRIO3	35,98	1.200,00	43.179,47	35,73	36,51	37,36	22.236,00
05-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	RDOR3	29,30	900,00	26.369,70	29,01	29,34	30,55	12.829,00
05-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	30,20	2.900,00	87.591,85	29,50	30,03	30,86	9.626,00
05-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	56,65	1.800,00	101.975,77	55,95	56,83	58,84	46.002,00
05-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	10,37	4.300,00	44.609,37	10,22	10,45	10,98	23.940,00
05-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	10,46	7.600,00	79.500,47	10,22	10,45	10,98	23.940,00
05-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	SULA11	21,12	500,00	10.559,52	20,91	21,17	22,01	9.032,00
05-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	52,27	3.300,00	172.504,08	51,31	51,94	52,71	28.343,00
05-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	15,69	7.600,00	119.218,37	15,61	15,81	16,24	22.535,00
05-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	10,86	3.600,00	39.082,35	10,62	10,83	11,24	12.318,00
05-12-22	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	MAXR11	77,20	254,00	19.608,80	75,50	76,79	77,85	102,00
06-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	17,22	3.100,00	53.391,38	17,04	17,22	17,41	4.340,00
06-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	BBA53	35,26	2.000,00	70.518,35	35,09	35,34	35,56	32.147,00
06-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	BBD4	14,95	1.600,00	23.923,20	14,75	14,87	15,15	32.540,00
06-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	BMGB4	2,26	4.600,00	10.398,00	2,25	2,26	2,30	2.188,00
06-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	24,37	3.100,00	75.541,28	24,06	24,52	24,99	36.556,00
06-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	BRML3	8,43	7.300,00	61.569,40	8,36	8,44	8,51	15.214,00



RELATÓRIO DE CONTROLE DE RISCO
E RENTABILIDADE - DEZEMBRO DE 2022



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE DEZEMBRO DE 2022 À 30 DE DEZEMBRO DE 2022

DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
06-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	11,98	10.700,00	128.229,66	11,83	12,06	12,30	19.361,00
06-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	26,40	7.200,00	190.054,93	26,22	26,46	26,71	19.053,00
06-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	GOAU4	13,58	6.600,00	89.647,92	13,38	13,58	13,78	21.479,00
06-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,94	4.300,00	21.248,70	4,85	4,95	5,06	36.876,00
06-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	IGT11	18,27	5.800,00	105.954,28	18,12	18,31	18,62	15.576,00
06-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	25,85	4.200,00	108.560,69	25,56	25,83	26,15	64.939,00
06-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	21,46	4.900,00	105.129,59	20,95	21,43	21,67	68.994,00
06-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	21,41	14.400,00	308.248,20	20,95	21,43	21,67	68.994,00
06-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	12,11	3.900,00	47.219,39	11,88	12,19	12,50	23.394,00
06-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	ODPV3	8,50	2.000,00	17.008,00	8,37	8,48	8,59	4.635,00
06-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	7,09	3.400,00	24.109,33	7,03	7,14	7,42	4.378,00
06-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	PETRA	25,58	1.800,00	46.045,31	25,42	25,78	26,39	122.154,00
06-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	6,87	12.300,00	84.558,01	6,74	6,93	7,09	14.744,00
06-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	35,22	1.200,00	42.266,03	33,90	35,22	36,67	37.326,00
06-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	29,02	900,00	26.116,65	28,40	28,99	29,50	10.980,00
06-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	29,10	2.900,00	84.379,93	28,61	29,47	30,37	13.452,00
06-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	10,33	3.000,00	31.001,16	10,20	10,38	10,53	25.980,00
06-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	10,22	5.200,00	53.163,98	10,20	10,38	10,53	25.980,00
06-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	10,37	22.200,00	230.212,33	10,20	10,38	10,53	25.980,00
06-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	SULA11	21,03	600,00	12.618,60	20,50	20,97	21,31	10.768,00
06-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	53,01	3.300,00	174.933,19	52,14	53,14	53,95	27.482,00
06-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	15,64	7.800,00	121.969,97	15,56	15,80	15,80	17.700,00
06-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	10,59	3.900,00	41.303,30	10,45	10,64	10,92	10.503,00
07-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	23,94	3.000,00	71.827,93	23,84	24,16	24,81	36.933,00
07-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	ENJU3	0,99	2.600,00	2.574,00	0,97	0,98	1,00	672,00
07-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	GOAU4	13,66	9.100,00	124.329,95	13,23	13,59	13,75	15.185,00
07-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	5,16	13.100,00	67.559,02	4,98	5,16	5,29	45.332,00
07-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	5,15	15.000,00	77.304,08	4,98	5,16	5,29	45.332,00
07-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	22,09	1.500,00	33.138,72	21,43	21,97	22,30	54.054,00
07-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	22,15	1.200,00	26.580,82	21,43	21,97	22,30	54.054,00
07-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	PETRA	25,38	3.800,00	96.447,27	25,27	25,69	26,07	72.161,00
07-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	PETRA	25,48	800,00	20.380,00	25,27	25,69	26,07	72.161,00
07-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	PETRA	25,52	6.700,00	170.964,55	25,27	25,69	26,07	72.161,00
07-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	PETRA	25,42	8.300,00	211.024,98	25,27	25,69	26,07	72.161,00
07-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	PETZ3	6,60	2.800,00	18.480,00	6,57	6,70	6,95	12.002,00
07-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	PETZ3	6,71	3.100,00	20.787,41	6,57	6,70	6,95	12.002,00
07-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	PETZ3	6,68	5.100,00	34.091,97	6,57	6,70	6,95	12.002,00
07-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	10,60	2.200,00	23.320,00	10,38	10,61	10,80	16.101,00
07-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	10,64	900,00	9.576,00	10,38	10,61	10,80	16.101,00
07-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	10,66	400,00	4.265,25	10,38	10,61	10,80	16.101,00
07-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	10,60	6.900,00	73.142,48	10,38	10,61	10,80	16.101,00
07-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	52,50	1.000,00	52.500,00	52,26	52,78	53,80	21.420,00
07-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	52,52	100,00	5.252,39	52,26	52,78	53,80	21.420,00
07-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	52,67	1.300,00	68.466,86	52,26	52,78	53,80	21.420,00
07-12-22	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	NEWL11	94,00	132,00	12.408,00	94,00	94,18	94,99	139,00
07-12-22	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	PATC11	69,60	277,00	19.279,20	69,60	69,78	70,78	52,00
08-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ELET3	43,57	27.500,00	1.198.075,00	42,75	43,22	43,91	23.948,00
08-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RRRP3	33,96	34.500,00	1.171.535,00	32,99	33,50	34,32	17.763,00
08-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	ALSO3	16,86	1.000,00	16.855,80	16,62	16,79	17,33	9.360,00
08-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	ALSO3	16,68	1.200,00	20.011,49	16,62	16,79	17,33	9.360,00
08-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,00	7.100,00	106.507,39	14,24	14,57	15,08	21.946,00
08-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	14,30	300,00	4.291,07	14,24	14,57	15,08	21.946,00
08-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,00	2.000,00	30.000,00	14,24	14,57	15,08	21.946,00
08-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	35,04	6.200,00	217.263,21	34,81	35,33	35,96	41.609,00
08-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	BMGB4	2,21	8.600,00	19.018,26	2,18	2,22	2,29	2.468,00
08-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	23,18	4.800,00	111.240,14	22,88	23,22	23,87	34.003,00
08-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	23,31	1.400,00	32.634,00	22,88	23,22	23,87	34.003,00
08-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	43,78	1.400,00	61.292,71	42,75	43,22	43,91	23.948,00
08-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	43,24	400,00	17.297,29	42,75	43,22	43,91	23.948,00
08-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	ENJU3	0,97	3.400,00	3.298,00	0,96	0,97	0,99	1.309,00
08-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	26,65	800,00	21.320,00	26,15	26,48	27,01	24.871,00
08-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	26,70	1.800,00	48.051,15	26,15	26,48	27,01	24.871,00
08-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	GOAU4	13,67	8.200,00	112.129,24	13,51	13,66	13,89	29.064,00
08-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,93	7.300,00	35.982,18	4,88	4,94	5,03	34.266,00
08-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	17,94	5.200,00	93.298,92	17,69	17,91	18,21	13.842,00
08-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	25,11	5.000,00	125.531,36	24,90	25,25	25,85	78.948,00
08-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	21,21	900,00	19.087,19	21,02	21,38	22,28	54.759,00
08-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	PETRA	25,43	5.200,00	132.238,16	24,64	25,13	25,79	66.783,00
08-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	PETRA	25,08	21.600,00	541.794,92	24,64	25,13	25,79	66.783,00
08-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	PETZ3	6,43	12.800,00	82.289,51	6,28	6,43	6,62	21.487,00
08-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	RDOR3	28,10	1.200,00	33.719,76	27,62	27,95	28,36	12.805,00
08-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	RDOR3	27,97	1.300,00	36.357,59	27,62	27,95	28,36	12.805,00
08-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	53,43	6.800,00	363.332,70	52,13	53,54	55,47	67.117,00
08-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	10,07	7.400,00	74.505,48	9,91	10,13	10,50	24.380,00
08-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	10,09	1.800,00	18.158,71	9,91	10,13	10,50	24.380,00
08-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	53,51	2.000,00	107.022,63	52,57	53,45	54,31	22.032,00
08-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	15,06	1.700,00	25.600,05	14,80	15,08	15,60	39.823,00
08-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	15,07	6.600,00	99.444,33	14,80	15,08	15,60	39.823,00
08-12-22	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	HBRH11	89,84	1.849,00	166.121,03	87,00	89,83	90,50	85,00
08-12-22	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	PATC11	67,88	1.086,00	73.719,99	65,01	67,38	69,20	536,00
09-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	ALSO3	16,63	400,00	6.651,25	16,50	16,66	17,00	5.902,00
09-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	34,97	5.600,00	195.854,28	34,59	34,96	35,18	24.219,00
09-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	BMGB4	2,14	3.200,00	6.836,70	2,08	2,14	2,24	3.198,00
09-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	22,95	2.500,00	57.385,39	22,68	23,09	23,52	27.327,00



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE DEZEMBRO DE 2022 À 30 DE DEZEMBRO DE 2022

DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
09-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	42,80	1.800,00	77.035,28	42,47	42,72	43,21	24.617,00
09-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	GOAU4	13,69	7.800,00	106.801,96	13,49	13,72	13,85	12.736,00
09-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	GOAU4	13,79	2.600,00	35.866,65	13,49	13,72	13,85	12.736,00
09-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	17,92	3.200,00	57.331,71	17,65	17,92	18,06	17.676,00
09-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	24,43	5.900,00	144.137,73	24,26	24,42	24,82	40.145,00
09-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	IREN3	20,84	4.100,00	85.437,66	20,64	20,95	21,33	26.377,00
09-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	ODPV3	8,53	3.400,00	28.993,58	8,48	8,57	8,72	5.827,00
09-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	ONCO3	6,38	700,00	4.465,67	6,31	6,43	6,71	3.120,00
09-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	PETRA	24,73	10.100,00	249.773,23	24,49	24,74	25,05	55.633,00
09-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	PETZ3	6,19	15.700,00	97.232,96	6,16	6,26	6,51	18.275,00
09-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	RDOR3	27,23	2.200,00	59.908,94	26,41	26,91	27,79	13.006,00
09-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	53,69	1.800,00	96.646,61	52,75	53,56	54,41	36.914,00
09-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	9,96	20.900,00	208.207,85	9,68	9,93	10,27	16.577,00
09-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	9,74	4.000,00	38.960,00	9,68	9,93	10,27	16.577,00
09-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	54,19	2.000,00	108.380,51	52,78	54,43	55,10	18.979,00
09-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	10,18	8.000,00	81.469,24	9,98	10,25	10,81	23.517,00
09-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	10,08	2.600,00	26.196,03	9,98	10,25	10,81	23.517,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	77,86	149,00	11.601,14	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	77,88	99,00	7.710,12	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	77,89	101,00	7.866,89	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	77,90	102,00	7.945,80	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	77,91	198,00	15.426,18	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	77,49	92,00	7.129,08	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	77,51	353,00	27.361,03	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	77,54	50,00	3.877,00	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	77,52	127,00	9.845,04	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	77,63	150,00	11.644,50	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	77,64	100,00	7.764,00	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	77,25	200,00	15.450,00	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	77,23	200,00	15.446,00	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	77,96	50,00	3.898,00	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	78,01	100,00	7.801,00	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	78,11	100,00	7.811,00	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	77,48	99,00	7.670,52	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	77,55	250,00	19.387,50	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	77,56	200,00	15.512,00	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	77,85	201,00	15.647,85	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	77,20	200,00	15.440,00	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	77,21	100,00	7.721,00	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	77,22	600,00	46.332,00	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	77,32	200,00	15.464,00	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	78,21	200,00	15.642,00	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	78,22	200,00	15.644,00	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	78,25	100,00	7.825,00	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	78,44	100,00	7.844,00	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	78,49	200,00	15.698,00	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	77,83	100,00	7.783,00	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	77,84	151,00	11.753,84	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	77,74	100,00	7.774,00	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	77,76	100,00	7.776,00	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	77,30	300,00	23.190,00	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	77,31	300,00	23.193,00	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	78,55	100,00	7.855,00	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	78,61	200,00	15.722,00	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	77,67	100,00	7.767,00	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	77,69	200,00	15.538,00	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	77,80	100,00	7.780,00	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	77,82	299,00	23.268,18	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	77,44	200,00	15.488,00	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	78,14	300,00	23.442,00	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	78,16	400,00	31.264,00	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	77,12	100,00	7.712,00	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	77,19	300,00	23.157,00	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	78,54	600,00	47.124,00	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	77,33	200,00	15.466,00	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	77,47	400,00	30.988,00	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	77,35	400,00	30.940,00	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	77,38	100,00	7.738,00	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	77,42	400,00	30.968,00	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	77,43	200,00	15.486,00	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	78,19	200,00	15.638,00	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	78,50	400,00	31.400,00	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	78,52	200,00	15.704,00	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	78,53	900,00	70.677,00	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	77,59	150,00	11.638,50	77,12	78,35	81,38	7.981,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	BRFS3	7,45	4.800,00	35.760,00	6,97	7,25	7,54	24.040,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	BRFS3	7,35	14.800,00	108.780,00	6,97	7,25	7,54	24.040,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	BRFS3	7,38	6.500,00	47.970,00	6,97	7,25	7,54	24.040,00



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL
Mês de Referência: 01 DE DEZEMBRO DE 2022 À 30 DE DEZEMBRO DE 2022

DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	BRFS3	7,39	10.100,00	74.639,00	6,97	7,25	7,54	24.040,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	BRFS3	7,40	30.000,00	222.000,00	6,97	7,25	7,54	24.040,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	BRFS3	7,41	8.400,00	62.244,00	6,97	7,25	7,54	24.040,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	BRFS3	7,43	9.100,00	67.613,00	6,97	7,25	7,54	24.040,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	BRFS3	7,42	7.200,00	53.424,00	6,97	7,25	7,54	24.040,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	BRFS3	7,37	6.700,00	49.379,00	6,97	7,25	7,54	24.040,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	BRFS3	7,30	1.800,00	13.140,00	6,97	7,25	7,54	24.040,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	BRFS3	7,32	2.800,00	20.496,00	6,97	7,25	7,54	24.040,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	BRFS3	7,33	8.800,00	64.504,00	6,97	7,25	7,54	24.040,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	BRFS3	7,34	7.700,00	56.518,00	6,97	7,25	7,54	24.040,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	BRFS3	7,36	3.800,00	27.968,00	6,97	7,25	7,54	24.040,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	BRFS3	7,31	1.600,00	11.696,00	6,97	7,25	7,54	24.040,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	BRFS3	7,49	5.500,00	41.195,00	6,97	7,25	7,54	24.040,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	BRFS3	7,50	5.800,00	43.500,00	6,97	7,25	7,54	24.040,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	BRFS3	7,48	3.200,00	23.936,00	6,97	7,25	7,54	24.040,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	BRFS3	7,47	3.600,00	26.892,00	6,97	7,25	7,54	24.040,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	BRFS3	7,29	200,00	1.458,00	6,97	7,25	7,54	24.040,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	BRFS3	7,46	1.400,00	10.444,00	6,97	7,25	7,54	24.040,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	BRFS3	7,44	7.200,00	53.568,00	6,97	7,25	7,54	24.040,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	41,96	300,00	12.588,00	41,25	41,69	42,46	16.317,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	41,64	600,00	24.984,00	41,25	41,69	42,46	16.317,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	41,66	1.200,00	49.992,00	41,25	41,69	42,46	16.317,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	41,68	800,00	33.344,00	41,25	41,69	42,46	16.317,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	41,69	600,00	25.014,00	41,25	41,69	42,46	16.317,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	41,61	1.400,00	58.254,00	41,25	41,69	42,46	16.317,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	41,80	400,00	16.720,00	41,25	41,69	42,46	16.317,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	41,81	200,00	8.362,00	41,25	41,69	42,46	16.317,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	41,55	1.300,00	54.015,00	41,25	41,69	42,46	16.317,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	41,65	1.300,00	54.145,00	41,25	41,69	42,46	16.317,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	41,63	800,00	33.304,00	41,25	41,69	42,46	16.317,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	41,75	400,00	16.700,00	41,25	41,69	42,46	16.317,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	41,72	600,00	25.032,00	41,25	41,69	42,46	16.317,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	41,51	600,00	24.906,00	41,25	41,69	42,46	16.317,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	41,50	200,00	8.300,00	41,25	41,69	42,46	16.317,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	41,59	1.500,00	62.385,00	41,25	41,69	42,46	16.317,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	41,58	1.600,00	66.528,00	41,25	41,69	42,46	16.317,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	41,71	800,00	33.368,00	41,25	41,69	42,46	16.317,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	41,73	1.200,00	50.076,00	41,25	41,69	42,46	16.317,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	41,57	1.400,00	58.198,00	41,25	41,69	42,46	16.317,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	41,56	1.800,00	74.808,00	41,25	41,69	42,46	16.317,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	41,84	200,00	8.368,00	41,25	41,69	42,46	16.317,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	41,94	200,00	8.388,00	41,25	41,69	42,46	16.317,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	41,92	300,00	12.576,00	41,25	41,69	42,46	16.317,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	41,60	400,00	16.640,00	41,25	41,69	42,46	16.317,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	41,77	200,00	8.354,00	41,25	41,69	42,46	16.317,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	41,90	100,00	4.190,00	41,25	41,69	42,46	16.317,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	41,52	200,00	8.304,00	41,25	41,69	42,46	16.317,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	41,62	400,00	16.648,00	41,25	41,69	42,46	16.317,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	41,87	200,00	8.374,00	41,25	41,69	42,46	16.317,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	41,93	300,00	12.579,00	41,25	41,69	42,46	16.317,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	41,95	100,00	4.195,00	41,25	41,69	42,46	16.317,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	41,74	600,00	25.044,00	41,25	41,69	42,46	16.317,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	41,79	200,00	8.358,00	41,25	41,69	42,46	16.317,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	42,00	200,00	8.400,00	41,25	41,69	42,46	16.317,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	41,91	600,00	25.146,00	41,25	41,69	42,46	16.317,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	41,67	600,00	25.002,00	41,25	41,69	42,46	16.317,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	41,70	600,00	25.020,00	41,25	41,69	42,46	16.317,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	41,76	600,00	25.056,00	41,25	41,69	42,46	16.317,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	41,97	200,00	8.394,00	41,25	41,69	42,46	16.317,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	41,78	700,00	29.246,00	41,25	41,69	42,46	16.317,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	41,85	200,00	8.370,00	41,25	41,69	42,46	16.317,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	41,83	400,00	16.732,00	41,25	41,69	42,46	16.317,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	41,86	400,00	16.744,00	41,25	41,69	42,46	16.317,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	41,89	200,00	8.378,00	41,25	41,69	42,46	16.317,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	LEN3	20,25	1.000,00	20.250,00	19,99	20,35	21,10	43.095,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	LEN3	20,27	200,00	4.054,00	19,99	20,35	21,10	43.095,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	LEN3	20,32	380,00	7.721,60	19,99	20,35	21,10	43.095,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	LEN3	20,31	700,00	14.217,00	19,99	20,35	21,10	43.095,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	LEN3	20,33	299,00	6.078,67	19,99	20,35	21,10	43.095,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	LEN3	20,23	300,00	6.069,00	19,99	20,35	21,10	43.095,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	LEN3	20,24	900,00	18.216,00	19,99	20,35	21,10	43.095,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	LEN3	20,26	600,00	12.156,00	19,99	20,35	21,10	43.095,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	LEN3	20,28	1.400,00	28.392,00	19,99	20,35	21,10	43.095,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	LEN3	20,29	200,00	4.058,00	19,99	20,35	21,10	43.095,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	LEN3	20,30	1.700,00	34.510,00	19,99	20,35	21,10	43.095,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	LEN3	20,52	200,00	4.104,00	19,99	20,35	21,10	43.095,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	LEN3	20,53	200,00	4.106,00	19,99	20,35	21,10	43.095,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	LEN3	20,54	600,00	12.324,00	19,99	20,35	21,10	43.095,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	LEN3	20,56	100,00	2.056,00	19,99	20,35	21,10	43.095,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	LEN3	20,60	400,00	8.240,00	19,99	20,35	21,10	43.095,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	LEN3	20,22	400,00	8.088,00	19,99	20,35	21,10	43.095,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	LEN3	20,42	200,00	4.084,00	19,99	20,35	21,10	43.095,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	LEN3	20,43	600,00	12.258,00	19,99	20,35	21,10	43.095,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	LEN3	20,44	200,00	4.088,00	19,99	20,35	21,10	43.095,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	LEN3	20,46	400,00	8.184,00	19,99	20,35	21,10	43.095,00



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE DEZEMBRO DE 2022 À 30 DE DEZEMBRO DE 2022

DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	LREN3	20,47	400,00	8.188,00	19,99	20,35	21,10	43.095,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	LREN3	20,49	400,00	8.196,00	19,99	20,35	21,10	43.095,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	LREN3	20,35	550,00	11.192,50	19,99	20,35	21,10	43.095,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	LREN3	20,36	650,00	13.234,00	19,99	20,35	21,10	43.095,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	LREN3	20,37	200,00	4.074,00	19,99	20,35	21,10	43.095,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	LREN3	20,38	371,00	7.560,98	19,99	20,35	21,10	43.095,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	LREN3	20,39	200,00	4.078,00	19,99	20,35	21,10	43.095,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	LREN3	20,41	200,00	4.082,00	19,99	20,35	21,10	43.095,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	LREN3	20,34	650,00	13.221,00	19,99	20,35	21,10	43.095,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	LREN3	20,45	200,00	4.090,00	19,99	20,35	21,10	43.095,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	LWSA3	7,30	75.900,00	554.070,00	7,15	7,37	7,64	14.063,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,62	1.000,00	22.620,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,83	650,00	14.839,50	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,88	800,00	18.304,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,67	701,00	15.891,67	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,66	98,00	2.220,68	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,65	200,00	4.530,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,64	681,00	15.417,84	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,63	800,00	18.104,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,92	1.000,00	22.920,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,91	200,00	4.582,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,90	400,00	9.160,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,80	400,00	9.120,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,70	499,00	11.327,30	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,89	500,00	11.445,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,74	650,00	14.781,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,73	600,00	13.638,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,72	400,00	9.088,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,95	2.200,00	50.490,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,94	100,00	2.294,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,93	800,00	18.344,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	23,00	1.200,00	27.600,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,99	400,00	9.196,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,98	200,00	4.596,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,97	600,00	13.782,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,96	800,00	18.368,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,75	250,00	5.687,50	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	23,07	400,00	9.228,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	23,06	200,00	4.612,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	23,04	400,00	9.216,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	23,03	200,00	4.606,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	23,02	200,00	4.604,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	23,01	200,00	4.602,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,48	1.000,00	22.480,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,87	700,00	16.009,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,86	1.000,00	22.860,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,85	570,00	13.024,50	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,84	800,00	18.272,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	23,08	200,00	4.616,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,57	600,00	13.542,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,56	999,00	22.537,44	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,53	400,00	9.012,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,51	1.200,00	27.012,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,50	800,00	18.000,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,49	400,00	8.996,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,69	1.052,00	23.869,88	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,68	701,00	15.898,68	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,61	1.000,00	22.610,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,60	400,00	9.040,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,59	600,00	13.554,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,58	600,00	13.548,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,44	400,00	4.488,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,42	400,00	8.968,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,41	200,00	4.482,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,40	200,00	4.480,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,39	200,00	4.478,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,71	399,00	9.061,29	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,79	100,00	2.279,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,77	100,00	2.277,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,47	600,00	13.482,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,46	200,00	4.492,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,45	200,00	4.490,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,76	400,00	9.104,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,82	300,00	6.846,00	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	22,81	450,00	10.264,50	22,38	22,87	23,62	24.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	55,22	300,00	16.566,00	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	55,24	200,00	11.048,00	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	55,25	200,00	11.050,00	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	55,26	200,00	11.052,00	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	55,14	150,00	8.271,00	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	55,16	100,00	5.516,00	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	55,18	100,00	5.518,00	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	55,23	200,00	11.046,00	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	55,19	599,00	33.058,81	54,15	54,91	55,46	21.638,00



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE DEZEMBRO DE 2022 À 30 DE DEZEMBRO DE 2022

DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	55,21	500,00	27.605,00	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	55,06	250,00	13.765,00	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	55,09	100,00	5.509,00	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	55,10	50,00	2.755,00	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	55,11	200,00	11.022,00	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	55,12	100,00	5.512,00	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	55,13	50,00	2.756,50	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	54,96	100,00	5.496,00	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	54,97	300,00	16.491,00	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	54,98	100,00	5.498,00	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	54,99	200,00	10.998,00	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	55,00	100,00	5.500,00	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	55,04	100,00	5.504,00	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	55,33	900,00	49.797,00	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	55,34	200,00	11.068,00	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	55,35	500,00	27.675,00	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	55,36	100,00	5.536,00	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	54,94	100,00	5.494,00	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	54,95	99,00	5.440,05	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	54,89	600,00	32.934,00	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	54,91	400,00	21.964,00	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	54,93	403,00	22.136,79	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	55,29	100,00	5.529,00	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	55,30	600,00	33.180,00	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	55,32	200,00	11.064,00	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	54,82	200,00	10.964,00	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	54,83	300,00	16.449,00	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	54,84	400,00	21.936,00	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	54,85	200,00	10.970,00	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	54,86	300,00	16.458,00	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	54,87	300,00	16.461,00	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	54,74	200,00	10.948,00	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	54,75	100,00	5.475,00	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	54,76	300,00	16.428,00	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	54,77	400,00	21.908,00	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	54,79	200,00	10.958,00	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	54,81	599,00	32.831,19	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	55,27	600,00	33.162,00	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	55,28	200,00	11.056,00	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	54,68	400,00	21.872,00	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	54,71	100,00	5.471,00	54,15	54,91	55,46	21.638,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	85,93	900,00	77.337,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	86,04	600,00	51.624,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	86,06	200,00	17.212,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	86,07	200,00	17.214,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	86,19	600,00	51.714,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	86,20	600,00	51.720,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	86,22	800,00	68.976,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	86,10	200,00	17.220,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	86,11	200,00	17.222,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	86,12	400,00	34.448,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	86,13	800,00	68.904,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	86,03	900,00	77.427,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	86,15	200,00	17.230,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	85,66	200,00	17.132,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	85,69	400,00	34.276,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	85,70	800,00	68.560,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	85,73	500,00	42.865,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	85,71	600,00	51.426,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	86,08	200,00	17.216,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	86,35	200,00	17.270,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	86,41	200,00	17.282,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	86,42	200,00	17.284,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	86,43	400,00	34.572,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	86,45	200,00	17.290,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	86,47	200,00	17.294,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	85,88	700,00	60.116,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	85,87	1.199,00	102.958,13	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	86,30	400,00	34.520,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	86,31	300,00	25.893,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	86,33	200,00	17.266,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	86,34	400,00	34.536,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	85,81	800,00	68.648,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	85,82	600,00	51.492,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	85,83	400,00	34.332,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	85,84	400,00	34.336,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	85,85	700,00	60.095,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	86,02	513,00	44.128,26	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	85,67	400,00	34.268,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	85,78	1.000,00	85.780,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	85,79	1.600,00	137.264,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	86,09	300,00	25.827,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	86,16	400,00	34.464,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	85,80	1.600,00	137.280,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE DEZEMBRO DE 2022 À 30 DE DEZEMBRO DE 2022

DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	86,27	200,00	17.254,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	86,28	200,00	17.256,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	86,29	300,00	25.887,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	85,77	1.000,00	85.770,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	85,86	2.800,00	240.408,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	86,37	200,00	17.274,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	86,23	600,00	51.738,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	86,26	400,00	34.504,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	86,24	400,00	34.496,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	86,25	200,00	17.250,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	85,74	200,00	17.148,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	85,76	600,00	51.456,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	85,91	2.738,00	235.221,58	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	85,95	701,00	60.250,95	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	85,96	450,00	38.682,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	85,92	900,00	77.328,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	85,97	500,00	42.985,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	85,98	100,00	8.598,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	85,94	1.199,00	103.042,06	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	86,00	1.200,00	103.200,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	85,99	300,00	25.797,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	86,01	600,00	51.606,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	85,89	1.400,00	120.246,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	85,90	1.600,00	137.440,00	85,38	86,31	88,30	101.778,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	ALSO3	16,20	2.400,00	38.872,10	15,95	16,26	16,73	12.164,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	33,65	15.900,00	534.991,94	33,21	33,73	35,39	62.469,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	BMGB4	2,09	14.100,00	29.410,98	2,02	2,07	2,15	3.271,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	21,83	21.600,00	471.510,94	21,51	21,89	23,23	54.826,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	41,55	3.500,00	145.420,29	40,53	41,56	43,16	49.689,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	ENJU3	0,94	3.900,00	3.676,59	0,92	0,93	0,97	1.528,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	GOAU4	13,48	11.400,00	153.633,42	13,30	13,50	13,80	12.903,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,52	7.800,00	35.263,32	4,45	4,53	4,78	44.890,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	24,02	8.300,00	199.369,83	23,69	24,03	24,50	97.545,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	ODPV3	8,31	4.400,00	36.543,25	8,21	8,31	8,50	6.535,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	ONCO3	6,26	200,00	1.251,18	6,00	6,13	6,37	4.773,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	PETZ3	5,90	22.900,00	135.211,93	5,78	5,92	6,27	32.817,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	RDOR3	25,20	3.800,00	95.755,94	24,95	25,30	26,58	20.780,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	51,47	1.500,00	77.207,22	50,85	51,60	53,40	47.507,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	9,53	20.800,00	198.250,11	9,31	9,56	9,98	19.210,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	9,66	9.300,00	89.868,43	9,42	9,71	10,29	25.378,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	32,64	6.500,00	212.129,39	31,86	32,58	33,95	65.225,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	21,19	5.200,00	110.186,32	20,71	21,31	22,28	40.633,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	ENJU3	0,93	6.200,00	5.778,14	0,90	0,93	0,98	2.529,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	23,49	12.600,00	295.941,57	23,12	23,55	24,34	118.343,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	ODPV3	8,34	3.300,00	27.517,30	8,21	8,34	8,54	6.705,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	PETZ3	6,16	7.800,00	48.074,54	5,98	6,18	6,37	36.522,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	50,39	2.900,00	146.125,92	49,18	50,62	52,99	42.865,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	9,39	17.000,00	159.565,26	9,13	9,41	9,86	20.380,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	51,96	3.800,00	197.462,81	51,12	52,23	55,07	47.246,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	9,89	5.500,00	54.389,06	9,54	9,95	10,37	20.819,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	13,91	2.000,00	27.823,18	13,71	13,99	14,22	14.678,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	14,00	7.700,00	107.777,56	13,71	13,99	14,22	14.678,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	13,92	2.900,00	40.360,97	13,71	13,99	14,22	14.678,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	14,10	3.700,00	52.169,17	13,71	13,99	14,22	14.678,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	30,82	900,00	27.733,50	30,25	30,85	31,57	113.012,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	BRML3	7,81	5.000,00	39.048,67	7,64	7,78	7,96	27.152,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	41,35	4.100,00	169.543,82	40,24	41,33	42,03	59.297,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	11,39	7.300,00	83.134,52	11,07	11,38	11,59	40.741,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	ENJU3	0,90	4.300,00	3.854,56	0,88	0,89	0,92	1.773,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	26,19	4.900,00	128.325,53	25,51	26,10	26,50	39.891,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,47	14.000,00	62.635,32	4,21	4,42	4,58	57.819,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,54	4.000,00	18.160,00	4,21	4,42	4,58	57.819,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,52	18.800,00	85.017,61	4,21	4,42	4,58	57.819,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	16,86	5.500,00	92.710,76	16,47	16,93	17,48	33.177,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	16,98	3.300,00	56.019,19	16,47	16,93	17,48	33.177,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	IREN3	19,95	2.000,00	39.901,28	19,14	19,93	20,76	62.610,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	10,67	3.600,00	38.421,94	10,40	10,65	10,89	35.074,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	ODPV3	8,23	12.700,00	104.523,36	8,17	8,24	8,36	6.242,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	PETRA	21,26	2.800,00	59.514,32	20,77	21,54	22,60	316.416,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	35,67	900,00	32.102,75	34,70	35,71	36,57	60.127,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	RDOR3	24,10	1.000,00	24.103,26	23,39	24,81	25,96	32.333,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	28,14	2.000,00	56.284,40	27,67	28,23	28,75	13.234,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	49,93	3.300,00	164.780,60	48,35	49,67	50,76	58.974,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	9,05	4.800,00	43.448,84	8,86	9,08	9,29	27.069,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	52,28	3.800,00	198.666,65	51,50	52,47	53,43	39.917,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	14,14	4.500,00	63.619,48	13,82	14,17	14,62	43.067,00
12-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	9,62	5.700,00	54.814,08	9,41	9,66	9,96	16.699,00
12-12-22	FIA RVA EMB IV	Venda	PRI03	35,21	19.380,00	682.369,80	34,70	35,71	36,57	60.127,00
12-12-22	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	NEWL11	91,09	237,00	21.587,28	89,50	90,37	92,50	199,00
12-12-22	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	XPPR11	33,61	1.891,00	63.549,49	33,39	33,75	34,18	2.910,00
12-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ABEV3	15,13	6.860,00	103.791,80	14,72	14,99	15,22	74.036,00
12-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ALPA4	14,30	320,00	4.576,00	13,00	13,85	14,47	22.617,00
12-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	AMER3	8,14	930,00	7.570,20	7,75	8,01	8,29	35.085,00
12-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ARZ3	74,50	90,00	6.705,00	72,86	74,30	75,79	14.873,00



RELATÓRIO DE CONTROLE DE RISCO
E RENTABILIDADE - DEZEMBRO DE 2022



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE DEZEMBRO DE 2022 À 30 DE DEZEMBRO DE 2022



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ASAI3	19,07	1.460,00	27.842,20	18,32	18,79	19,17	29.725,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	AZUL4	10,18	510,00	5.191,80	9,90	10,18	10,46	21.003,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	B3SA3	11,78	9.220,00	108.611,60	11,03	11,52	11,95	89.363,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBA53	31,07	2.220,00	68.975,40	30,25	30,85	31,57	113.012,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBDC3	12,49	2.360,00	29.476,40	12,03	12,34	12,61	21.427,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBDC4	14,01	8.060,00	112.920,60	13,44	13,88	14,15	102.908,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBSE3	31,51	1.050,00	33.085,50	30,01	31,32	31,76	37.103,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BEEF3	12,06	410,00	4.944,60	11,66	11,94	12,11	29.175,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BPAC11	21,41	1.920,00	41.107,20	20,05	20,86	21,78	64.551,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BPAN4	5,91	530,00	3.132,30	5,60	5,79	5,96	16.298,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRAP4	29,47	390,00	11.493,30	28,99	29,29	29,55	14.184,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRFS3	7,14	1.680,00	11.995,20	6,92	7,08	7,27	30.581,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRKM5	25,20	410,00	10.332,00	24,48	25,01	25,42	12.654,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRML3	7,86	1.290,00	10.139,40	7,64	7,78	7,96	27.152,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CASH3	1,22	1.030,00	1.256,60	1,11	1,16	1,22	21.501,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CCRO3	10,35	1.740,00	18.009,00	10,08	10,33	10,54	30.961,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CIEL3	4,58	1.710,00	7.831,80	4,22	4,45	4,67	37.088,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CMIG4	10,57	2.250,00	23.782,50	10,22	10,45	10,67	28.648,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CMIN3	3,89	1.740,00	6.768,60	3,74	3,84	3,94	16.853,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	COGN3	2,07	2.840,00	5.878,80	1,90	2,00	2,10	34.675,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CPFE3	30,26	290,00	8.775,40	29,56	30,13	30,68	17.664,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CPL66	7,42	2.440,00	18.104,80	7,11	7,28	7,49	26.129,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CRFB3	14,57	830,00	12.093,10	14,15	14,45	14,69	22.315,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CSAN3	15,90	1.830,00	29.097,00	15,55	15,79	16,02	32.596,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CSNA3	14,36	920,00	13.211,20	13,72	14,04	14,41	21.395,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CVCB3	4,15	430,00	1.784,50	4,06	4,15	4,27	16.287,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CYRE3	12,50	430,00	5.375,00	11,58	12,08	12,73	31.316,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	DXCO3	7,36	430,00	3.164,80	7,12	7,31	7,47	18.945,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ECOR3	4,05	520,00	2.106,00	3,91	4,01	4,10	12.274,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	EGIE3	37,10	400,00	14.840,00	36,46	36,97	37,47	17.964,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ELET3	41,82	2.260,00	94.513,20	40,24	41,33	42,03	59.297,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ELET6	44,00	440,00	19.360,00	42,88	43,67	44,46	15.700,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	EMBR3	13,89	1.150,00	15.973,50	13,20	13,69	14,03	21.444,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ENBR3	19,66	380,00	7.470,80	19,16	19,49	19,92	14.056,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ENEV3	11,50	2.440,00	28.060,00	11,07	11,38	11,59	40.741,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ENGI11	41,55	390,00	16.204,50	40,62	41,35	42,16	18.388,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	EQLT3	26,20	1.720,00	45.064,00	25,51	26,10	26,50	39.891,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	EZTC3	13,54	150,00	2.031,00	13,00	13,30	13,67	12.695,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	FLRY3	15,48	580,00	8.978,40	14,52	15,04	15,68	27.158,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	GGBR4	31,12	1.740,00	54.148,80	30,40	30,85	31,17	36.382,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	GOAU4	13,60	1.070,00	14.552,00	13,25	13,48	13,64	22.169,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	GOLL4	6,93	300,00	2.079,00	6,88	7,04	7,38	18.334,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	HAPV3	4,54	6.960,00	31.598,40	4,21	4,42	4,58	57.819,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	HYPE3	41,69	630,00	26.264,70	40,55	41,33	41,96	31.716,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	IGTI11	17,32	340,00	5.888,80	16,47	16,93	17,48	33.177,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	IRBR3	0,70	3.840,00	2.688,00	0,68	0,70	0,72	28.205,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ITSA4	7,99	8.140,00	65.038,60	7,72	7,90	8,07	57.090,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ITUB4	23,29	7.500,00	174.675,00	22,62	23,10	23,57	89.322,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	JBSS3	20,52	1.770,00	36.320,40	20,03	20,44	20,76	31.672,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	KLBN11	20,63	1.100,00	22.693,00	20,31	20,58	20,87	28.596,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	LENR3	20,45	1.520,00	31.084,00	19,14	19,93	20,76	62.610,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	LWSA3	7,08	660,00	4.672,80	6,84	7,06	7,31	24.910,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	MGLU3	2,63	4.490,00	11.808,70	2,57	2,63	2,77	67.305,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	MRFG3	7,16	490,00	3.508,40	7,01	7,11	7,29	25.741,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	MRVE3	7,60	470,00	3.572,00	7,19	7,42	7,69	22.971,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	MULT3	20,30	420,00	8.526,00	19,46	19,97	20,57	28.005,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	NTCO3	10,66	1.310,00	13.964,60	10,40	10,65	10,89	35.074,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PCAR3	17,48	250,00	4.370,00	16,65	17,15	17,56	12.315,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PETR3	24,29	4.200,00	102.018,00	23,61	24,55	26,36	104.687,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PETRA	21,47	7.140,00	153.295,80	20,77	21,54	22,60	316.416,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PETZ3	6,29	520,00	3.270,80	5,82	6,06	6,34	23.702,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PRIO3	36,18	1.310,00	47.395,80	34,70	35,71	36,57	60.127,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	QUAL3	5,29	430,00	2.274,70	4,86	5,18	5,35	22.473,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RADL3	22,24	1.870,00	41.588,80	21,86	22,20	22,65	33.032,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RAIL3	16,91	1.900,00	32.129,00	16,21	16,73	17,11	31.537,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RAIZ4	3,34	1.950,00	6.513,00	3,19	3,26	3,37	29.703,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RDOR3	25,47	1.460,00	37.186,20	23,39	24,81	25,96	32.333,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RENT3	50,22	1.400,00	70.308,00	48,35	49,67	50,76	58.974,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RRRP3	33,50	310,00	10.385,00	33,09	33,60	34,53	21.905,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SANB11	25,77	560,00	14.431,20	25,57	25,79	26,01	15.152,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SBSF3	55,04	530,00	29.171,20	52,92	54,24	55,14	25.546,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SLCE3	44,88	150,00	6.732,00	41,94	44,17	45,28	14.291,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SMTQ3	23,28	220,00	5.121,60	22,75	23,30	24,11	18.885,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SOMA3	9,17	770,00	7.060,90	8,86	9,08	9,29	27.069,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SULA11	19,09	440,00	8.399,60	17,57	18,67	19,27	20.806,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SUZB3	52,50	1.100,00	59.850,00	51,50	52,47	53,43	39.917,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	TAE11	33,27	340,00	11.311,80	32,51	33,21	33,92	29.799,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	TIMS3	12,66	1.260,00	15.951,60	12,23	12,47	12,74	24.226,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	TOTS3	26,18	810,00	21.205,80	25,11	25,79	26,49	38.042,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	UGPA3	12,38	1.700,00	21.046,00	12,00	12,34	12,59	36.687,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	USIM5	7,86	800,00	6.288,00	7,32	7,60	7,93	28.763,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VALE3	86,89	7.110,00	617.787,90	85,50	86,68	87,33	94.686,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VBBR3	14,37	1.740,00	25.003,80	13,82	14,17	14,62	43.667,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VIIA3	1,98	2.460,00	4.870,80	1,92	1,98	2,05	37.675,00



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL
Mês de Referência: 01 DE DEZEMBRO DE 2022 À 30 DE DEZEMBRO DE 2022

DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VIVT3	37,38	670,00	25.044,60	36,40	37,14	37,78	17.708,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	WEGE3	37,06	2.320,00	85.979,20	35,66	36,85	37,46	40.468,00
14-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	YDUQ3	9,81	460,00	4.512,60	9,41	9,66	9,96	16.699,00
15-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	EQLT3	26,06	13.500,00	351.839,53	25,76	26,06	26,43	29.013,00
15-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	21,59	2.400,00	51.824,88	20,80	21,57	21,96	42.618,00
15-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,62	16.000,00	73.958,86	4,42	4,60	4,69	41.184,00
15-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	17,73	400,00	7.093,11	16,97	17,71	18,10	20.212,00
15-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	10,54	4.700,00	49.544,35	10,26	10,53	10,94	22.174,00
15-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	ODPV3	8,46	22.600,00	191.172,50	8,28	8,54	8,65	6.855,00
15-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	ODPV3	8,57	17.800,00	152.562,05	8,28	8,54	8,65	6.855,00
15-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	RDOR3	25,87	1.300,00	33.633,11	24,75	25,71	26,31	16.855,00
15-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	50,74	1.000,00	50.741,82	49,25	50,77	51,64	49.498,00
15-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	51,98	3.300,00	171.541,30	51,00	51,70	52,63	20.433,00
15-12-22	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	BMMLC11	102,99	3.301,00	339.968,88	101,88	102,98	103,00	4,00
15-12-22	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	HBRH11	85,97	147,00	12.637,20	84,14	85,96	86,62	10,00
15-12-22	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	NEWU11	40,26	90,00	3.623,40	36,00	39,77	40,26	73,00
15-12-22	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	PATC11	68,01	491,00	33.393,69	66,00	67,55	68,09	51,00
15-12-22	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	QAGR11	43,17	244,00	10.533,48	42,14	42,69	43,20	630,00
16-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	20,90	4.900,00	102.411,54	20,70	20,88	21,54	37.926,00
16-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	40,78	2.100,00	85.630,53	40,29	40,86	41,69	54.926,00
16-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	ENJU3	0,88	3.800,00	3.344,00	0,87	0,88	0,91	1.521,00
16-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	16,99	4.900,00	83.231,56	16,68	16,93	17,84	19.323,00
16-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	17,00	1.200,00	20.400,00	16,68	16,93	17,84	19.323,00
16-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	LTRE3	19,35	1.800,00	34.831,05	19,21	19,48	20,18	31.632,00
16-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	9,85	4.500,00	44.328,79	9,73	9,90	10,39	37.686,00
16-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	9,91	2.400,00	23.786,10	9,73	9,90	10,39	37.686,00
16-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	ODPV3	8,48	5.700,00	48.336,00	8,44	8,50	8,59	3.434,00
16-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	ODPV3	8,51	17.100,00	145.491,00	8,44	8,50	8,59	3.434,00
16-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	PETZ3	5,99	10.100,00	60.452,70	5,87	6,01	6,21	16.669,00
16-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	PETZ3	5,92	5.200,00	30.759,93	5,87	6,01	6,21	16.669,00
16-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	49,53	1.700,00	84.197,62	49,12	49,63	50,57	29.032,00
16-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	9,02	3.500,00	31.564,46	8,86	8,98	9,14	14.628,00
16-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	51,36	2.600,00	133.530,59	51,16	51,45	52,22	17.135,00
16-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	5,32	13.160,00	70.006,86	5,15	5,26	5,44	18.900,00
16-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	5,24	1.157,00	6.064,64	5,15	5,26	5,44	18.900,00
16-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	5,25	3.472,00	18.242,67	5,15	5,26	5,44	18.900,00
16-12-22	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	BMMLC11	102,57	2,00	205,14	93,00	102,79	103,00	5,00
16-12-22	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	NEWL11	92,60	200,00	18.520,00	91,22	91,83	92,74	142,00
16-12-22	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	QAGR11	42,84	523,00	22.405,32	42,17	42,77	43,68	579,00
19-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	14,52	2.000,00	29.030,00	14,28	14,53	14,71	10.905,00
19-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	14,54	3.800,00	55.255,32	14,28	14,53	14,71	10.905,00
19-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	14,57	4.700,00	68.456,61	14,28	14,53	14,71	10.905,00
19-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	32,96	500,00	16.480,07	32,51	32,94	33,45	44.625,00
19-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	BBDC4	14,20	1.600,00	22.727,20	13,85	14,14	14,30	47.326,00
19-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	BRML3	7,87	3.300,00	25.985,32	7,75	7,87	7,99	23.618,00
19-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	BRML3	7,87	2.600,00	20.457,39	7,75	7,87	7,99	23.618,00
19-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	41,90	3.100,00	129.892,30	41,08	41,71	42,25	35.308,00
19-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	41,57	1.100,00	45.729,37	41,08	41,71	42,25	35.308,00
19-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	11,43	4.700,00	53.710,03	11,15	11,37	11,57	17.232,00
19-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	ENJU3	0,89	1.000,00	890,00	0,88	0,93	0,97	1.580,00
19-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	26,65	3.200,00	85.277,09	26,14	26,58	26,92	19.585,00
19-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,62	10.100,00	46.637,79	4,46	4,59	4,68	26.072,00
19-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,59	700,00	3.213,63	4,46	4,59	4,68	26.072,00
19-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	17,43	2.900,00	50.540,34	16,86	17,45	17,71	13.723,00
19-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	24,30	2.500,00	60.742,65	23,65	24,17	24,48	64.896,00
19-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	LTRE3	20,42	1.900,00	38.793,13	19,52	20,20	20,60	51.065,00
19-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	NINJ3	2,78	200,00	555,80	2,72	2,82	2,96	705,00
19-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	10,28	3.700,00	38.050,93	9,60	9,97	10,38	26.427,00
19-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	ONCO3	6,55	4.000,00	26.185,02	6,25	6,50	6,90	10.142,00
19-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	ONCO3	6,39	2.700,00	17.245,15	6,25	6,50	6,90	10.142,00
19-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	35,71	500,00	17.853,08	35,16	35,51	35,85	22.672,00
19-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	35,71	1.600,00	57.131,76	35,16	35,51	35,85	22.672,00
19-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	35,76	4.400,00	157.338,38	35,16	35,51	35,85	22.672,00
19-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	RDOR3	25,71	3.800,00	97.681,31	24,92	25,73	26,51	17.883,00
19-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	27,65	1.300,00	35.945,26	27,30	27,84	28,66	6.760,00
19-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	51,15	2.000,00	102.297,31	49,19	51,35	51,99	40.705,00
19-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	51,75	600,00	31.048,86	49,19	51,35	51,99	40.705,00
19-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	SULA11	19,60	800,00	15.680,98	18,55	19,30	19,88	14.624,00
19-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	49,44	5.500,00	271.914,78	48,33	49,26	50,34	21.545,00
19-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	14,83	4.700,00	69.683,17	14,40	14,74	14,90	26.731,00
19-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	5,54	947,00	5.246,38	5,21	5,44	5,60	14.898,00
19-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	5,52	2.136,00	11.788,98	5,21	5,44	5,60	14.898,00
19-12-22	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	QAGR11	42,36	371,00	15.716,20	41,58	42,32	43,23	899,00
19-12-22	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	TEPP11	66,39	278,00	18.456,42	65,13	66,35	69,61	1.833,00
20-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	16,65	1.400,00	23.313,50	15,85	16,56	16,86	7.889,00
20-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	14,49	3.000,00	43.455,29	14,26	14,50	14,76	12.902,00
20-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	33,86	5.100,00	172.684,23	32,63	33,78	34,16	47.223,00
20-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	BBDC4	14,81	7.200,00	106.615,40	14,13	14,75	14,97	84.009,00
20-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	BRML3	8,22	2.100,00	17.263,41	7,85	8,17	8,31	16.423,00
20-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	42,45	1.300,00	55.187,71	41,30	42,38	43,15	26.351,00
20-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	11,77	3.100,00	36.480,20	11,31	11,75	11,98	28.529,00
20-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	26,83	2.100,00	56.342,41	26,37	26,94	27,50	28.942,00
20-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,89	3.200,00	15.660,61	4,48	4,86	5,00	37.017,00
20-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	IGT11	17,90	4.600,00	82.331,11	17,20	17,86	18,08	16.989,00



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL
Mês de Referência: 01 DE DEZEMBRO DE 2022 À 30 DE DEZEMBRO DE 2022

DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
20-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	24,69	2.800,00	69.118,01	24,29	24,79	25,19	63.504,00
20-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	24,66	1.400,00	34.521,69	24,29	24,79	25,19	63.504,00
20-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	LTRE3	21,41	1.300,00	27.827,86	20,03	21,48	22,03	58.974,00
20-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	NINI3	2,92	200,00	584,56	2,72	2,88	2,96	509,00
20-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	11,20	1.200,00	13.436,58	10,05	11,14	11,70	39.337,00
20-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	PETZ3	6,56	2.300,00	15.089,47	6,13	6,69	6,98	20.596,00
20-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	PETZ3	6,59	3.100,00	20.443,00	6,13	6,69	6,98	20.596,00
20-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	35,82	2.400,00	85.969,46	35,40	35,86	36,19	28.482,00
20-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	35,67	300,00	10.701,00	35,40	35,86	36,19	28.482,00
20-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	35,86	500,00	17.930,00	35,40	35,86	36,19	28.482,00
20-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	27,64	1.500,00	41.465,44	25,97	27,50	28,30	21.903,00
20-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	28,69	800,00	22.955,04	27,40	28,57	29,28	8.286,00
20-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	54,16	900,00	48.746,42	51,03	54,03	55,00	52.400,00
20-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	48,32	5.400,00	260.931,70	47,86	48,34	49,58	40.045,00
20-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	TEND3	4,43	2.400,00	10.628,00	3,97	4,40	4,61	4.840,00
20-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	15,11	2.400,00	36.273,18	14,47	15,13	15,39	37.077,00
20-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	10,18	2.200,00	22.401,08	9,75	10,15	10,43	9.981,00
20-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	B3SA3	12,66	7.795,00	98.662,22	11,91	12,57	12,81	95.060,00
20-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	B3SA3	12,70	9.240,00	117.356,21	11,91	12,57	12,81	95.060,00
20-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	B3SA3	12,47	6.600,00	82.274,89	11,91	12,57	12,81	95.060,00
20-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	B3SA3	12,50	9.744,00	121.775,53	11,91	12,57	12,81	95.060,00
20-12-22	FIA RVA EMB IV	Venda	ELET3	42,23	16.507,00	697.010,16	41,30	42,38	43,15	26.351,00
20-12-22	FIA RVA EMB IV	Venda	ELET3	42,06	909,00	38.233,82	41,30	42,38	43,15	26.351,00
20-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	5,99	6.714,00	40.239,06	5,52	6,02	6,21	21.610,00
20-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	6,05	1.106,00	6.691,30	5,52	6,02	6,21	21.610,00
20-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	15,20	8.159,00	124.054,56	14,47	15,13	15,39	37.077,00
20-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	15,26	979,00	14.939,54	14,47	15,13	15,39	37.077,00
20-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	15,04	1.305,00	19.632,41	14,47	15,13	15,39	37.077,00
20-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	15,25	1.632,00	24.889,62	14,47	15,13	15,39	37.077,00
20-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	15,21	5.888,00	89.560,38	14,47	15,13	15,39	37.077,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ABEV3	14,52	4.718,00	68.505,36	14,25	14,56	14,68	32.898,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ALPA4	14,85	275,00	4.083,75	13,92	14,77	15,10	19.752,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	AMER3	8,76	646,00	5.658,96	8,00	8,92	9,61	42.695,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ARZZ3	80,26	102,00	8.186,70	76,06	80,13	81,75	10.672,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ASAI3	20,00	1.104,00	22.080,00	19,58	20,00	20,41	24.024,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	AZUL4	10,50	379,00	3.979,50	9,64	10,53	11,07	23.049,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	B3SA3	12,62	6.617,00	83.506,54	11,91	12,57	12,81	95.060,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBA53	33,80	1.643,00	55.533,40	32,63	33,78	34,16	47.223,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBDC3	13,06	1.702,00	22.228,12	12,61	13,07	13,24	12.908,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBDC4	14,71	5.799,00	85.303,29	14,13	14,75	14,97	84.009,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BSE3	32,66	727,00	23.743,82	32,04	32,53	32,83	28.536,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BEEF3	12,54	288,00	3.611,52	12,16	12,43	12,73	22.485,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BPAC1	22,67	1.348,00	30.559,16	21,72	22,77	23,17	42.033,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BPAN4	6,10	358,00	2.183,80	5,74	6,09	6,30	8.681,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRAP4	29,10	299,00	8.700,90	28,53	29,03	29,43	16.613,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRFS3	7,14	1.186,00	8.468,04	6,75	7,17	7,48	27.434,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRKM5	23,44	277,00	6.492,88	22,22	23,42	23,98	15.515,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRML3	8,19	887,00	7.264,53	7,85	8,17	8,31	16.423,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CASH3	1,29	758,00	977,82	1,27	1,31	1,37	10.419,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CCRO3	10,66	1.231,00	13.122,46	10,44	10,71	10,86	12.478,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CIEL3	4,87	1.254,00	6.106,98	4,67	4,94	5,16	29.374,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CMIG4	11,06	1.601,00	17.707,06	10,69	11,03	11,21	15.022,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CMIN3	3,96	1.232,00	4.878,72	3,84	3,97	4,03	8.416,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	COGN3	2,12	2.004,00	4.248,48	2,01	2,09	2,14	14.745,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CPFE3	32,00	207,00	6.624,00	31,25	31,96	32,25	9.004,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CPL6	7,65	1.716,00	13.127,40	7,46	7,65	7,79	13.223,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CRFB3	15,12	564,00	8.527,68	14,45	15,10	15,30	19.124,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CSAN3	16,71	1.334,00	22.291,14	15,95	16,74	17,00	28.896,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CSNA3	14,16	667,00	9.444,72	13,61	14,24	14,52	15.585,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CVCB3	4,27	356,00	1.520,12	3,91	4,22	4,40	11.855,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CYRE3	13,00	266,00	3.458,00	12,54	13,32	13,74	26.262,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	DXCO3	7,44	266,00	1.979,04	7,28	7,46	7,59	12.684,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ECOR3	4,27	369,00	1.575,63	4,18	4,32	4,41	9.348,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	EGIE3	37,85	288,00	10.900,80	36,96	37,65	37,94	7.493,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ELET3	42,44	1.630,00	69.177,20	41,30	42,38	43,15	26.351,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ELET6	43,88	355,00	15.577,40	43,11	43,87	44,56	11.634,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	EMBR3	13,99	829,00	11.597,71	13,49	13,90	14,12	11.431,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ENBR3	20,52	309,00	6.340,68	20,01	20,41	20,60	10.667,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ENEV3	11,80	1.794,00	21.169,20	11,31	11,75	11,98	28.529,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ENGI11	43,53	309,00	13.450,77	42,47	43,52	43,89	13.666,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	EQLT3	26,76	1.243,00	33.262,68	26,37	26,94	27,50	28.942,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	EZTC3	13,73	148,00	2.032,04	13,23	13,85	14,16	8.213,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	FLRY3	15,03	415,00	6.237,45	15,00	15,38	15,97	13.983,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	GGBR4	30,45	1.232,00	37.514,40	29,82	30,41	30,83	29.431,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	GOUA4	13,43	805,00	10.811,15	13,05	13,45	13,60	15.890,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	GOLL4	6,96	196,00	1.364,51	6,19	6,82	7,12	13.962,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	HAPV3	4,90	5.016,00	24.578,40	4,48	4,86	5,00	37.017,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	HYPE3	43,91	460,00	20.198,60	42,89	43,86	44,22	19.317,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	IGTI11	17,85	253,00	4.514,82	17,20	17,86	18,08	16.989,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	IRBR3	0,81	2.795,00	2.263,95	0,76	0,80	0,83	11.795,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ITSA4	8,39	5.913,00	49.610,07	8,27	8,43	8,55	29.911,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ITUB4	24,65	5.463,00	134.662,95	24,29	24,79	25,19	63.504,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	JBSS3	20,67	1.299,00	26.850,33	20,22	20,56	20,93	24.396,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	KLBN11	19,89	783,00	15.573,87	19,44	19,71	19,98	18.931,00



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE DEZEMBRO DE 2022 À 30 DE DEZEMBRO DE 2022

DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FROVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	LREN3	21,24	1.059,00	22.493,16	20,03	21,48	22,03	58.974,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	LWSA3	7,54	428,00	3.227,12	6,91	7,54	7,85	11.999,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	MGLU3	2,82	3.233,00	9.117,06	2,54	2,84	3,03	113.985,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	MRFG3	6,84	355,00	2.428,20	6,79	6,89	7,04	28.699,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	MRVÉ3	7,80	333,00	2.597,40	7,47	7,87	8,14	21.564,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	MULT3	21,25	277,00	5.886,25	20,77	21,42	21,85	17.319,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	NTCO3	11,12	966,00	10.741,92	10,05	11,14	11,70	39.337,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PCAR3	17,73	150,00	2.659,50	16,83	17,77	18,16	10.904,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PETR3	26,17	3.030,00	79.295,10	25,42	25,96	26,34	28.059,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PETRA	23,07	5.132,00	118.395,24	22,21	22,82	23,24	110.295,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PETZ3	6,63	368,00	2.439,84	6,13	6,69	6,98	20.596,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PRIQ3	35,86	966,00	34.640,76	35,40	35,86	36,19	28.482,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	QUAL3	5,68	356,00	2.022,08	5,60	5,88	6,23	16.071,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RADL3	23,69	1.301,00	30.820,69	22,67	23,50	23,82	25.186,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RAIL3	18,33	1.369,00	25.093,77	17,52	18,35	18,80	30.639,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RAIZ4	3,54	1.425,00	5.044,50	3,30	3,50	3,60	17.359,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RDOR3	27,47	1.024,00	28.129,28	25,97	27,50	28,30	21.903,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RENT3	54,00	979,00	52.866,00	51,03	54,03	55,00	52.400,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RRRP3	32,71	275,00	8.995,25	31,67	32,53	32,92	14.665,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SANB11	27,45	426,00	11.693,70	26,71	27,41	27,68	8.679,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SBSP3	56,23	358,00	20.130,34	53,95	56,16	56,90	20.089,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SLCE3	45,48	148,00	6.731,04	44,36	45,30	45,79	8.029,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SMTQ3	24,96	172,00	4.292,70	23,42	25,03	25,73	15.317,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SOMA3	9,97	519,00	5.174,43	9,10	9,90	10,21	24.996,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SULA11	20,61	345,00	7.110,45	19,45	20,60	21,00	17.372,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SUZB3	48,54	840,00	40.773,60	47,86	48,34	49,58	40.045,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	TAEF11	33,55	253,00	8.488,15	33,22	33,75	34,13	13.056,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	TIMS3	12,45	910,00	11.329,50	12,29	12,44	12,54	10.951,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	TOTS3	27,32	575,00	15.709,00	26,22	27,52	28,35	22.671,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	UGPA3	12,48	1.275,00	15.912,00	11,95	12,49	12,79	27.031,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	USIM5	7,05	576,00	4.060,80	6,86	7,10	7,21	20.830,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VALE3	85,75	5.165,00	442.898,75	85,31	86,32	87,25	70.259,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VBBR3	15,03	1.231,00	18.501,93	14,47	15,13	15,39	37.077,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VIAA3	2,46	1.794,00	4.413,24	2,17	2,43	2,57	45.604,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VIVT3	37,75	375,00	19.516,75	36,71	37,59	37,99	11.110,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	WEGE3	38,43	1.646,00	63.255,78	38,11	38,64	39,14	26.738,00
20-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	YDUQ3	10,12	333,00	3.369,96	9,75	10,15	10,43	9.981,00
21-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	14,71	2.800,00	41.195,26	14,24	14,74	15,01	12.464,00
21-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	14,73	1.000,00	14.727,77	14,24	14,74	15,01	12.464,00
21-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	14,67	3.000,00	44.011,68	14,24	14,74	15,01	12.464,00
21-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	14,78	800,00	11.825,39	14,24	14,74	15,01	12.464,00
21-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	BBA53	34,13	500,00	17.065,00	33,74	34,08	34,46	30.276,00
21-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	23,19	600,00	13.915,00	22,54	23,02	23,37	28.476,00
21-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	42,82	1.400,00	59.952,30	41,83	42,57	43,04	29.048,00
21-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	42,82	600,00	25.691,82	41,83	42,57	43,04	29.048,00
21-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	11,85	800,00	9.476,57	11,60	11,83	11,91	23.394,00
21-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	26,70	600,00	16.017,92	26,19	26,63	26,86	16.940,00
21-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	24,89	400,00	9.954,14	24,43	24,86	25,00	58.723,00
21-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	NINJ3	3,02	5.300,00	16.005,18	2,83	2,99	3,08	742,00
21-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	53,45	200,00	10.690,36	52,75	53,36	54,52	41.020,00
21-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	48,45	2.900,00	140.511,08	47,88	48,32	49,12	24.354,00
21-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	9,91	1.800,00	17.841,90	9,72	9,92	10,26	24.677,00
21-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	GGPS3	11,20	15.408,00	172.569,60	11,02	11,20	11,36	4.201,00
21-12-22	FIA RVA EMB IV	Venda	PRIQ3	35,36	2.960,00	104.657,16	35,16	35,70	36,75	30.541,00
21-12-22	FIA RVA EMB IV	Venda	PRIQ3	35,65	4.341,00	154.740,48	35,16	35,70	36,75	30.541,00
21-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	15,64	650,00	10.166,00	14,83	15,41	15,70	36.782,00
21-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	15,49	5.067,00	78.479,00	14,83	15,41	15,70	36.782,00
21-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	15,37	5.372,00	82.565,80	14,83	15,41	15,70	36.782,00
21-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	15,50	1.580,00	24.497,60	14,83	15,41	15,70	36.782,00
21-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	15,28	7.110,00	108.640,80	14,83	15,41	15,70	36.782,00
21-12-22	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	BMLC11	102,95	83,00	8.544,86	98,19	102,87	103,00	7,00
21-12-22	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	BPML11	62,97	186,00	11.713,22	61,72	62,96	63,00	9,00
21-12-22	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	NEWL11	92,49	282,00	26.082,70	90,89	92,19	94,10	94,00
21-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	GGBR4	29,73	40.300,00	1.198.191,94	29,24	29,68	30,33	31.964,00
21-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	14,80	3.500,00	51.812,28	14,69	14,80	15,00	10.528,00
21-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	42,35	1.300,00	55.054,30	41,42	42,18	42,95	32.141,00
21-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	28,19	3.700,00	104.311,46	28,01	28,52	29,36	12.614,00
21-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	SULA11	21,44	6.500,00	139.385,34	21,27	21,65	22,25	12.944,00
21-12-22	FIA RVA EMB IV	Venda	BPAC11	22,93	19.026,00	436.243,68	22,82	23,18	23,61	31.704,00
21-12-22	FIA RVA EMB IV	Venda	ELET3	42,46	4.147,00	176.097,11	41,42	42,18	42,95	32.141,00
21-12-22	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	18,55	5.246,00	97.334,44	18,41	18,67	19,10	23.773,00
21-12-22	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	18,76	987,00	18.518,01	18,41	18,67	19,10	23.773,00
21-12-22	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	18,56	20.169,00	374.252,27	18,41	18,67	19,10	23.773,00
21-12-22	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	18,50	7.435,00	137.550,95	18,41	18,67	19,10	23.773,00
21-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	15,41	1.810,00	27.898,32	15,15	15,35	15,60	28.295,00
21-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	15,35	8.905,00	136.693,57	15,15	15,35	15,60	28.295,00
21-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	15,24	1.570,00	23.925,41	15,15	15,35	15,60	28.295,00
21-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	15,31	3.384,00	51.825,20	15,15	15,35	15,60	28.295,00
21-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ABEV3	14,62	47.600,00	695.912,00	14,46	14,63	14,76	17.318,00
23-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ARZ23	80,62	15.500,00	1.249.552,98	76,70	80,19	81,32	11.912,00
23-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	BRFS3	7,47	151.000,00	1.128.698,00	7,26	7,49	7,60	15.863,00
23-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ELET6	45,09	9.200,00	414.789,32	44,00	44,82	45,41	9.167,00
23-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	44,72	25.600,00	1.144.934,24	43,39	44,43	45,24	9.030,00
23-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	EQLT3	27,07	18.000,00	487.270,45	26,65	27,01	27,59	16.322,00



RELATÓRIO DE CONTROLE DE RISCO
E RENTABILIDADE - DEZEMBRO DE 2022



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE DEZEMBRO DE 2022 À 30 DE DEZEMBRO DE 2022

DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
23-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	GGBR4	28,70	24.000,00	688.800,00	28,34	28,68	29,96	44.181,00
23-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	INTB3	29,79	19.100,00	568.896,00	28,99	29,75	30,08	8.473,00
23-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	RRRP3	35,86	17.300,00	620.378,00	33,80	35,11	36,07	25.988,00
23-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	SBSP3	58,18	9.500,00	552.718,86	56,23	57,91	58,63	10.900,00
23-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	STBP3	8,24	121.700,00	1.002.708,19	7,89	8,24	8,33	13.852,00
23-12-22	FIA RVA EMB II	Compra	VALE3	86,32	10.500,00	906.360,00	85,08	85,90	86,52	50.958,00
23-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	17,43	1.100,00	19.177,74	16,67	17,33	17,55	8.474,00
23-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	14,98	300,00	4.493,65	14,78	15,11	15,44	8.323,00
23-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	15,06	12.200,00	183.723,80	14,78	15,11	15,44	8.323,00
23-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	24,42	7.400,00	180.740,29	23,19	24,38	24,81	38.472,00
23-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	BRML3	8,53	8.700,00	74.253,61	8,23	8,51	8,59	20.130,00
23-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	26,87	1.100,00	29.561,96	26,65	27,01	27,59	16.322,00
23-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	26,88	3.800,00	102.144,00	26,65	27,01	27,59	16.322,00
23-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	21,88	1.800,00	39.384,00	20,57	21,70	22,11	51.563,00
23-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	11,37	19.000,00	216.048,05	10,93	11,42	11,92	25.892,00
23-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	PRIQ3	35,63	5.000,00	178.173,66	35,36	35,58	36,05	20.175,00
23-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	29,53	4.700,00	138.785,44	28,33	29,45	30,27	22.093,00
23-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	30,12	3.000,00	90.362,27	29,19	30,15	30,54	8.388,00
23-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	46,89	3.900,00	182.878,65	46,50	46,88	47,93	24.341,00
23-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	AURE3	15,16	5.389,00	81.697,24	14,78	15,11	15,44	8.323,00
23-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	AURE3	15,14	14.898,00	225.489,90	14,78	15,11	15,44	8.323,00
23-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	AURE3	15,28	318,00	4.859,88	14,78	15,11	15,44	8.323,00
23-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	AURE3	15,03	762,00	11.450,93	14,78	15,11	15,44	8.323,00
23-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	BRML3	8,52	1.296,00	11.044,25	8,23	8,51	8,59	20.130,00
23-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	BRML3	8,54	8.557,00	73.065,53	8,23	8,51	8,59	20.130,00
23-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	BRML3	8,56	7.670,00	65.655,20	8,23	8,51	8,59	20.130,00
23-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	BRML3	8,52	2.593,00	22.080,27	8,23	8,51	8,59	20.130,00
23-12-22	FIA RVA EMB IV	Venda	ELET3	43,04	4.158,00	178.970,79	42,73	43,41	44,16	25.126,00
23-12-22	FIA RVA EMB IV	Venda	ENEV3	11,87	21.732,00	257.916,36	11,67	11,89	12,04	22.548,00
23-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	6,21	13.782,00	85.586,22	6,05	6,23	6,32	11.655,00
23-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	22,90	2.313,00	52.967,70	21,64	22,71	23,03	36.005,00
23-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	22,79	3.472,00	79.127,28	21,64	22,71	23,03	36.005,00
23-12-22	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	22,84	1.735,00	39.627,13	21,64	22,71	23,03	36.005,00
23-12-22	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	HBRH11	85,00	105,00	8.925,00	84,99	84,99	85,00	10,00
23-12-22	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	NEWL11	93,99	187,00	17.575,51	92,99	93,63	94,49	54,00
23-12-22	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	XPPR11	30,95	348,00	10.770,14	30,83	31,13	31,69	3.453,00
26-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	14,86	4.500,00	66.870,23	14,70	14,83	15,10	7.911,00
26-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	BRML3	8,42	3.300,00	27.795,13	8,30	8,42	8,55	12.320,00
26-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	18,62	1.900,00	35.380,12	18,44	18,62	18,91	10.353,00
26-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	11,27	4.100,00	46.225,33	11,07	11,26	11,54	10.276,00
26-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	29,84	1.800,00	53.712,00	28,64	29,73	29,93	16.949,00
26-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	29,61	3.500,00	103.636,16	28,64	29,73	29,93	16.949,00
26-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	31,21	400,00	12.482,70	30,28	30,90	31,39	6.120,00
26-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	30,96	1.900,00	58.819,46	30,28	30,90	31,39	6.120,00
26-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	10,20	1.600,00	16.315,64	10,11	10,22	10,49	13.275,00
26-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	10,21	5.000,00	51.072,33	10,11	10,22	10,49	13.275,00
26-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	10,20	7.100,00	72.420,00	10,11	10,22	10,49	13.275,00
26-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	46,34	1.800,00	83.418,86	46,00	46,30	46,86	11.571,00
26-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	46,28	5.400,00	249.929,51	46,00	46,30	46,86	11.571,00
26-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	46,28	1.500,00	69.419,18	46,00	46,30	46,86	11.571,00
26-12-22	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	BMLC11	97,59	1.674,00	163.372,35	96,00	97,56	102,00	34,00
26-12-22	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	HBRH11	85,37	131,00	11.183,40	84,55	85,55	88,49	48,00
27-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	ENJU3	0,95	6.300,00	5.981,06	0,94	0,95	0,98	990,00
27-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	LREN3	20,23	6.300,00	127.420,73	19,90	20,25	20,96	29.167,00
27-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	10,76	13.200,00	142.041,30	10,58	10,77	11,35	18.145,00
27-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	PETZ3	6,13	4.800,00	29.432,29	6,08	6,20	6,59	15.956,00
27-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	30,70	2.100,00	64.472,49	30,32	30,67	31,01	7.622,00
28-12-22	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	89,12	77.800,00	6.933.496,00	88,70	89,26	90,21	70.228,00
28-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	ALSO3	17,11	1.600,00	27.373,15	16,29	17,07	17,26	9.087,00
28-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	14,82	6.900,00	102.269,60	14,68	14,80	14,93	8.532,00
28-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	34,67	600,00	20.799,95	33,62	34,37	34,80	34.386,00
28-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	24,38	2.500,00	60.939,39	23,55	24,24	24,64	18.818,00
28-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	BRML3	8,38	3.600,00	30.183,19	7,98	8,32	8,46	13.996,00
28-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	42,56	800,00	34.046,78	41,35	42,18	42,74	23.422,00
28-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	11,90	5.100,00	60.711,39	11,43	11,80	12,02	29.270,00
28-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	27,11	5.000,00	135.560,79	26,39	27,01	27,34	16.884,00
28-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	5,23	3.000,00	15.681,94	5,04	5,17	5,27	24.108,00
28-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	18,76	3.000,00	56.278,32	18,00	18,64	18,86	11.659,00
28-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	25,00	2.300,00	57.497,99	24,52	24,93	25,20	42.436,00
28-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	LREN3	20,77	2.400,00	49.849,15	20,36	20,72	21,18	22.543,00
28-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	NINJ3	2,84	2.600,00	7.394,11	2,72	2,82	2,91	680,00
28-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	11,18	2.700,00	30.178,47	10,59	11,19	11,56	25.261,00
28-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	11,27	15.400,00	173.542,06	10,59	11,19	11,56	25.261,00
28-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	PETZ3	6,43	4.400,00	28.304,74	6,06	6,29	6,49	10.652,00
28-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	PRIQ3	37,15	400,00	14.858,70	35,58	36,75	37,49	32.073,00
28-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	RDOR3	30,40	400,00	12.160,26	29,64	30,53	31,18	15.924,00
28-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	32,84	1.700,00	55.828,89	31,19	32,44	33,05	18.483,00
28-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	32,77	1.000,00	32.771,23	31,19	32,44	33,05	18.483,00
28-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	53,84	300,00	16.152,44	52,56	54,14	54,86	24.875,00
28-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	54,11	1.300,00	70.337,57	52,56	54,14	54,86	24.875,00
28-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	54,56	1.300,00	70.925,57	52,56	54,14	54,86	24.875,00
28-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	10,12	1.300,00	13.159,59	9,80	10,15	10,31	19.683,00
28-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	10,15	5.700,00	57.863,87	9,80	10,15	10,31	19.683,00
28-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	10,23	2.800,00	28.647,97	9,80	10,15	10,31	19.683,00



RELATÓRIO DE CONTROLE DE RISCO
E RENTABILIDADE - DEZEMBRO DE 2022



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL
Mês de Referência: 01 DE DEZEMBRO DE 2022 À 30 DE DEZEMBRO DE 2022

DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FROVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
28-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	48,22	1.800,00	86.795,44	47,84	48,27	48,80	16.823,00
28-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	15,58	3.300,00	51.409,08	15,11	15,48	15,64	14.948,00
28-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	10,46	2.700,00	28.245,49	9,91	10,36	10,54	9.861,00
28-12-22	FIA RVA EMB IV	Venda	IREN3	20,51	8.740,00	179.281,19	20,36	20,72	21,18	22.543,00
29-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	24,30	800,00	19.437,20	23,78	24,12	25,09	16.649,00
29-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	5,11	3.500,00	17.895,18	5,08	5,15	5,32	23.050,00
29-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	11,52	6.200,00	71.452,31	11,34	11,53	11,75	18.400,00
29-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	ONCO3	5,96	3.100,00	18.467,00	5,86	6,09	6,50	5.666,00
29-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	29,58	1.000,00	29.580,00	28,77	29,52	31,05	17.014,00
29-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	33,17	3.000,00	99.499,02	32,40	33,13	33,53	22.392,00
29-12-22	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	33,15	2.100,00	69.613,72	32,40	33,13	33,53	22.392,00
29-12-22	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	53,22	1.300,00	69.181,18	52,80	53,66	55,96	24.448,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ABEV3	14,52	9.439,00	137.053,93	14,43	14,52	14,67	24.502,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ALPA4	15,09	365,00	5.509,12	15,00	15,12	15,49	13.779,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	AMBP3	20,50	10,00	209,00	20,55	21,20	22,36	7.097,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	AMER3	9,65	2.102,00	20.282,94	9,36	9,63	10,03	20.027,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ARZZ3	78,48	118,00	9.260,14	76,95	78,10	80,18	6.055,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ASA13	19,47	9.067,00	176.532,40	19,26	19,46	19,66	19.870,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	AURE3	14,73	60,00	883,80	14,65	14,73	14,98	12.052,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	AZUL4	11,01	686,00	7.553,81	10,99	11,15	11,49	12.468,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	B3SA3	13,21	12.701,00	167.778,60	13,09	13,30	13,65	54.916,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBA53	34,73	3.350,00	116.350,01	34,40	34,72	35,04	24.891,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBDC4	13,47	3.110,00	41.895,90	13,44	13,54	13,70	7.485,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBDC4	15,15	10.643,00	161.244,39	15,13	15,23	15,48	42.870,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBSE3	33,71	1.432,00	48.266,64	33,59	33,86	34,34	13.409,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BEEF3	12,96	531,00	6.881,77	12,75	13,11	13,41	19.302,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BPAC11	23,94	2.580,00	61.770,66	23,78	24,12	25,09	16.649,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BPAN4	6,07	739,00	4.485,55	5,98	6,08	6,27	3.671,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRAP4	29,73	494,00	14.686,96	29,54	29,81	30,20	10.928,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRFS3	8,28	2.174,00	17.998,92	7,65	8,04	8,33	30.142,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRKM5	23,79	573,00	13.629,20	23,76	24,05	24,92	11.675,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRML3	8,30	1.705,00	14.149,00	8,22	8,31	8,57	21.149,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CASH3	1,18	1.314,00	1.550,52	1,16	1,18	1,22	7.957,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CBAV3	11,55	40,00	462,00	11,01	11,43	11,65	8.221,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CCRO3	10,82	4.283,00	46.341,46	10,80	10,86	11,10	11.409,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CIEL3	5,24	2.125,00	11.135,00	5,09	5,20	5,28	12.085,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CMIG4	11,14	2.995,00	33.364,84	11,05	11,15	11,27	24.032,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CMIN3	4,08	2.443,00	9.967,44	4,06	4,09	4,17	5.623,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	COGN3	2,12	3.811,00	8.079,71	2,09	2,12	2,20	16.354,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CPFE3	33,21	401,00	13.315,35	32,43	33,18	33,55	6.793,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CPL66	7,91	3.384,00	26.767,53	7,81	7,89	7,99	11.477,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CRFB3	14,78	1.118,00	16.523,48	14,68	14,83	15,31	9.423,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CSAN3	17,12	2.437,00	41.721,44	17,03	17,18	17,59	11.166,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CSNA3	14,55	1.213,00	17.648,45	14,26	14,61	14,79	10.370,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CVCB3	4,49	520,00	2.333,92	4,42	4,52	4,72	6.910,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CYRE3	13,07	599,00	7.828,33	12,95	13,18	13,78	13.134,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	DXCO3	6,78	859,00	5.824,02	6,72	6,81	6,95	8.429,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ECOR3	4,45	583,00	2.593,90	4,45	4,50	4,66	5.296,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	EGIE3	37,91	522,00	19.786,66	37,70	37,89	38,20	4.655,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ELET3	42,12	26.582,00	1.119.633,45	41,60	42,13	43,07	34.093,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ELET6	43,25	291,00	12.584,58	43,04	43,52	44,55	7.043,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	EMBR3	14,31	1.506,00	21.553,58	14,05	14,29	14,43	12.398,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ENAT3	13,32	10,00	133,20	13,28	13,50	13,63	3.989,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ENBR3	20,80	467,00	9.712,08	20,68	20,89	21,28	10.549,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ENEV3	11,93	4.139,00	49.380,58	11,83	11,94	12,10	15.783,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ENGI11	44,21	481,00	21.262,84	44,08	44,36	45,26	5.260,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	EQLT3	27,02	2.248,00	60.748,52	26,68	26,97	27,51	15.514,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	EZTC3	13,43	150,00	2.015,10	13,28	13,53	14,05	7.277,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	FLRY3	15,45	3.146,00	48.605,66	15,45	15,60	16,27	7.771,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	GGBR4	29,37	2.556,00	36.887,92	29,32	29,45	29,79	18.335,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	GOAU4	12,97	299,00	3.877,18	12,91	12,99	13,09	13.121,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	GOLL4	7,34	397,00	2.914,68	7,34	7,51	7,80	6.002,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	HAPV3	5,08	9.262,00	47.051,32	5,08	5,15	5,32	23.050,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	HYPE3	45,21	826,00	37.340,71	44,84	45,23	45,79	12.005,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	IGTI11	18,50	2.138,00	39.554,61	18,32	18,55	19,08	10.937,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	IRBR3	0,86	71.100,00	61.146,24	0,86	0,87	0,95	51.950,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ITSA4	8,51	12.015,00	102.248,76	8,47	8,52	8,65	15.896,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ITUB4	25,00	9.935,00	248.374,40	24,96	25,09	25,48	40.425,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	JBSS3	21,99	2.275,00	50.025,65	21,58	21,90	22,10	12.859,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	KLBN11	19,97	1.453,00	29.016,42	19,76	19,94	20,07	11.361,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	IREN3	20,48	1.727,00	35.369,18	20,13	20,51	21,10	31.425,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	LWSA3	7,02	909,00	6.380,92	7,00	7,08	7,23	10.396,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	MEDIA3	36,45	10,00	364,50	35,41	35,89	36,70	5.937,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	MGLU3	2,74	5.948,00	16.297,52	2,66	2,71	2,80	25.669,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	MOVI3	7,60	20,00	152,00	7,60	7,79	8,11	8.106,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	MRFG3	8,70	642,00	5.583,40	8,28	8,52	8,70	13.087,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	MRVE3	7,60	1.011,00	7.683,70	7,50	7,69	7,97	27.055,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	MULT3	21,89	575,00	12.587,25	21,77	22,08	22,58	12.609,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	NTCO3	11,61	1.702,00	19.761,10	11,34	11,53	11,75	18.400,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PCAR3	16,52	344,00	5.683,33	16,44	16,60	17,10	10.039,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PETR3	28,04	50.123,00	1.405.448,36	27,98	28,10	28,73	23.406,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PETRA	24,50	9.529,00	233.463,47	24,43	24,60	25,05	59.594,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PETZ3	6,26	171,00	4.488,03	6,20	6,32	6,62	9.193,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	POSI3	9,39	3.751,00	35.220,39	8,82	9,37	9,63	10.845,00



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL
Mês de Referência: 01 DE DEZEMBRO DE 2022 À 30 DE DEZEMBRO DE 2022



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PRI03	37,21	1.693,00	62.998,81	36,62	37,14	37,48	20.207,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	PSSA3	23,15	30,00	694,50	23,11	23,24	23,65	5.377,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	QUAL3	5,87	537,00	3.153,63	5,87	5,96	6,28	6.209,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RADL3	23,72	2.488,00	59.010,94	23,65	23,76	24,01	12.237,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RAIL3	18,61	2.542,00	47.312,06	18,37	18,58	18,83	10.842,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RDO3	29,59	2.420,00	71.597,13	28,77	29,52	31,05	17.014,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	RENT3	53,20	4.702,00	250.143,60	52,80	53,66	55,96	24.448,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RRRP3	37,76	121,00	4.569,00	36,83	37,85	38,50	15.008,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SANB11	28,19	701,00	19.762,94	28,05	28,21	28,62	6.253,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SBSP3	57,16	738,00	42.183,23	56,43	57,08	58,09	12.044,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SLCE3	46,92	155,00	7.271,90	46,44	46,85	47,34	4.650,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SMTO3	26,52	1.855,00	49.200,19	25,71	26,35	26,52	10.524,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SOMA3	10,14	1.043,00	10.578,66	9,96	10,11	10,50	14.861,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	STBP3	7,81	160,00	1.249,60	7,70	7,81	8,09	10.131,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SUZB3	48,24	1.478,00	71.299,56	47,63	48,28	48,57	15.236,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	TAFEE11	34,67	447,00	15.498,54	34,54	34,76	35,06	7.944,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	TIMS3	12,40	1.707,00	21.169,60	12,31	12,40	12,48	7.210,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	TOTS3	27,62	1.142,00	31.547,36	27,32	27,69	28,42	9.877,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	UGPA3	12,61	2.195,00	27.675,17	12,60	12,70	12,94	10.801,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	USIM5	7,16	1.022,00	7.317,52	7,13	7,18	7,23	10.335,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	VALE3	88,88	55.174,00	4.903.883,45	88,83	89,10	89,95	52.925,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	VAMO3	12,97	60,00	778,20	12,29	12,54	12,91	18.154,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VBBR3	15,55	2.323,00	36.125,38	15,45	15,66	15,95	16.939,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VIIA3	2,40	3.253,00	7.807,20	2,39	2,44	2,57	19.083,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VIVT3	38,35	497,00	19.062,12	37,94	38,44	38,78	10.667,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	WEGE3	38,51	6.041,00	232.643,95	38,25	38,49	38,99	14.137,00
29-12-22	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	YDUQ3	10,17	622,00	6.324,03	9,98	10,18	10,58	8.066,00

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.