



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO



Dezembro/2021





1. INTRODUÇÃO

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

Os limites e critérios definidos para o controle e monitoramento dos riscos informados seguem as definições estabelecidas na Política de Investimento dos Planos administrados pela EMBRAER PREV, bem como na Resolução CMN Nº 4.661/2018.

2. RISCO DE MERCADO

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



2.1. Relatório Detalhado Risco



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/12/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.748.294.883,27	VAR / PL:	3,240%
VAR:	121.456.892,97	ETL / PL:	4,0635%
ETL:	152.311.896,01	VAR / CDI:	9324,87%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	141.581.184,55	BAIXA 1:	302.935.467,30	Cenário 1:	369.539.600,21
				Cenário 2:	- 71.450.229,21
				Cenário 3:	- 364.484.444,75

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	272.384,97	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	2.460.733,90	-	-	0,00%	-	-	-
ABEV3	20.720.763,78	2.776.496,64	1.693.966,08	-1,39%	- 4.659.679,36	- 20.568,24	8.570.759,86
AIEC11	2.021.397,00	136.693,79	40.906,15	0,03%	- 61.726,59	-	87.008,10
ALPA4	314.225,76	32.409,50	26.236,97	0,02%	- 62.529,11	- 271,71	110.580,79
ALSO3	2.029.542,00	237.148,13	154.923,15	0,13%	- 69.137,46	- 265,07	- 90.314,82
AMER3	4.452.716,84	801.017,06	39.588,61	0,03%	- 743.405,60	-	1.254.560,52
ANIM3	123.480,00	42.601,52	40.315,17	0,03%	- 130.795,35	- 348,23	- 77.209,98
ASAI3	5.556.729,60	833.896,50	349.267,75	0,29%	- 56.661,88	-	77.934,50
AZUL4	403.961,88	77.847,85	44.625,47	0,04%	- 37.659,92	- 154,10	57.456,77
B3SA3	19.020.168,64	1.109.884,73	168.201,83	0,14%	- 1.539.415,23	- 6.257,45	2.311.446,44
Banco BTG Pactual SA UNT	18.040.365,00	2.614.114,44	1.610.223,59	1,33%	- 880.273,29	- 3.351,09	- 1.130.930,95
BBAS3	14.088.407,05	1.661.449,97	520.694,92	0,43%	- 2.375.225,83	- 8.560,13	- 2.688.176,06
BBDC3	1.130.806,74	77.756,66	11.524,50	0,01%	- 72.151,15	- 290,63	105.990,99
BBDC4	28.429.167,15	2.013.667,96	527.972,82	0,43%	- 535.224,39	- 2.106,47	743.813,46
BBRK3	20.130,00	4.646,72	340,59	0,00%	- 8.117,28	- 40,47	20.468,71
BBSE3	1.319.824,50	178.678,75	163.220,44	-0,13%	- 262.111,67	- 1.138,68	463.260,97
BEEF3	136.422,00	31.190,51	4.210,02	0,00%	- 46.244,43	- 155,34	44.670,98
BIDI11	2.645.524,86	364.203,88	16.793,47	-0,01%	- 1.444.948,58	- 8.136,21	5.095.172,38
BIDI3	413,60	60,40	6,26	0,00%	- 226,58	- 1,28	802,56
BIDI4	8.337,96	1.083,64	234,44	0,00%	- 4.635,38	- 26,35	16.789,37
BLCP11	1.404.047,19	216.346,43	39.879,19	0,03%	- 66.783,38	-	85.918,41
BMGB4	189.696,00	48.543,33	28.522,26	0,02%	- 66.834,90	- 223,35	- 63.823,27
BMLC11	1.929.813,48	81.995,19	17.841,50	0,01%	- 46.506,23	-	61.448,22
BPAN4	2.339.272,44	397.459,80	222.621,21	0,18%	- 342.564,04	- 1.443,62	561.589,52
BPML11	1.165.343,31	75.724,54	31.402,07	-0,03%	- 224.147,88	- 970,13	392.502,53
BRAP4	317.997,75	115.036,20	87.137,35	0,07%	- 498.402,52	- 1.171,08	- 229.693,14
BRFS3	925.189,16	164.366,91	8.464,98	0,01%	- 80.607,36	- 328,74	122.006,26
BRKM5	771.492,81	268.616,24	214.121,48	0,18%	- 1.190.036,23	- 2.811,83	- 554.412,40
BRML3	9.905.220,84	1.200.719,09	624.704,48	0,51%	- 89.164,81	- 346,07	- 119.892,37
BRPR3	42.398,00	3.124,60	1.927,88	0,00%	- 35,17	- 0,14	47,84
CASH3	1.294.700,76	371.832,49	249.208,62	0,21%	- 332.340,39	-	642.785,47
CBOP11	43.029,00	4.341,26	2.533,76	0,00%	- 6.053,39	- 22,09	- 7.047,39
CCRO3	654.452,53	55.954,34	39.939,34	0,03%	- 124.813,72	- 445,52	- 138.198,89
CEOC11	856.200,00	143.470,17	81.837,04	0,07%	- 192.151,60	- 676,12	- 205.943,23
CESP6	8.833.812,84	1.541.206,85	1.382.271,47	-1,14%	- 3.419.759,01	- 16.845,34	8.348.630,60
CIEL3	2.195.339,04	319.392,14	150.801,14	0,12%	- 232.197,69	- 860,68	- 280.349,73
CLSA3	1.256.112,00	531.209,84	327.086,66	-0,27%	- 1.051.914,07	-	13.574.818,70
CMIG4	739.377,78	49.216,21	22.324,76	0,02%	- 108.750,05	- 395,66	- 125.781,21
CMIN3	382.036,68	84.599,74	76.632,36	0,06%	- 291.377,57	-	- 205.198,89
CNES11	530.541,00	24.747,23	3.215,40	0,00%	- 79.637,58	- 336,31	131.226,38



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/12/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.748.294.883,27	VAR / PL:	3,240%
VAR:	121.456.892,97	ETL / PL:	4,0635%
ETL:	152.311.896,01	VAR / CDI:	9324,87%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	141.581.184,55	BAIXA 1:	302.935.467,30	Cenário 1:	369.539.600,21
				Cenário 2:	- 71.450.229,21
				Cenário 3:	- 364.484.444,75

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
COGN3	228.743,10	26.230,87	15.485,61	0,01%	1.959,77	7,61	- 2.636,48
CPFE3	7.139.436,17	636.174,38	436.548,15	0,36%	1.865.605,25	6.464,66	- 1.931.600,39
CPLE6	510.002,92	38.381,53	30.005,40	0,02%	86.237,22	310,72	- 97.550,98
CRFB3	1.923.650,25	121.867,33	8.549,28	-0,01%	- 249.139,38	- 1.039,95	- 398.999,15
CSAN3	1.284.069,69	129.120,61	114.322,69	0,09%	296.639,38	1.040,89	- 315.948,28
CSED3	2.965.270,00	821.878,95	752.729,14	0,62%	1.910.595,30	-	- 1.456.722,03
CSNA3	812.224,98	274.194,50	243.640,78	0,20%	629.888,18	1.819,93	- 439.943,36
CVCB3	152.545,14	22.079,60	8.943,74	0,01%	- 15.757,92	- 64,83	- 24.362,31
CYRE3	4.322.078,88	853.285,23	684.392,11	0,56%	1.216.084,75	4.179,65	- 1.236.221,59
DXCO3	223.951,20	34.075,43	29.168,86	0,02%	59.711,24	-	- 61.521,83
ECOR3	125.618,52	14.295,46	2.321,65	0,00%	- 33.908,65	- 153,99	- 67.014,32
EGIE3	5.239.815,38	177.255,20	111.145,96	-0,09%	- 110.312,80	- 434,65	- 153.715,96
ELET3	3.173.950,00	303.395,61	182.498,47	0,15%	314.703,71	1.170,05	- 382.648,78
ELET6	7.571.008,55	798.196,62	502.596,18	0,41%	753.602,89	2.801,36	- 915.929,89
ENBR3	244.830,48	19.591,50	9.347,65	-0,01%	12.469,08	47,42	- 15.981,39
ENEV3	3.236.770,05	223.231,56	15.158,32	0,01%	- 365.189,77	- 1.510,32	- 571.802,24
ENGI11	558.485,19	62.171,86	42.844,19	0,04%	121.437,24	428,56	- 131.023,83
EQTL3	13.125.511,98	610.630,67	395.529,55	0,33%	119.361,18	463,25	- 160.477,60
ESPA3	1.963.586,56	402.687,25	247.370,44	0,20%	- 649.151,88	-	- 1.424.239,75
EUCATEX PN	120.697,00	19.666,14	16.084,06	0,01%	47.948,80	157,51	- 44.088,51
EWJ_US	4.409.750,72	178.427,93	96.939,90	-0,08%	19.795,16	- 39.687,76	- 26.757,92
EZTC3	105.215,25	23.261,60	19.842,84	0,02%	36.529,64	122,32	- 35.037,71
FLRY3	276.506,30	25.300,58	10.529,66	0,01%	- 32.441,24	- 134,50	- 51.103,26
GALG11	1.300.861,80	72.293,01	53.860,68	0,04%	145.724,65	-	- 174.785,19
GALG13	492,10	6,01	1,82	0,00%	-	-	-
GGBR4	8.575.886,96	1.293.615,39	1.001.556,48	0,82%	5.437.671,16	16.434,40	- 4.175.736,46
GGPS3	4.013.110,38	623.067,50	431.473,02	0,36%	984.197,47	-	- 1.034.325,16
GMAT3	5.927.960,34	991.644,03	374.747,54	-0,31%	- 1.183.857,42	- 5.146,40	- 2.095.844,80
GNDI3	13.597.156,75	1.455.698,06	196.436,78	-0,16%	- 3.487.073,97	- 15.699,44	- 6.741.834,77
GOAU4	1.364.143,36	179.513,49	133.526,50	0,11%	731.496,22	2.285,24	- 602.968,61
GOLL4	144.141,92	30.081,53	22.164,75	0,02%	55.656,91	183,60	- 51.651,90
HAPV3	14.491.455,72	1.790.000,99	428.846,44	-0,35%	- 4.701.721,81	- 22.142,67	- 10.202.370,39
HBRH11	2.066.928,00	300.231,09	149.736,58	0,12%	614.765,02	-	- 615.966,09
HBSA3	422.145,45	134.541,63	100.457,57	0,08%	213.665,21	674,58	- 180.175,95
HSML11	9.040.545,60	1.367.116,10	544.203,85	0,45%	1.762.124,13	6.278,56	- 1.943.097,70
HYPE3	3.617.994,60	382.082,96	284.297,58	0,23%	246.333,50	929,21	- 309.768,79
IGTI11	302.564,08	516.369,76	155.824,19	-0,13%	-	-	-
INTB3	5.141.781,04	457.387,59	48.090,51	0,04%	- 113.626,73	-	- 158.533,80
IRBR3	255.619,74	27.888,49	599,02	0,00%	- 27.459,88	- 113,23	- 42.686,98
ITSA4	14.620.044,19	680.778,95	294.393,44	0,24%	- 931.674,98	- 3.752,70	- 1.368.505,94



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/12/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.748.294.883,27	VAR / PL:	3,240%
VAR:	121.456.892,97	ETL / PL:	4,0635%
ETL:	152.311.896,01	VAR / CDI:	9324,87%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	141.581.184,55	BAIXA 1:	302.935.467,30	Cenário 1:	369.539.600,21
				Cenário 2:	- 71.450.229,21
				Cenário 3:	- 364.484.444,75

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
ITUB4	33.966.570,20	2.833.597,04	2.424.217,34	2,00%	- 3.364.050,69	13.808,28	5.171.765,99
JBSS3	17.667.584,55	2.241.091,52	1.066.611,97	-0,88%	377.983,50	1.458,15	500.983,85
JHSF3	86.311,44	17.458,40	12.184,33	0,01%	34.340,18	112,78	31.559,89
JRDM11	1.176.897,30	187.021,19	85.991,23	0,07%	359.361,36	1.223,28	357.529,42
KLBN11	1.056.345,22	156.687,74	133.150,84	0,11%	545.257,68	1.715,40	456.296,82
LAME4	2.917.216,87	547.119,94	60.816,65	-0,05%	51.370,13	198,54	68.385,02
LCAM3	1.801.124,61	281.240,00	254.132,03	0,21%	655.163,94	2.179,81	619.575,80
LREN3	9.480.031,60	1.630.216,04	986.406,16	-0,81%	- 4.121.666,19	21.062,95	11.103.235,22
LVBI11	4.038.344,57	783.895,47	421.634,13	0,35%	1.677.323,65	5.472,84	1.519.537,31
LWSA3	2.998.795,52	884.625,34	156.810,27	-0,13%	- 1.328.914,19	6.836,94	3.645.702,58
MALL11	7.692.568,63	1.349.525,84	810.456,65	0,67%	3.441.865,79	11.098,18	3.038.459,24
MATD3	2.190.064,50	270.026,37	137.673,18	0,11%	- 306.265,43	-	497.502,10
MAXR11	1.467.419,35	109.872,55	33.814,71	0,03%	56.958,25	217,88	74.004,80
MDNE3	81.176,00	24.797,35	18.619,45	0,02%	37.100,39	119,21	32.503,02
MEGA3	2.941.276,80	129.386,57	30.595,38	0,03%	-	-	-
MGLU3	6.844.653,86	2.237.853,82	867.008,94	-0,71%	- 4.805.731,91	32.240,54	28.642.043,44
MOVI3	7.211.460,00	1.060.487,10	706.772,09	0,58%	1.208.632,06	4.357,72	1.369.239,51
MRFG3	388.961,68	86.419,23	66.040,35	-0,05%	- 110.373,47	505,77	223.207,10
MRVE3	397.356,00	55.171,40	43.795,48	0,04%	73.949,17	264,49	82.251,29
MULT3	6.967.509,12	705.315,53	13.769,79	-0,01%	- 678.761,52	2.783,63	1.041.277,65
NEWU11	388.032,00	25.569,87	3.778,32	0,00%	- 16.574,52	-	23.714,71
NINJ3	57.452,00	33.892,11	5.892,29	0,00%	- 23.850,76	-	61.633,91
NTCO3	13.679.890,49	3.305.912,99	357.977,92	-0,29%	- 6.062.974,02	31.193,90	16.634.948,98
PACUCAR_CBD ON ED	172.666,58	19.443,52	7.752,62	0,01%	- 1.437,65	5,63	1.972,99
PARD3	665.560,50	70.044,94	17.627,63	0,01%	11.632,75	44,96	15.488,12
PATC11	8.201.927,02	377.625,29	135.680,46	0,11%	728.516,31	2.721,55	895.670,55
PETR3	27.164.680,10	5.442.314,14	4.619.816,33	3,80%	31.696.689,00	82.017,01	17.666.260,99
PETR4	43.580.961,80	7.793.453,67	6.306.377,03	5,19%	40.850.046,87	112.507,00	25.838.494,19
PETZ3	249.904,42	23.119,70	14.573,79	0,01%	- 54.601,02	240,07	99.447,62
POSI3	43.055,00	11.534,47	10.117,36	0,01%	26.373,42	80,28	20.562,72
POWE3	37.135,00	6.852,08	3.830,51	0,00%	- 15.175,71	-	38.694,27
PRIO3	14.233.424,01	4.019.907,38	2.807.893,64	-2,31%	- 4.685.472,15	22.138,54	10.253.899,90
QAGR11	8.384.942,23	513.787,76	218.554,35	0,18%	822.718,84	-	1.001.449,48
QUAL3	503.738,30	63.520,08	18.395,80	0,02%	- 44.259,41	180,58	67.054,63
RADL3	7.716.610,80	919.763,15	518.792,10	0,43%	1.081.842,32	3.948,10	1.260.114,51
RAIL3	14.343.118,08	1.504.837,29	1.269.311,32	1,05%	2.987.833,23	10.585,08	3.252.114,31
RAPT4	3.558.838,00	275.908,99	162.069,18	0,13%	143.768,39	549,52	186.461,37
RBGS11	494.859,30	40.125,70	3.082,32	0,00%	- 115.723,64	513,66	215.844,79
RBRL11	1.953.012,14	288.565,09	163.092,30	0,13%	327.656,21	-	371.132,90
RCRB11	1.625.466,00	117.520,01	32.605,22	0,03%	168.245,77	624,28	203.624,12



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/12/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.748.294.883,27	VAR / PL:	3,240%
VAR:	121.456.892,97	ETL / PL:	4,0635%
ETL:	152.311.896,01	VAR / CDI:	9324,87%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	141.581.184,55	BAIXA 1:	302.935.467,30	Cenário 1:	369.539.600,21
				Cenário 2:	- 71.450.229,21
				Cenário 3:	- 364.484.444,75

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
RDOR3	1.276.489,42	118.511,78	65.309,07	-0,05%	544.836,92	-	1.442.953,09
RECV3	1.546.490,00	403.555,80	242.348,81	0,20%	816.369,48	-	677.156,62
RENT3	7.250.506,00	1.110.424,08	1.038.462,98	0,86%	2.739.661,72	9.066,16	2.560.174,67
RNGO11	140.582,38	12.769,09	441,50	0,00%	2.344,53	9,22	3.249,84
RRRP3	338.653,70	83.760,97	19.291,81	0,02%	53.445,78	193,53	61.146,09
SANB11	550.642,66	41.436,74	18.362,13	-0,02%	134.716,10	602,00	255.581,92
SBSP3	691.658,52	113.225,98	74.333,90	0,06%	417.030,26	1.273,51	327.383,83
SDIL11	382.570,89	33.380,89	22.052,08	0,02%	64.903,25	233,80	73.377,17
SEER3	641.998,49	86.018,56	59.784,86	0,05%	71.633,15	264,82	85.958,45
SOMA3	3.499.922,55	323.897,48	99.196,14	0,08%	865.593,85	3.874,57	1.649.172,30
SPY	14.043.359,50	634.543,98	325.392,80	-0,27%	1.460.658,64	124.987,39	1.766.855,63
STBP3	6.349.625,00	1.644.642,88	1.572.274,17	1,29%	3.582.033,17	11.083,36	2.892.223,82
SULA11	2.308.555,22	288.927,53	60.124,29	-0,05%	283.220,24	1.177,71	449.384,11
SUZB3	21.246.901,37	4.086.056,05	3.596.954,00	2,96%	12.170.375,44	37.545,66	9.764.478,40
TAE11	402.470,42	33.380,94	21.679,64	0,02%	81.858,09	290,61	89.523,81
TEND3	1.924.992,00	209.788,12	35.476,78	-0,03%	248.586,08	1.037,42	397.907,71
TEPP11	8.330.280,00	1.371.562,23	782.345,97	0,64%	3.526.268,25	11.471,69	3.173.932,26
TIMS3	2.843.832,15	411.780,46	66.059,16	-0,05%	135.843,39	542,62	195.584,33
TOTS3	6.053.894,56	586.503,54	301.780,17	-0,25%	2.038.309,97	9.681,34	4.521.768,46
TRXF11	13.375.098,45	915.858,37	525.411,93	0,43%	1.967.741,37	7.159,02	2.275.821,11
UGPA3	3.252.481,68	526.518,26	475.709,50	0,39%	1.648.292,93	5.202,76	1.389.266,20
USIM5	7.343.807,20	2.070.055,78	1.813.923,05	1,49%	7.178.736,39	19.547,85	4.436.290,70
VALE3	69.254.518,64	18.594.119,57	15.726.956,99	12,95%	57.645.639,89	163.708,18	38.842.964,91
VBBR3	10.743.270,80	809.285,70	708.094,49	0,58%	93.149,93	-	125.299,31
VIA3	424.415,25	59.642,61	13.494,98	0,01%	180.836,62	-	478.177,62
VISC11	6.829,68	645,59	288,76	0,00%	1.068,36	3,87	1.224,00
VITT3	383.448,20	2.002.644,38	1.112.049,29	-0,92%	-	-	-
VIVT3	1.058.156,02	114.845,43	73.055,84	-0,06%	78.686,89	318,73	117.155,34
VTV_US	8.316.907,94	404.927,57	120.233,17	-0,10%	1.115.242,05	74.852,17	1.307.203,71
VVPR11	1.219.356,16	33.790,71	14.850,96	0,01%	866,97	-	1.177,13
WEGE3	12.027.608,12	1.297.872,51	155.491,31	-0,13%	752.000,82	3.027,07	1.102.910,54
WEST3	56.700,00	38.152,70	30.673,20	0,03%	5.378,48	-	8.223,36
WSPH22	3.340.278,03	150.772,18	78.014,08	-0,06%	253.304,30	30.062,50	315.842,05
XPIN11	4.063.318,39	675.790,04	413.810,14	0,34%	1.396.883,91	-	1.343.773,46
XPPR11	3.582.900,00	623.206,60	361.710,37	0,30%	1.432.794,95	-	1.314.579,54
YDUQ3	1.297.685,52	132.650,73	73.669,41	0,06%	7.569,29	29,60	10.357,13
INDG22	12.697.800,00	962.838,11	827.334,86	0,68%	-	-	-
DI1F22	72.874.677,43	1.857,55	654,46	0,00%	4.000,84	2.077,26	6.158,90
DI1J22	13.856.839,18	18.220,40	14.626,81	0,01%	53.363,47	27.594,92	81.596,13
DI1N22	25.232.140,16	166.644,25	145.548,98	0,12%	209.548,05	107.890,53	318.104,24



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/12/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.748.294.883,27	VAR / PL:	3,240%
VAR:	121.456.892,97	ETL / PL:	4,0635%
ETL:	152.311.896,01	VAR / CDI:	9324,87%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	141.581.184,55	BAIXA 1:	302.935.467,30	Cenário 1:	369.539.600,21
				Cenário 2:	- 71.450.229,21
				Cenário 3:	- 364.484.444,75

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
DAPQ22	21.022.390,51	168.526,95	44.002,40	0,04%	112.482,59	- 40.881,06	- 246.261,59
DI1V22	920.271,64	12.220,35	11.060,38	0,01%	12.012,46	- 6.160,41	- 18.115,54
DI1F23	37.389.865,38	734.603,58	671.011,52	0,55%	657.914,31	- 336.194,65	- 986.280,22
DAPK23	28.556.717,80	403.831,92	247.349,56	0,20%	386.152,36	- 139.467,77	- 833.106,20
DI1N23	5.269.123,33	170.903,67	159.342,98	0,13%	135.948,65	- 69.066,25	- 201.834,75
DI1F24	10.569.886,94	472.641,61	445.936,42	0,37%	349.007,22	- 176.459,47	- 514.036,32
DI1N24	853.338,72	46.371,86	43.866,94	0,04%	34.713,86	- 17.456,50	- 50.669,89
DAPQ24	26.199.526,62	542.551,04	450.733,36	0,37%	607.532,21	- 218.170,28	- 1.293.250,87
DI1F25	4.510.639,16	289.305,23	274.378,45	0,23%	219.138,90	- 109.584,45	- 316.916,37
DAPK25	9.643.791,26	240.954,37	225.073,32	0,19%	-	-	-
DI1F26	- 3.017.214,58	242.885,39	231.617,66	-0,19%	195.694,11	96.726,64	277.605,61
DAPQ26	5.560.271,09	168.145,74	162.294,66	0,13%	-	-	-
DI1F27	5.077.558,07	477.431,64	456.381,82	0,38%	417.967,43	- 204.021,82	- 580.802,89
DAPQ28	- 8.715.194,35	319.964,32	311.462,84	-0,26%	-	-	-
DI1F29	3.292.647,69	386.577,28	370.976,15	0,31%	388.714,88	- 185.064,74	- 518.450,20
DAPQ30	- 40,92	1,69	1,61	0,00%	2,95	1,03	5,83
DI1F31	320.576,64	43.832,65	42.086,30	0,03%	49.527,71	- 23.003,30	- 63.439,33
DAPK35	- 318.858,94	17.608,23	16.673,61	-0,01%	-	-	-
DOLF22	9.769.036,23	294.541,48	74.753,53	-0,06%	740.241,27	- 87.645,36	- 922.969,63
WDOF22	- 9.769.036,23	294.541,48	74.753,53	0,06%	740.241,27	87.645,36	922.969,63
DOLG22	- 10.116.696,93	305.906,88	77.402,25	0,06%	754.003,27	84.729,49	939.488,15
WDOG22	2.023.339,39	61.181,38	15.480,45	-0,01%	150.800,65	- 16.945,90	- 187.897,63
COMPROMISSADA	424.529.979,09	10.821,12	3.812,57	0,00%	23.306,82	- 12.101,05	- 35.878,56
EMP AÇÃO PROVISÃO	35.849,37	348,57	333,13	0,00%	503,04	- 213,91	- 570,32
LTN	5.473.089,40	177.519,30	165.511,09	0,14%	141.211,18	- 71.739,78	- 209.647,70
DE252 AEGEA SA CDI -	1.076.372,46	186,39	173,74	0,00%	114,00	- 58,44	- 171,66
DE252 AERIS CDI - AERI11	1.286.582,41	2.389,43	2.251,43	0,00%	1.862,69	- 941,22	- 2.740,77
DE252 ALIANSCE CDI -	4.074.280,91	76.366,54	72.995,26	0,06%	62.796,06	- 30.826,23	- 88.064,76
DE252 AUTOBAN CDI -	928.953,11	690,95	653,38	0,00%	513,64	- 258,95	- 752,87
DE252 AUTOPIST CDI -	1.388.882,37	1.271,37	1.205,50	0,00%	952,51	- 477,49	- 1.383,13
DE252 B3SA CDI - BSA313	1.734.854,87	717,23	673,09	0,00%	523,71	- 266,80	- 780,94
DE252 BCBF CDI - BCBF14	272.599,26	388,07	365,39	0,00%	304,53	- 154,20	- 449,62
DE252 BCBF CDI - BCBF15	2.629.464,22	4.076,08	3.839,21	0,00%	3.198,82	- 1.618,52	- 4.717,12
DE252 BKBR CDI - BKBR18	1.462.529,46	1.129,36	1.062,03	0,00%	848,14	- 430,59	- 1.257,59
DE252 BRKA CDI - BRKP18	2.688.473,67	6.843,65	6.449,28	0,01%	5.371,86	- 2.716,45	- 7.914,12
DE252 BRML CDI - BRML17	3.204.978,62	11.675,02	11.098,17	-0,01%	9.081,82	4.564,89	13.247,84
DE252 CCPR CDI - CCPRA3	2.165.119,93	4.012,81	3.507,91	0,00%	3.076,24	1.443,45	3.992,44
DE252 CEA MODA CDI -	2.126.613,78	2.708,17	2.547,28	0,00%	2.094,18	- 1.061,24	- 3.095,99
DE252 CELPA CDI - CELP15	2.575.944,06	385,87	359,40	0,00%	239,59	- 123,11	- 362,15
DE252 CONT GLO CDI -	2.419.470,49	8.095,55	7.718,38	0,01%	6.686,41	- 3.309,88	- 9.511,36



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/12/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.748.294.883,27	VAR / PL:	3,240%
VAR:	121.456.892,97	ETL / PL:	4,0635%
ETL:	152.311.896,01	VAR / CDI:	9324,87%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	141.581.184,55	BAIXA 1:	302.935.467,30	Cenário 1:	369.539.600,21
				Cenário 2:	- 71.450.229,21
				Cenário 3:	- 364.484.444,75

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
DE252 COPEL GT CDI -	299.649,76	1.402,88	- 1.296,97	0,00%	- 1.226,73	630,19	1.855,41
DE252 COPEL GT CDI -	298.002,28	938,41	- 883,72	0,00%	- 732,19	372,29	1.088,69
DE252 CORSAN CDI -	1.638.552,19	43.227,64	41.157,06	0,03%	32.836,97	- 16.436,23	- 47.536,58
DE252 COSAN LO CDI -	1.663.074,72	2.141,61	2.015,72	0,00%	1.670,50	- 846,24	- 2.468,23
DE252 CSAN CDI - CSAN23	1.153.707,82	7.543,05	7.220,91	0,01%	6.728,82	- 3.274,36	- 9.307,21
DE252 DASA CDI - DASAA2	2.661.475,75	1.442,43	1.355,01	0,00%	1.066,25	- 542,01	- 1.584,27
DE252 ECORODOV CDI -	1.841.810,69	52.063,97	50.105,04	0,04%	49.106,92	- 23.607,16	- 66.547,30
DE252 ECORODOV CDI -	2.192.574,15	1.006,50	928,83	0,00%	861,81	- 441,53	- 1.297,29
DE252 ELEKTRO CDI -	557.718,63	1.686,20	- 1.563,23	0,00%	- 1.396,64	715,70	2.103,66
DE252 ELETROB CDI -	2.097.599,10	4.597,77	4.355,68	0,00%	3.551,25	- 1.784,18	- 5.175,91
DE252 ENER TR CDI -	7.638.765,13	289.403,37	276.779,99	0,23%	263.653,48	- 127.813,23	- 362.515,87
DE252 ENERSUL CDI -	1.007.983,10	845,69	- 750,27	0,00%	- 913,87	473,59	1.402,56
DE252 EQUATENE CDI -	1.470.115,63	1.064,64	1.001,17	0,00%	797,29	- 404,88	- 1.182,73
DE252 GUAR CDI - GUAR24	2.724.713,28	5.290,71	4.979,43	0,00%	4.163,94	- 2.107,36	- 6.142,90
DE252 GUARIROB CDI -	1.091.536,65	1.027,57	972,67	0,00%	757,34	- 380,84	- 1.105,42
DE252 IGUATEMI CDI -	2.342.526,02	790,34	731,90	0,00%	678,61	- 348,16	- 1.023,79
DE252 IGUATEMI CDI -	2.138.905,82	8.567,24	- 8.114,11	-0,01%	- 6.534,33	3.301,12	9.612,14
DE252 INTERVIA CDI -	1.317.259,78	1.097,82	1.033,50	0,00%	824,99	- 418,12	- 1.219,83
DE252 LIGHT CDI - LIGHD3	1.659.570,61	7.138,25	6.808,17	0,01%	5.876,88	- 2.908,98	- 8.358,47
DE252 LOCALIZA CDI -	1.136.508,20	83,78	69,02	0,00%	- 57,46	29,80	88,45
DE252 LOCAMERI CDI -	1.999.350,21	4.041,95	3.815,30	0,00%	3.111,96	- 1.569,99	- 4.566,93
DE252 MOV_PART CDI -	1.110.949,80	2.810,99	2.661,49	0,00%	2.236,43	- 1.123,57	- 3.259,61
DE252 MOV_PART CDI -	1.212.246,80	7.994,11	7.632,89	0,01%	6.722,77	- 3.315,31	- 9.503,57
DE252 MOV_PART CDI -	1.453.955,31	110,93	95,80	0,00%	- 0,08	-	0,11
DE252 MULTIPLA CDI -	3.136.124,30	9.287,81	- 8.776,28	-0,01%	- 7.057,31	3.579,09	10.448,11
DE252 OMEGA GE CDI -	3.330.851,13	11.686,99	11.145,86	0,01%	9.640,61	- 4.771,06	- 13.707,71
DE252 OURO VER CDI -	1.533.853,81	3.896,06	3.685,24	0,00%	3.015,26	- 1.516,89	- 4.404,34
DE252 PROLAGOS CDI -	3.088.826,00	76.790,08	- 72.411,70	-0,06%	- 57.119,58	28.928,51	84.366,35
DE252 RD COLIN CDI -	3.237.144,50	91.503,50	87.199,35	0,07%	71.286,53	- 35.693,06	- 103.195,05
DE252 RENNER CDI -	1.419.403,19	1.157,27	1.087,81	0,00%	877,77	- 445,53	- 1.301,05
DE252 RT BANDE CDI -	3.464.683,54	7.661,23	7.262,36	0,01%	5.976,45	- 2.995,65	- 8.677,54
DE252 S LUIZ A CDI -	1.140.759,27	7.161,95	6.856,26	0,01%	6.389,09	- 3.108,81	- 8.836,20
DE252 SABESP CDI -	1.208.685,38	1.060,86	1.006,18	0,00%	787,69	- 394,80	- 1.143,48
DE252 SANEAMEN CDI -	2.609.163,76	3.420,43	3.219,40	0,00%	2.668,42	- 1.351,01	- 3.939,06
DE252 SBF COME CDI -	4.094.983,57	101.040,22	95.760,62	0,08%	72.583,74	- 36.754,52	- 107.079,58
DE252 SIMPAR CDI -	1.221.525,89	11.932,13	11.415,74	0,01%	10.475,32	- 5.117,96	- 14.584,42
DE252 SUL AME CDI -	663.033,59	713,90	- 640,85	0,00%	- 715,25	368,75	1.088,30
DE252 TELEF BR CDI -	5.095.398,11	71.741,56	65.388,31	0,05%	45.032,23	- 23.621,93	- 70.413,17
DE252 USIMINAS CDI -	3.409.360,23	27.314,35	25.416,04	0,02%	19.823,92	- 10.161,37	- 29.860,96
DE252 VAMOS CDI -	1.114.743,71	2.044,82	1.933,94	0,00%	1.580,03	- 795,56	- 2.311,27
DE252 VAMOS CDI -	293.193,98	2.528,53	2.420,21	0,00%	2.248,14	- 1.095,25	- 3.115,45
DE252 VIX LOGI CDI -	1.076.845,77	2.008,16	1.895,49	0,00%	1.567,54	- 791,41	- 2.303,27



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/12/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.748.294.883,27	VAR / PL:	3,240%
VAR:	121.456.892,97	ETL / PL:	4,0635%
ETL:	152.311.896,01	VAR / CDI:	9324,87%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	141.581.184,55	BAIXA 1:	302.935.467,30	Cenário 1:	369.539.600,21
				Cenário 2:	- 71.450.229,21
				Cenário 3:	- 364.484.444,75

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
LF selic	8.760.846,73	23.583,47	- 22.295,97	-0,02%	- 17.681,54	9.210,60	27.370,52
LF252 ABC CDI -	1.050.243,87	80,13	69,20	0,00%	- 0,06	0,00	0,08
LF252 ABC CDI -	1.050.243,87	80,13	69,20	0,00%	- 0,06	0,00	0,08
LF252 B.ALFA CDI -	1.022.085,74	77,98	67,34	0,00%	- 0,06	0,00	0,08
LF252 CNH CDI -	1.955.678,11	149,20	128,86	0,00%	- 0,11	0,00	0,15
LF252 DAYCOVAL CDI -	1.217.239,98	92,87	80,20	0,00%	- 0,07	0,00	0,09
LF252 DAYCOVAL CDI -	2.217.493,95	169,18	146,11	0,00%	- 0,12	-	0,17
LF252 PANAMERI CDI -	1.048.339,55	79,98	69,07	0,00%	- 0,06	0,00	0,08
LF252 PARANA B CDI -	1.583.774,45	120,83	104,35	0,00%	- 0,09	-	0,12
LFSN BRADESCO CDI -	3.451.476,62	263,32	227,42	0,00%	- 0,19	0,00	0,26
LFT	46.447.006,55	19.192,48	- 16.891,47	-0,01%	- 2,55	-	3,47
LFV TOYOTA CDI -	2.273.378,92	173,44	149,79	0,00%	- 0,13	-	0,17
CMTR33	5.421.751,68	43.645,57	- 22.801,02	-0,02%	2.774,29	- 1.014,74	- 6.165,24
CRI RB CAPIT IPCA M D -	7.703.903,55	139.998,48	120.019,87	0,10%	174.253,35	- 62.240,93	- 353.542,76
CRI REIT SEC IPCA -	2.573.638,31	106.945,34	98.763,22	0,08%	181.604,45	- 60.671,99	- 316.564,23
DE252 AEGEA SA IPCA -	12.012.480,83	232.729,25	196.447,54	0,16%	268.703,91	- 96.880,76	- 556.176,67
DE252 CCR IPCA - CCRDD1	4.658.985,81	80.045,48	61.868,11	0,05%	89.364,33	- 31.992,59	- 187.610,96
DE252 CEMIG - IPCA	2.575.662,28	32.629,91	21.757,76	0,02%	34.906,01	- 12.553,91	- 74.568,36
DE252 COM GAS IGPIM-100 -	36.894.558,28	883.522,49	597.891,98	0,49%	1.384.604,69	- 19.890,48	- 2.743.596,51
DE252 CSAN IPCA -	5.600.753,37	170.885,99	162.542,88	0,13%	273.630,91	- 94.071,00	- 516.006,51
DE252 CSMG IPCA -	13.113.331,84	205.852,87	159.481,79	0,13%	227.732,89	- 81.816,50	- 476.269,31
DE252 DUKE GEP - IPCA	14.142.379,16	140.511,60	64.017,20	0,05%	130.437,49	- 47.167,80	- 282.219,85
DE252 ECORODOV IPCA -	10.488.752,34	194.999,63	162.551,54	0,13%	226.753,44	- 81.951,53	- 469.170,35
DE252 ECORODOV IPCA -	3.105.990,54	53.363,66	41.245,41	0,03%	59.576,22	- 21.328,39	- 125.073,97
DE252 ECPT - IPCA ECPT11	3.064.748,16	16.182,61	2.057,10	0,00%	10.849,15	- 3.925,23	- 23.502,21
DE252 ECPT - IPCA ECPT21	464.235,45	4.273,74	2.863,01	0,00%	700,15	- 255,75	- 1.551,11
DE252 ECPT - IPCA ECPT31	613.614,01	4.221,17	106,55	0,00%	2.501,72	- 910,66	- 5.497,25
DE252 ECPT - IPCA ECPT41	1.009.298,94	10.137,39	4.573,48	0,00%	7.684,56	- 2.786,73	- 16.737,20
DE252 IMED - IPCA	1.039.366,51	9.394,50	5.658,79	0,00%	2.223,85	- 811,61	- 4.916,31
DE252 IRB IPCA - IRBR12	9.359.694,12	233.931,14	214.317,53	0,18%	296.690,70	- 106.396,56	- 595.511,42
DE252 LIGHT IPCA - LIGHD7	4.710.214,69	114.656,46	103.350,61	0,09%	144.412,93	- 51.045,37	- 295.562,52
DE252 LIGHT IPCA -	4.386.648,25	37.954,56	4.312,18	0,00%	32.169,23	- 11.553,67	- 69.324,65
DE252 LOCALIZA IPCA -	8.769.138,50	271.896,11	257.539,40	0,21%	445.959,19	- 151.828,54	- 840.997,95
DE252 LOCAMERI IPCA -	10.232.975,23	329.929,80	316.095,23	0,26%	516.996,13	- 180.743,25	- 962.703,32
DE252 MOV_PART IPCA -	3.020.421,14	101.543,67	97.996,47	0,08%	153.746,51	- 54.978,93	- 281.979,93
DE252 MOVIDA L IPCA -	6.118.782,68	219.583,23	210.573,03	0,17%	329.051,96	- 115.851,26	- 668.959,82
DE252 PETR IPCA - PETR45	14.008.644,04	226.127,22	166.993,45	0,14%	243.667,63	- 87.269,18	- 516.107,04
DE252 RD COLIN - IPCA	8.409.839,97	49.107,45	12.832,35	0,01%	54.559,57	- 21.714,11	- 109.244,58
DE252 SABESP - IPCA	10.291.680,03	69.480,91	22.921,71	0,02%	53.650,22	- 19.408,08	- 116.184,26
DE252 SABESP IPCA -	14.171.283,04	237.567,11	186.805,56	0,15%	267.921,95	- 96.193,70	- 561.954,29
DE252 SIMPAR IPCA M D -	930.273,72	31.861,72	30.806,41	0,03%	47.755,36	- 17.179,99	- 87.222,38
DE252 TRANS AL - IPCA	11.268.859,41	169.331,44	123.254,61	0,10%	177.829,43	- 64.034,38	- 380.976,24



Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/12/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.748.294.883,27	VAR / PL:	3,240%
VAR:	121.456.892,97	ETL / PL:	4,0635%
ETL:	152.311.896,01	VAR / CDI:	9324,87%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	141.581.184,55	BAIXA 1:	302.935.467,30	Cenário 1:	369.539.600,21
				Cenário 2:	- 71.450.229,21
				Cenário 3:	- 364.484.444,75

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
DE252 VAMOS IPCA -	5.715.915,92	188.918,36	181.233,31	0,15%	293.765,37	- 102.538,75	- 550.427,83
DE252 VAMOS IPCA -	2.367.374,43	82.093,57	79.327,83	0,07%	124.623,30	- 44.586,74	- 228.047,05
DEBI AESTUCAN IPCA -	4.905.502,35	198.048,70	185.956,97	0,15%	324.602,31	- 109.054,96	- 575.249,89
DEBI ANEMUS IPCA -	12.903.747,76	484.692,05	459.239,96	0,38%	758.770,28	- 264.743,11	- 1.337.175,12
DEBI ANET IPCA - ANET11	6.521.652,47	141.098,90	125.668,10	0,10%	185.623,69	- 65.426,08	- 373.919,66
DEBI B2W IPCA - BTOW15	6.748.117,80	234.486,64	225.740,34	0,19%	364.204,51	- 128.355,01	- 671.487,43
DEBI BRISANET IPCA -	5.562.456,93	133.445,17	121.656,79	0,10%	174.793,14	- 61.832,46	- 351.323,53
DEBI BRKA IPCA - BRKP28	7.035.925,80	218.066,12	199.815,81	0,16%	380.332,16	- 123.298,36	- 721.274,11
DEBI CAGECE IPCA -	4.830.261,77	76.117,42	34.308,40	0,03%	126.582,97	- 32.505,63	- 301.151,25
DEBI CART IPCA - CART13	4.568.369,93	152.861,19	145.819,34	0,12%	238.697,18	- 83.414,60	- 436.708,58
DEBI CEEE D IPCA - CEED21	4.151.226,87	118.171,20	111.979,86	0,09%	177.487,09	- 61.404,77	- 344.311,79
DEBI CELP IPCA - CEPEC1	2.171.291,83	69.373,12	66.148,40	0,05%	111.834,67	- 38.502,84	- 209.937,20
DEBI COELBA IPCA -	2.165.193,51	69.010,36	65.767,11	0,05%	111.461,76	- 38.325,50	- 209.408,66
DEBI COMGAS IPCA -	3.317.749,91	100.962,79	95.472,96	0,08%	163.914,21	- 55.491,95	- 312.636,90
DEBI CORSAN IPCA -	5.683.320,06	144.510,81	133.462,42	0,11%	212.393,97	- 72.812,91	- 419.561,14
DEBI CTEEP IPCA - CTEE29	892.586,39	30.613,15	28.021,79	0,02%	52.785,96	- 17.150,81	- 93.723,24
DEBI ECHOENER IPCA -	1.272.273,79	62.432,28	60.912,38	0,05%	80.416,66	- 32.595,60	- 130.941,06
DEBI ECHOENER IPCA -	1.715.723,85	38.719,26	35.140,96	0,03%	56.146,62	- 19.330,82	- 112.051,38
DEBI EDPM IPCA - MGSP12	5.425.630,94	143.810,34	129.828,35	0,11%	248.826,87	- 79.985,41	- 464.643,51
DEBI ELEKTRO IPCA -	2.159.082,27	68.647,23	65.385,02	0,05%	111.088,08	- 38.147,80	- 208.879,02
DEBI ELETROB IPCA -	11.176.035,01	312.254,89	293.477,74	0,24%	456.166,85	- 157.893,61	- 898.240,27
DEBI ENERGISA IPCA -	3.074.229,62	99.175,07	94.759,91	0,08%	158.673,36	- 54.904,93	- 296.895,34
DEBI ENERGMIR IPCA -	930.625,97	20.066,41	17.723,47	0,01%	24.847,67	- 8.899,43	- 50.459,35
DEBI ENSINOP IPCA -	1.766.175,48	52.727,59	50.366,99	0,04%	75.287,81	- 27.150,57	- 140.940,55
DEBI ENTREVIA IPCA -	23.138.398,35	763.276,60	735.030,48	0,61%	1.079.218,20	- 388.754,34	- 2.042.800,43
DEBI HAZTEC IPCA -	2.244.291,61	74.714,37	71.116,52	0,06%	116.535,37	- 40.664,04	- 213.485,44
DEBI HIDRO BR IPCA -	4.232.299,26	137.748,98	131.629,32	0,11%	220.357,91	- 76.171,60	- 412.561,39
DEBI HOLDARAG IPCA -	7.446.023,85	269.600,71	254.951,17	0,21%	430.426,75	- 148.441,80	- 771.104,34
DEBI IGUA SAN IPCA -	2.294.317,56	66.722,19	63.044,52	0,05%	104.222,10	- 35.972,70	- 194.833,00
DEBI JAGUARA IPCA -	1.518.919,04	31.805,40	27.861,51	0,02%	39.185,68	- 14.037,47	- 79.737,60
DEBI LAME IPCA - LAMEA6	7.086.616,08	239.689,20	231.165,27	0,19%	367.688,49	- 130.867,75	- 675.819,27
DEBI METRORIO IPCA -	10.074.443,37	302.054,86	286.299,52	0,24%	428.553,90	- 152.832,07	- 819.707,54
DEBI MG050 IPCA -	4.200.799,29	112.790,33	105.468,00	0,09%	163.060,16	- 57.069,80	- 316.751,24
DEBI MS 306 IPCA - CNRD11	9.863.178,80	345.800,61	326.294,99	0,27%	563.975,47	- 191.969,26	- 1.030.318,43
DEBI NEOENERG IPCA -	5.982.443,87	154.763,12	143.254,30	0,12%	234.905,93	- 79.622,00	- 469.993,31
DEBI NORTE EN IPCA -	7.252.791,08	202.717,42	191.829,99	0,16%	279.671,91	- 100.359,35	- 539.758,22
DEBI PAMPASUL IPCA -	1.194.207,67	25.859,49	23.244,96	0,02%	34.021,71	- 12.108,53	- 68.211,90
DEBI PAMPASUL IPCA -	3.550.438,88	137.359,53	131.156,47	0,11%	218.832,41	- 76.913,62	- 384.373,06
DEBI PAMPASUL IPCA -	2.483.105,05	80.171,73	76.118,46	0,06%	131.973,72	- 45.065,06	- 246.084,10
DEBI PARANAGU IPCA -	724.342,42	14.470,54	13.110,76	0,01%	19.882,35	- 7.023,73	- 39.324,56
DEBI QUATA IPCA -	6.531.577,07	150.430,23	134.928,92	0,11%	183.239,34	- 66.226,19	- 370.862,40
DEBI TAUBATE IPCA -	9.510.674,67	269.894,51	247.160,47	0,20%	440.890,81	- 146.332,93	- 822.501,45
DEBI TESC IPCA - CJEN13	9.914.082,64	360.750,20	346.940,88	0,29%	541.287,27	- 194.122,52	- 968.308,74
DEBI TUCANOHO IPCA -	3.474.951,74	141.379,56	133.609,23	0,11%	226.428,95	- 77.290,39	- 400.483,98
DEBI UTE GNA IPCA -	4.272.818,10	172.584,55	160.186,22	0,13%	289.639,16	- 96.583,01	- 510.054,13



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/12/2021

EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	3.748.294.883,27	VAR / PL:	3,240%
VAR:	121.456.892,97	ETL / PL:	4,0635%
ETL:	152.311.896,01	VAR / CDI:	9324,87%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	141.581.184,55	BAIXA 1:	302.935.467,30	Cenário 1:	369.539.600,21
				Cenário 2:	- 71.450.229,21
				Cenário 3:	- 364.484.444,75

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
DEBI VENSJOR IPCA -	1.336.940,29	29.198,39	27.011,34	0,02%	37.150,15	- 13.653,55	- 72.549,86
DEBI VIARONDO IPCA -	7.303.173,33	232.832,65	219.370,81	0,18%	374.705,52	- 127.213,22	- 702.339,28
ECCR32	3.306.334,03	33.208,78	14.982,13	0,01%	25.173,65	- 9.128,97	- 54.828,92
LF ipca	1.355.549,03	10.488,16	7.768,81	0,01%	10.782,63	- 3.909,97	- 23.481,32
LFS ITAU IPCA -	5.169.149,70	42.205,57	11.867,55	0,01%	28.525,53	- 10.365,54	- 62.425,42
LFS ITAU IPCA M D -	808.991,11	8.685,56	4.261,77	0,00%	6.790,53	- 2.460,86	- 14.766,76
LFS ITAU IPCA M D -	4.044.955,55	43.427,80	21.308,84	0,02%	33.952,65	- 12.304,32	- 73.833,78
LFS ITAU IPCA M D -	9.707.893,32	104.226,73	51.141,22	0,04%	81.486,37	- 29.530,37	- 177.201,07
LFS ITAU IPCA M D -	7.280.919,99	78.170,05	38.355,91	0,03%	61.114,77	- 22.147,78	- 132.900,80
LFS ITAU IPCA M D -	5.662.937,77	60.798,93	29.832,38	0,02%	47.533,71	- 17.226,05	- 103.367,29
LFS ITAU IPCA M D -	8.108.653,63	89.061,69	44.795,95	0,04%	70.203,98	- 25.435,74	- 152.582,95
LFSN BRADESCO IPCA -	12.049.142,34	277.872,74	240.589,89	0,20%	319.227,42	- 114.403,11	- 676.296,03
LFSN BRADESCO IPCA M D -	3.903.907,48	98.683,01	87.728,35	0,07%	118.255,10	- 42.277,97	- 249.127,29
NTNB	1.799.875.174,84	68.304.284,82	62.383.430,27	51,36%	196.642.464,67	- 63.331.278,28	- 328.767.914,35
IDIJQFM	14.606,23	85.636,64	22.133,17	-0,02%	- 17.096,53	- 17.096,53	- 10.818.093,98
IDIJQFN	50.521,61	223.035,49	57.630,74	0,05%	56.865,02	56.865,00	11.252.906,13
AB AMERICAN GROWTH	10.017.505,13	485.829,16	283.818,28	-0,23%	764.426,54	- 90.157,55	19.119.695,19
BR ELETRO FIDC S1	12.412,50	29.283,41	5.389,86	0,00%	- 11.091,15	-	- 39.438.872,17
FARM SYN AGRO FIDC	3.234.517,39	23.627,72	20.041,66	0,02%	87.460,55	-	20.319.176,98
FIDC CELG DIST SN B	3.291.465,32	35.456,81	13.678,38	-0,01%	- 463.150,16	- 1.945,46	- 53.792.707,95
FIDC CREDZ MZ4	1.051.542,36	13.529,78	2.901,43	0,00%	- 137.346,56	-	54.492.405,66
FIDC VERDECARD SN4	7.278.702,70	435,57	352,94	0,00%	- 145.671,16	-	2.285.112,52
FII HSI LOGISTICA	1.253.967,00	260.612,67	152.902,29	0,13%	591.743,74	-	2.319.842,93
FII VIA PQ SHOPPING	1.194.316,50	129.157,18	56.905,80	0,05%	51.213,15	195,52	12.515.855,21
FUNDSMITH EQ FUND	11.300.349,45	477.415,82	55.552,85	-0,05%	1.003.603,86	- 101.703,15	- 12.633.149,68
GLOBAL DOL FICFIA IE	3.959.062,11	707.906,22	627.738,05	-0,52%	- 1.790.251,94	-	952.659,42
LOOMIS US GROWTH	8.129.874,69	455.025,22	290.764,31	-0,24%	119.015,89	- 73.168,87	248.114,66
MFS MERIDIAN EUROPEA	7.189.380,45	416.703,02	122.726,79	-0,10%	337.507,06	- 64.704,42	- 115.171,15
PICTET GL FIC FIM IE	4.034.637,85	192.824,53	142.220,32	-0,12%	- 172.407,93	-	753.253,91
RB CAP CREDIT AL SN4	631.831,73	3.021,58	1.162,13	0,00%	22.812,30	-	220.293,03
SANEAGOIFR IV 1 FIDC	2.576.262,49	43.763,19	2.883,95	0,00%	- 600.104,41	-	202.732,03
WELLINGTON GLO QUAL	10.910.456,09	514.275,82	365.347,92	-0,30%	145.045,24	- 98.194,10	- 512.387,85
Total	4.071.424.832,73	208.605.847,85	121.456.892,97	100,00%	369.539.600,21	- 71.450.229,21	- 364.484.444,75



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/12/2021

EMBRAERPREV RENDA FIXA CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	2.050.757.442,61	VAR / PL:	3,256%
VAR:	66.781.655,78	ETL / PL:	4,0837%
ETL:	83.746.919,27	VAR / CDI:	9371,25%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	126.361.139,85	BAIXA 1:	287.434.597,10	Cenário 1:	252.000.740,61
				Cenário 2:	- 63.484.425,87
				Cenário 3:	- 403.796.226,40

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	5.000,00	8,59	4,77	0,00%	126,81	0,49	167,31
RECEBER	- 70.130,30	120,47	66,92	0,00%	- 1.778,66	6,85	2.346,72
COMPROMISSADA	130.017.018,34	224.389,46	124.867,04	-0,19%	3.304.662,02	8.990,13	4.361.651,56
GASP17	30.570.957,36	701.467,93	606.518,67	0,91%	1.922.591,41	13.495,40	3.296.237,61
CSMGC3	13.112.876,80	196.343,39	161.799,70	0,24%	560.304,80	80.535,97	915.055,51
DE252 PETR IPCA - PETR45	14.008.358,77	217.965,16	171.372,62	0,26%	598.950,97	85.901,21	984.858,07
SBESC7	10.057.012,06	73.218,15	29.726,82	0,04%	307.499,31	17.984,91	450.074,00
SBSPC2	8.022.410,20	128.308,14	107.466,68	0,16%	355.146,49	53.675,28	586.590,24
ELET42	11.175.693,75	292.200,92	279.504,31	0,42%	739.607,30	156.802,20	1.272.203,68
ENTV12	9.996.765,05	308.983,42	292.034,75	0,44%	719.809,05	166.982,38	1.217.091,85
IGSN15	2.294.288,10	62.445,33	59.804,74	0,09%	162.410,34	35.748,64	271.604,94
NEOE16	5.982.277,65	144.840,52	139.078,52	0,21%	386.629,80	79.037,77	670.173,55
LFS0120016V	5.170.543,50	44.955,92	17.831,69	0,03%	159.662,13	9.860,63	235.443,46
LFS012001GU	808.822,84	8.739,78	5.223,72	0,01%	27.304,09	2.381,88	41.831,79
LFS012001GZ	4.044.114,19	43.698,89	26.118,60	0,04%	136.520,46	11.909,41	209.158,94
LFS012001H2	9.705.874,06	104.877,35	62.684,64	0,09%	327.649,11	28.582,57	501.981,45
LFS012001H4	7.279.405,54	78.658,01	47.013,48	0,07%	245.736,84	21.436,93	376.486,09
LFS012001H6	5.661.759,87	61.178,45	36.566,04	0,05%	191.128,65	16.673,17	292.822,51
NTNB	1.684.559.774,68	63.051.205,14	63.018.702,60	94,37%	235.346.437,79	61.796.398,15	-377.493.040,57
11570	145.977.586,78	2.110.004,12	1.845.013,08	2,76%	6.510.341,89	916.003,13	- 10.622.100,00
Total	2.098.380.409,23	67.853.609,13	66.781.655,78	100,00%	252.000.740,61	- 63.484.425,87	-403.796.226,40



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/12/2021

EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	690.925.823,81	VAR / PL:	6,720%
VAR:	46.432.515,01	ETL / PL:	8,4276%
ETL:	58.228.267,04	VAR / CDI:	19339,51%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	1.760,33	BAIXA 1:	1.945,63	Cenário 1:	133.807.247,56
				Cenário 2:	267.244,37
				Cenário 3:	31.223.011,00

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	20.127,20	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	1.993.753,59	-	-	0,00%	-	-	-
ABEV3	20.768.896,61	2.703.825,76	1.496.068,91	-3,22%	4.823.431,74	21.388,10	8.973.963,69
ALPA4	318.666,89	33.877,48	22.586,71	0,05%	64.312,49	279,93	114.215,58
ALSO3	2.029.542,00	240.921,75	143.192,23	0,31%	79.499,18	304,05	103.250,20
AMER3	4.461.687,34	879.258,20	310.297,19	0,67%	779.068,08	-	1.329.303,95
ANIM3	123.480,00	41.369,01	35.493,15	0,08%	136.699,64	359,31	78.631,00
ASAI3	5.564.088,50	845.252,42	564.230,75	1,22%	147.494,92	-	206.888,72
AZUL4	409.671,30	82.632,00	57.590,66	0,12%	44.315,90	182,81	68.958,81
B3SA3	19.068.547,82	1.101.802,31	450.631,10	0,97%	1.636.938,27	6.671,38	2.473.534,32
UNT	12.684.084,43	1.814.869,08	1.439.528,23	3,10%	475.690,79	1.820,76	618.976,32
BBAS3	14.117.778,75	1.751.772,67	52.017,77	0,11%	2.522.512,48	9.051,10	2.826.363,14
BBDC3	1.146.789,07	79.114,05	3.715,33	0,01%	74.927,67	302,06	110.283,40
BBDC4	28.493.656,30	1.999.093,14	390.434,37	0,84%	565.617,67	2.227,24	787.021,54
BBRK3	20.130,00	5.144,99	2.367,05	0,01%	8.513,87	43,10	22.363,73
BBSE3	1.329.797,49	176.076,77	129.028,24	-0,28%	270.952,30	1.180,73	482.596,80
BEEF3	138.350,13	32.151,51	13.777,35	0,03%	46.664,71	156,86	45.142,85
BIDI11	1.705.731,08	230.749,94	23.161,50	-0,05%	957.522,79	5.471,30	3.521.169,51
BMGB4	189.696,00	49.893,83	40.418,76	0,09%	64.497,68	216,57	62.247,95
BPAN4	2.341.873,70	402.789,63	306.193,52	0,66%	392.031,59	1.672,07	662.008,75
BRAP4	322.492,19	116.251,86	103.604,81	0,22%	522.138,17	1.212,82	235.335,84
BRFS3	938.265,38	172.820,91	59.609,65	0,13%	91.532,79	375,41	140.444,39
BRKM5	782.396,75	268.086,18	243.926,99	0,53%	1.241.807,63	2.904,90	567.397,75
BRML3	5.180.648,14	629.815,67	238.658,23	0,51%	82.188,42	317,92	109.632,45
BRPR3	42.398,00	3.116,80	2.347,42	0,01%	118,22	0,46	161,18
CASH3	1.295.964,59	419.664,05	272.125,72	0,59%	359.036,22	-	717.963,60
CCRO3	663.702,28	56.271,43	28.466,83	0,06%	133.324,04	473,83	146.164,90
CESP6	5.282.382,78	891.295,00	731.119,26	-1,57%	2.102.404,14	10.441,28	5.245.447,81
CIEL3	2.197.207,03	330.907,97	247.028,66	0,53%	234.090,07	867,39	282.403,58
CMIG4	749.827,82	47.937,18	29.217,72	0,06%	113.961,20	413,72	131.152,96
CMIN3	387.436,22	83.574,73	76.837,49	0,17%	308.943,86	-	212.788,92
COGN3	231.976,06	26.461,13	20.655,04	0,04%	898,41	3,51	1.226,45
CPFE3	7.143.038,23	624.525,54	459.953,68	0,99%	1.930.106,62	6.663,87	1.982.113,48
CPL66	517.211,08	38.243,17	31.744,14	0,07%	91.689,01	329,19	102.876,21
CRFB3	1.928.134,49	129.125,75	41.867,50	0,09%	269.348,94	1.130,75	437.444,20
CSAN3	1.302.218,17	127.293,97	101.860,61	0,22%	316.329,88	1.104,49	333.166,73
CSED3	2.965.270,00	833.512,39	747.960,28	1,61%	1.972.046,24	-	1.482.179,20
CSNA3	823.704,61	271.595,07	257.136,82	0,55%	649.889,43	1.869,99	450.020,19
CVCB3	154.701,15	22.733,03	14.513,15	0,03%	19.191,69	79,87	30.508,13
CYRE3	4.325.260,37	887.631,08	802.958,33	1,73%	1.225.144,46	4.207,58	1.243.302,86
DXCO3	227.116,43	33.085,93	21.336,74	0,05%	64.137,27	-	65.138,31
ECOR3	127.393,96	14.389,42	5.082,88	-0,01%	34.898,62	158,90	69.428,73
EGIE3	5.246.828,18	177.021,09	92.015,87	-0,20%	112.579,96	443,67	156.951,63
ELET3	1.265.609,92	117.604,05	93.166,12	0,20%	123.474,97	459,41	150.388,62
ELET6	6.607.772,03	677.900,69	566.620,42	1,22%	639.223,41	2.379,25	779.239,64
ENBR3	248.290,81	20.188,88	12.900,79	-0,03%	14.327,07	54,31	18.224,56



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/12/2021

EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	690.925.823,81	VAR / PL:	6,720%
VAR:	46.432.515,01	ETL / PL:	8,4276%
ETL:	58.228.267,04	VAR / CDI:	19339,51%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	1.760,33	BAIXA 1:	1.945,63	Cenário 1:	133.807.247,56
				Cenário 2:	267.244,37
				Cenário 3:	31.223.011,00

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
ENEV3	3.249.598,81	223.161,99	19.473,42	0,04%	- 374.822,61	- 1.552,31	588.870,75
ENGI11	566.378,58	62.481,05	23.964,35	0,05%	132.511,61	464,40	- 140.744,43
EQTL3	5.712.247,10	260.161,03	171.664,73	0,37%	53.365,20	207,09	- 71.727,14
ESPA3	14.976,00	3.399,75	2.329,10	0,01%	- 5.164,36	-	11.628,99
EUCATEX PN	120.697,00	19.086,57	16.539,94	0,04%	49.232,85	161,09	- 44.874,08
EZTC3	106.702,32	23.730,26	22.011,75	0,05%	37.782,17	126,17	- 36.025,27
FLRY3	280.414,32	26.652,12	16.871,50	0,04%	- 34.559,70	- 143,75	54.877,49
GGBR4	8.597.307,04	1.257.337,49	891.233,67	1,92%	5.638.448,03	16.919,98	- 4.264.802,56
GNDI3	8.442.210,51	891.115,44	65.307,59	-0,14%	- 2.218.304,43	- 10.027,53	4.332.912,21
GOAU4	1.369.832,59	173.658,03	131.622,09	0,28%	751.263,50	2.337,10	- 613.657,60
GOLL4	146.179,16	30.791,84	24.721,54	0,05%	55.951,99	184,81	- 52.071,83
HAPV3	13.011.898,77	1.562.258,57	365.886,96	-0,79%	- 4.317.313,28	- 20.435,99	9.492.775,12
HBSA3	422.145,45	142.434,80	126.038,35	0,27%	211.105,21	667,93	- 178.845,73
HYPE3	3.626.289,38	388.240,76	308.502,74	0,66%	236.052,48	891,68	- 297.819,81
IGTI11	304.753,82	565.449,76	303.593,51	-0,65%	-	-	-
INTB3	3.115.858,00	293.613,52	86.333,53	0,19%	- 71.774,21	-	100.253,87
IRBR3	259.232,56	27.430,57	9.320,14	0,02%	- 31.400,37	- 130,46	49.718,07
ITSA4	14.650.323,64	666.160,30	403.283,31	0,87%	- 1.017.236,63	- 4.109,69	1.505.046,14
ITUB4	34.038.231,60	2.772.841,08	1.980.445,11	4,27%	- 3.593.252,60	- 14.801,60	5.572.003,64
JBSS3	17.702.635,72	2.195.558,60	244.301,68	-0,53%	327.262,81	1.264,28	- 435.217,17
JHSF3	87.531,33	17.712,76	15.836,95	0,03%	35.014,42	114,90	- 32.122,22
KLBN11	1.071.275,14	154.142,77	125.522,94	0,27%	576.106,82	1.798,83	- 474.333,39
LAME4	2.920.803,39	570.849,91	85.385,83	0,18%	60.437,73	233,23	- 80.169,79
LCAM3	1.806.577,66	274.245,41	184.993,26	0,40%	704.547,03	2.320,80	- 651.747,09
LREN3	9.497.134,94	1.603.719,01	1.120.057,38	-2,41%	- 4.203.377,83	- 21.615,68	11.517.411,18
LWSA3	3.002.863,66	922.911,52	218.760,10	0,47%	- 1.404.146,64	- 7.370,70	4.069.315,26
MDNE3	81.176,00	26.323,01	23.143,33	0,05%	35.798,90	115,70	- 31.765,65
MEGA3	1.237.853,10	61.743,14	27.970,87	0,06%	-	-	-
MGLU3	6.859.584,28	2.397.167,67	105.920,93	0,23%	- 4.927.071,14	- 33.795,39	31.504.997,61
MOV13	7.211.460,00	1.047.735,24	365.063,61	0,79%	1.309.844,12	4.693,86	- 1.463.333,58
MRFG3	394.459,09	84.309,61	45.352,29	-0,10%	- 115.874,85	- 534,50	238.327,74
MRVE3	399.885,29	56.155,60	41.296,99	0,09%	79.136,30	281,61	- 87.010,16
MULT3	4.796.255,98	472.882,64	104.150,29	-0,22%	- 454.029,75	- 1.859,22	694.006,04
NINJ3	57.452,00	35.723,33	17.613,90	0,04%	- 25.938,58	-	72.480,90
NTCO3	9.475.530,21	2.312.625,88	720.297,08	1,55%	- 4.439.358,47	- 23.320,94	12.892.376,01
PACUCAR_CBD ON ED	175.106,97	19.292,60	13.597,78	0,03%	- 4.146,29	- 16,36	5.796,03
PARD3	665.560,50	69.148,88	39.719,81	0,09%	1.284,61	5,00	- 1.741,69
PETR3	27.224.039,86	5.272.469,96	4.451.440,23	9,59%	32.954.499,28	84.319,93	-17.959.438,21
PETR4	37.140.906,87	6.473.000,96	4.971.401,74	10,71%	36.034.446,04	98.324,27	-22.362.077,68
PETZ3	253.436,46	22.948,63	11.499,49	0,02%	- 57.578,54	- 254,52	106.286,26
POSI3	43.663,52	11.850,48	10.664,17	0,02%	27.745,29	83,82	- 21.285,95
POWE3	37.135,00	6.918,36	2.251,97	0,00%	- 15.752,42	-	41.486,83
PRIO3	8.101.962,24	2.192.581,28	922.942,01	-1,99%	- 2.741.618,34	- 13.037,30	6.100.817,98
QUAL3	507.083,97	68.426,48	38.998,28	0,08%	- 46.634,58	- 190,69	71.032,04
RADL3	7.735.244,79	951.813,19	576.899,41	1,24%	1.074.805,19	3.924,61	- 1.253.522,55



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/12/2021

EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL CNPJ - 10679245000140

Dados Gerais

PL:	690.925.823,81	VAR / PL:	6,720%
VAR:	46.432.515,01	ETL / PL:	8,4276%
ETL:	58.228.267,04	VAR / CDI:	19339,51%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	1.760,33	BAIXA 1:	1.945,63	Cenário 1:	133.807.247,56
				Cenário 2:	267.244,37
				Cenário 3:	31.223.011,00

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
RAIL3	4.082.227,16	415.052,70	289.012,61	0,62%	887.508,15	3.132,10	- 957.600,34
RAPT4	3.558.838,00	268.452,34	125.886,87	0,27%	166.337,03	633,85	- 214.195,14
RDOR3	1.294.530,77	117.696,37	32.555,52	-0,07%	- 570.826,81	-	1.558.485,45
RECV3	1.546.490,00	429.665,59	330.523,44	0,71%	844.801,72	-	691.172,55
RENT3	7.273.004,59	1.083.514,81	783.157,02	1,69%	2.927.009,50	9.596,52	- 2.679.867,59
RRRP3	343.440,08	85.650,98	52.129,92	0,11%	49.792,98	181,33	- 57.714,57
SANB11	558.425,20	43.016,29	21.801,84	-0,05%	- 140.863,55	632,50	270.505,82
SBSP3	701.434,12	112.141,45	97.551,11	0,21%	432.771,64	1.315,40	- 336.362,61
SEER3	641.998,49	85.080,82	73.130,51	0,16%	69.435,80	257,10	- 83.623,39
SOMA3	3.504.370,54	336.977,69	96.149,68	0,21%	- 889.329,45	- 3.997,11	1.712.005,38
STBP3	6.349.625,00	1.625.241,95	1.442.572,85	3,11%	3.712.351,18	11.406,64	- 2.952.931,65
SULA11	2.314.155,90	292.873,00	571,64	0,00%	- 281.034,15	- 1.167,82	445.166,52
SUZB3	21.278.157,85	3.972.964,73	2.804.467,79	6,04%	12.887.815,75	39.320,12	-10.097.607,49
TAAE11	408.158,76	32.612,03	27.393,71	0,06%	84.451,63	299,37	- 92.046,16
TEND3	1.924.992,00	203.558,80	39.035,20	-0,08%	- 261.386,94	- 1.094,91	422.230,02
TIMS3	2.851.445,01	406.643,96	178.559,81	-0,38%	- 93.371,83	- 370,09	131.969,60
TOTS3	6.064.538,80	560.172,22	303.426,61	-0,65%	- 2.094.088,98	- 10.006,65	4.719.419,42
UGPA3	809.483,82	126.320,13	99.290,61	0,21%	425.166,19	1.333,35	- 353.369,72
USIM5	7.349.382,37	2.000.098,77	1.874.038,67	4,04%	7.418.550,07	20.022,28	- 4.502.228,70
VALE3	69.468.856,56	18.056.000,08	16.650.009,48	35,86%	58.796.386,96	166.280,69	-39.277.003,51
VBBR3	10.760.579,28	807.637,42	657.845,85	1,42%	81.471,02	-	109.730,55
VIIA3	430.413,75	69.429,34	32.520,47	0,07%	- 190.178,06	-	520.246,64
VIVT3	1.073.111,54	115.637,36	87.894,62	-0,19%	- 73.463,77	- 296,64	108.558,02
WEGE3	12.062.657,92	1.257.388,74	254.690,57	0,55%	- 888.007,51	- 3.595,55	1.320.875,15
WEST3	56.700,00	38.163,49	25.949,03	0,06%	- 5.687,50	-	8.758,38
YDUQ3	1.302.107,37	136.043,77	52.896,75	0,11%	- 1.441,04	5,62	1.960,78
INDG22	4.399.732,27	326.002,52	323.889,63	0,70%	-	-	-
COMPROMISSADA	20.163.342,03	551,98	136,65	0,00%	1.106,97	- 574,75	- 1.704,08
EMP AÇÃO PROVISÃO	35.849,97	338,65	293,00	0,00%	503,04	- 213,91	- 570,32
LFT	307.472,74	35,60	23,36	0,00%	- 0,02	0,00	0,02
18294	89.258.683,82	4.424.952,39	2.090.746,03	4,50%	- 9.068,40	- 13.938,01	30.416.724,32
Total	696.579.695,22	93.633.825,31	46.432.515,01	100,00%	133.807.247,56	267.244,37	31.223.011,00



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/12/2021

FIR F EMB II CNPJ - 11005764000196

Dados Gerais

PL:	1.866.872.618,97	VAR / PL:	3,779%
VAR:	70.556.271,24	ETL / PL:	4,7395%
ETL:	88.480.440,96	VAR / CDI:	10876,16%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	124.543.940,18	BAIXA 1:	282.375.534,67	Cenário 1:	290.220.485,76
				Cenário 2:	- 62.400.237,14
				Cenário 3:	- 448.997.656,98

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	5.000,00	27,02	11,17	0,00%	241,36	0,92	310,27
RECEBER	- 70.130,34	379,02	156,65	0,00%	- 3.385,36	12,89	4.351,89
COMPROMISSADA	130.017.099,48	702.121,97	289.545,54	0,41%	6.283.379,63	20.192,77	8.079.113,10
GASP17	30.570.976,44	720.445,49	652.844,71	0,93%	2.622.979,28	10.861,33	4.170.327,35
CSMGC3	13.112.884,98	221.834,67	194.742,83	0,28%	860.723,74	79.406,18	1.289.980,69
DE252 PETR IPCA - PETR45	14.008.367,51	241.260,13	205.012,51	0,29%	919.885,61	84.694,26	1.385.387,00
SBESC7	10.057.018,34	69.093,16	53.527,59	0,08%	537.907,64	17.118,38	737.625,31
SBSPC2	8.022.415,20	144.401,27	127.607,61	0,18%	538.941,71	52.984,08	815.968,11
ELET42	11.175.700,73	332.026,37	318.104,75	0,45%	995.645,11	155.839,37	1.591.740,96
ENTV12	9.996.771,29	349.167,58	332.482,89	0,47%	948.837,35	166.121,13	1.502.921,06
IGSN15	2.294.289,53	70.906,87	68.055,95	0,10%	214.973,04	35.550,98	337.203,61
NEOE16	5.982.281,39	164.827,58	158.398,36	0,22%	523.685,20	78.522,37	841.219,81
LFS0120016V	5.170.546,72	40.171,14	29.112,88	0,04%	278.120,40	9.415,13	383.280,27
LFS012001GU	808.823,34	8.663,94	6.931,55	0,01%	45.834,40	2.312,19	64.957,75
LFS012001GZ	4.044.116,71	43.319,68	34.657,76	0,05%	229.172,00	11.560,96	324.788,76
LFS012001H2	9.705.880,11	103.967,24	83.178,63	0,12%	550.012,81	27.746,31	779.493,03
LFS012001H4	7.279.410,09	77.975,43	62.383,97	0,09%	412.509,61	20.809,73	584.619,77
LFS012001H6	5.661.763,40	60.647,56	48.520,87	0,07%	320.840,80	16.185,35	454.704,26
NTNB	1.684.560.826,04	67.898.947,41	67.891.308,33	96,22%	273.940.181,44	61.651.290,20	-425.658.367,74
Total	1.952.404.040,98	71.250.183,52	70.556.271,24	100,00%	290.220.485,76	- 62.400.237,14	-448.997.656,98



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/12/2021

FIR F EMB V CREDITO PRIVADO CNPJ - 20726178000121

Dados Gerais

PL:	183.884.823,64	VAR / PL:	1,191%
VAR:	2.190.565,29	ETL / PL:	1,4939%
ETL:	2.747.058,19	VAR / CDI:	3428,19%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	3.380.339,45	BAIXA 1:	3.705.783,42	Cenário 1:	2.808.021,92
				Cenário 2:	- 930.257,89
				Cenário 3:	- 5.737.359,95

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	1.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	- 32.487,49	-	-	0,00%	-	-	-
COMPROMISSADA	4.367.814,56	119,57	16,08	0,00%	239,79	124,50	369,14
CMTR33	5.421.078,26	43.540,20	532,21	0,02%	2.774,29	1.014,74	6.165,24
17H0164854	7.703.539,67	136.897,52	136.173,14	6,22%	174.253,35	62.240,93	353.542,76
AEGP23	12.012.369,35	227.663,68	226.257,99	10,33%	268.703,91	96.880,76	556.176,67
CCRDD1	4.658.810,43	78.859,28	78.196,54	3,57%	89.364,33	31.992,59	187.610,96
CMDT33	2.575.489,70	32.320,81	31.412,65	1,43%	34.906,01	12.553,91	74.568,36
100 - GASP17	6.325.029,61	147.680,23	126.051,46	5,75%	237.360,80	3.409,80	470.330,83
GEPA24	14.144.372,42	140.315,00	122.981,53	5,61%	130.437,49	47.167,80	282.219,85
ERDV17	10.488.354,89	191.062,01	190.035,65	8,68%	226.753,44	81.951,53	469.170,35
ERDV36	3.105.873,62	52.572,85	52.131,02	2,38%	59.576,22	21.328,39	125.073,97
ECPT11	3.064.490,93	16.242,52	10.371,88	0,47%	10.849,15	3.925,23	23.502,21
ECPT21	464.144,67	4.273,29	670,84	-0,03%	700,15	255,75	1.551,11
ECPT31	613.645,30	4.195,63	2.359,69	0,11%	2.501,72	910,66	5.497,25
ECPT41	1.009.149,18	10.021,51	8.548,99	0,39%	7.684,56	2.786,73	16.737,20
SULM23	1.039.200,26	9.305,26	652,29	-0,03%	2.223,85	811,61	4.916,31
RDCO34	8.409.346,62	49.542,50	37.585,56	1,72%	54.559,57	21.714,11	109.244,58
SBESC7	233.884,15	1.576,94	1.234,44	0,06%	1.219,32	441,09	2.640,55
SBSPC2	6.148.062,84	101.383,33	100.919,98	4,61%	116.241,74	41.735,00	243.811,84
TAEE33	11.267.810,47	167.012,58	164.843,33	7,53%	177.829,43	64.034,38	380.976,24
ENMI21	930.599,82	19.594,09	19.320,61	0,88%	24.847,67	8.899,43	50.459,35
ENTV12	13.141.588,93	421.749,45	383.699,10	17,52%	612.949,31	220.795,67	-1.160.222,39
ENJG21	1.518.874,96	31.073,25	30.718,60	1,40%	39.185,68	14.037,47	79.737,60
ECCR32	3.305.843,45	32.829,19	28.005,41	1,28%	25.173,65	9.128,97	54.828,92
LFS012001IP	8.107.010,81	87.953,10	77.251,25	3,53%	70.203,98	25.435,74	152.582,95
LFSN16000GM	12.048.821,61	271.563,33	268.748,63	12,27%	319.227,42	114.403,11	676.296,03
D - LFSN1800DC5	3.903.867,75	96.193,44	94.524,83	4,32%	118.255,10	42.277,97	249.127,29
Total	145.977.586,77	2.375.540,56	2.190.565,29	100,00%	2.808.021,92	- 930.257,89	- 5.737.359,95



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/12/2021

FIM EMB I A CNPJ - 20725946000122

Dados Gerais

PL:	223.961.689,63	VAR / PL:	0,249%
VAR:	557.426,31	ETL / PL:	0,3121%
ETL:	699.035,33	VAR / CDI:	716,26%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	1.801.797,04	BAIXA 1:	1.786.532,43	Cenário 1:	7.290.711,11
				Cenário 2:	- 276.690,28
				Cenário 3:	- 10.179.861,68

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	9.000,00	15,46	12,63	0,00%	228,26	0,88	301,16
RECEBER	198.010,00	340,13	277,77	-0,05%	5.021,98	19,34	6.625,86
DI1J22	12.393.542,58	16.018,01	6.187,13	-1,11%	362.054,60	23.469,73	487.692,78
DI1N22	24.569.232,16	132.093,87	85.772,97	15,39%	827.164,63	102.652,11	1.131.875,13
DI1F23	25.314.303,92	453.228,61	358.305,38	64,28%	1.087.457,72	225.143,09	1.514.818,58
DOLG22	- 10.116.696,85	329.993,27	217.917,87	39,09%	-1.006.293,29	83.741,60	1.273.089,39
WDOG22	- 56.203,87	1.833,30	1.210,65	0,22%	- 5.590,52	465,23	7.072,72
COMPROMISSADA	184.706.698,90	318.775,48	259.854,34	-46,62%	4.694.717,82	12.771,69	6.196.313,92
DE252 AERIS CDI - AER11	1.286.580,91	1.339,10	164,52	0,03%	34.493,28	815,58	45.792,68
ANHB10	928.953,02	1.085,00	727,73	-0,13%	24.073,98	168,24	31.837,74
DE252 B3SA CDI - BSA313	1.734.855,19	2.423,09	1.836,03	-0,33%	44.523,53	97,39	58.833,11
DE252 BCBF CDI - BCBF14	272.599,21	263,51	62,22	-0,01%	7.218,25	127,58	9.571,40
CGBP13	2.419.469,30	4.852,70	3.358,44	0,60%	68.049,59	3.073,61	90.472,27
ELET13	2.097.597,77	2.424,45	865,97	0,16%	56.751,04	1.579,35	75.366,27
ETEN13	2.977.230,21	105.438,66	90.030,59	16,15%	178.271,51	49.526,08	240.919,97
EQTL13	1.470.115,21	1.758,57	1.179,74	-0,21%	38.082,71	261,33	50.376,11
GRRB14	1.091.536,21	1.152,30	676,24	-0,12%	28.441,15	274,25	37.630,69
IVIA35	1.317.259,51	1.491,77	937,98	-0,17%	34.233,65	289,49	45.298,31
LORTA1	603.455,68	999,10	811,88	-0,15%	15.274,48	74,75	20.146,03
MOVI33	1.453.955,31	2.393,54	1.946,68	-0,35%	36.875,50	141,98	48.652,52
OMGE13	1.118.396,02	2.400,93	1.705,39	0,31%	31.602,06	1.492,76	42.026,68
PRLG14	3.088.935,54	79.370,66	67.736,34	-12,15%	21.222,77	29.230,15	18.996,41
CBAN22	1.124.822,25	1.308,93	484,66	0,09%	30.468,30	862,71	40.456,29
SULM15	663.031,94	1.704,78	1.478,88	-0,27%	16.100,73	433,50	21.098,25
VIVT15	2.166.928,56	27.010,22	21.590,40	3,87%	74.109,82	9.834,51	102.456,16
VAMO22	1.114.743,17	1.115,58	129,54	0,02%	29.852,42	686,71	39.613,10
LF selic	3.043.083,94	5.009,60	4.074,35	-0,73%	77.179,28	297,16	101.828,24
LF0021006S0	1.022.085,74	1.682,58	1.368,46	-0,25%	25.922,34	99,81	34.201,22
LF002100HDP	1.217.239,98	2.003,85	1.629,75	-0,29%	30.871,88	118,86	40.731,51
LF002100HDQ	2.217.493,95	3.650,49	2.968,98	-0,53%	56.240,51	216,54	74.202,19
LFT	7.129.808,34	13.475,85	11.164,97	-2,00%	180.827,58	696,23	238.578,96
LF002100ISJ	2.273.378,92	3.742,49	3.043,80	-0,55%	57.657,88	222,00	76.072,22
NTNB	524.081,33	23.888,78	18.124,15	3,25%	89.335,39	24.127,77	140.971,63
IDIJQFM	21.929,61	166.428,80	64.284,98	-11,53%	- 21.373,43	21.927,47	36.556.765,03
IDIJQFN	- 61.195,77	491.964,32	190.026,70	34,09%	59.643,71	61.189,79	-36.953.031,45
Total	281.336.257,87	2.202.677,78	557.426,31	100,00%	7.290.711,11	- 276.690,28	-10.179.861,68



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/12/2021

FIM EMB II A CNPJ - 20725957000102

Dados Gerais

PL:	218.776.097,52	VAR / PL:	1,278%
VAR:	2.796.749,30	ETL / PL:	1,6031%
ETL:	3.507.237,66	VAR / CDI:	3678,82%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	- 3.586.706,94	BAIXA 1:	6.100.409,56	Cenário 1:	11.411.618,69
				Cenário 2:	- 1.710.395,49
				Cenário 3:	- 15.819.452,27

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	9.000,00	15,46	10,12	0,00%	228,26	0,88	301,16
RECEBER	- 42.821,27	73,56	48,15	0,00%	- 1.086,04	- 4,18	- 1.432,90
WSPH22	3.340.278,03	147.666,00	94.545,55	-3,38%	336.602,44	- 29.736,32	- 425.991,87
INDG22	8.359.385,00	607.542,69	480.989,02	17,20%	212.012,81	816,30	- 279.723,92
DI1J22	1.463.804,24	1.891,89	12,31	0,00%	42.762,35	- 2.772,02	- 57.601,51
DI1N22	664.033,30	3.570,10	3.253,98	0,12%	22.355,80	- 2.774,38	- 30.591,22
DI1V22	920.290,28	10.807,68	10.318,01	0,37%	35.353,10	- 6.070,54	- 48.910,53
DI1F23	12.075.728,02	216.204,46	207.633,41	7,42%	518.751,91	- 107.400,41	- 722.616,64
DI1N23	1.869.639,03	56.663,50	54.228,46	1,94%	95.658,10	- 24.324,81	- 134.181,13
DI1F24	2.682.955,55	113.259,16	107.004,33	3,83%	156.639,93	- 44.531,57	- 220.263,90
DI1N24	853.325,54	43.989,38	41.282,71	1,48%	56.356,12	- 17.373,18	- 79.224,09
DI1F25	1.183.081,09	72.288,80	67.212,80	2,40%	87.484,65	- 28.627,94	- 122.714,17
DI1F27	1.269.386,55	114.265,46	105.618,56	3,78%	136.686,36	- 50.881,50	- 187.677,27
DI1F29	1.277.771,35	143.795,71	132.486,83	4,74%	183.251,74	- 71.691,39	- 243.946,75
DI1F31	320.571,68	42.044,14	38.489,42	1,38%	57.658,13	- 22.972,00	- 74.166,38
WDOG22	2.079.543,24	67.831,95	9.939,47	-0,36%	206.849,18	- 17.213,55	- 261.690,60
COMPROMISSADA	61.620.136,70	106.346,92	69.642,11	-2,49%	1.566.208,24	4.260,77	- 2.067.156,81
LTN	5.472.943,34	165.869,52	158.741,49	5,68%	280.017,33	- 71.205,35	- 392.784,76
AEGP13	1.076.372,53	1.691,97	1.044,64	-0,04%	27.413,23	46,67	- 36.189,51
CPGT14	299.650,90	1.797,62	1.640,02	-0,06%	6.373,09	659,45	- 8.171,58
CPGT16	298.003,51	1.365,88	1.199,36	-0,04%	6.825,85	401,39	- 8.883,18
ERDV18	1.841.822,10	47.902,36	44.734,61	1,60%	95.819,67	- 23.427,31	- 128.178,83
ESUL18	1.007.981,22	2.380,20	1.917,59	-0,07%	24.650,80	572,02	- 32.326,77
LORTA1	533.052,51	882,54	572,82	-0,02%	13.492,46	66,03	- 17.795,66
VIVT15	2.928.281,84	36.500,30	34.473,51	1,23%	100.148,40	- 13.289,88	- 138.454,27
LF selic	3.772.164,35	12.061,09	9.987,44	-0,36%	90.894,48	2.856,20	- 118.832,21
LFT	38.217.704,61	81.196,54	55.340,34	-1,98%	969.284,82	3.731,97	- 1.278.847,88
NTNB	104.941.614,47	1.641.829,01	1.554.714,72	55,59%	6.107.436,16	- 1.164.364,00	-10.065.230,44
IDIFQG0	- 43,50	56,59	37,06	0,00%	42,40	3,95	-12.633.348,09
IDIFQG1	43,50	57,32	37,54	0,00%	- 42,40	3,99	13.039.196,11
IDIFQG7	60,00	85,78	56,18	0,00%	- 58,48	5,96	21.450.033,65
IDIFQG8	- 120,00	174,04	113,97	0,00%	116,96	12,08	-44.079.902,04
IDIFQG9	60,00	88,29	57,82	0,00%	- 58,48	6,12	22.632.096,98
IDIFQHM	- 70,00	296,36	194,07	0,01%	68,22	18,74	-56.467.880,58
IDIFQHN	70,00	310,75	203,50	-0,01%	- 68,22	19,52	57.167.578,29
IDJQFM	- 14.045,08	106.591,31	693,45	-0,02%	13.688,87	14.043,71	-23.413.215,71
IDJQFN	39.193,56	315.084,41	2.049,84	0,07%	- 38.199,52	- 39.189,73	23.667.009,26
Total	260.360.848,21	4.164.478,76	2.796.749,30	100,00%	11.411.618,69	- 1.710.395,49	-15.819.452,27



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/12/2021

FIM EMB VI A CRED PRIV CNPJ - 4183766000109

Dados Gerais

PL:	154.297.322,89	VAR / PL:	2,436%
VAR:	3.758.105,23	ETL / PL:	3,0544%
ETL:	4.712.817,20	VAR / CDI:	7009,15%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	5.480.197,06	BAIXA 1:	5.956.224,93	Cenário 1:	4.777.462,67
				Cenário 2:	- 1.849.971,11
				Cenário 3:	- 8.204.140,04

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	10.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	196.537,39	-	-	0,00%	-	-	-
DAPQ22	21.027.996,64	167.149,97	76.468,81	2,03%	112.482,59	- 40.881,06	- 246.261,59
DAPK23	28.555.749,24	401.286,98	314.904,94	8,38%	386.152,36	- 139.467,77	- 833.106,20
DI1N23	3.399.343,69	107.571,24	100.641,07	2,68%	87.708,81	- 44.558,87	- 130.215,97
DI1F24	7.886.263,28	344.086,64	318.709,70	8,48%	260.413,08	- 131.665,91	- 383.550,18
DAPQ24	26.198.625,94	532.541,89	503.272,22	13,39%	607.532,21	- 218.170,28	- 1.293.250,87
DI1F25	3.327.415,58	208.188,63	190.071,13	5,06%	161.659,84	- 80.840,99	- 233.790,77
DAPK25	9.643.521,40	234.800,36	231.464,71	6,16%	-	-	-
DI1F26	- 3.017.180,96	236.524,24	- 216.567,36	-5,76%	- 195.694,11	96.726,64	277.605,61
DAPQ26	5.560.333,66	164.059,99	161.300,24	4,29%	-	-	-
DI1F27	3.808.159,64	348.457,98	319.078,16	8,49%	313.475,57	- 153.016,37	- 435.602,17
DAPQ28	- 8.715.263,37	312.595,14	- 302.504,56	-8,05%	-	-	-
DI1F29	2.014.947,14	229.754,35	211.062,89	5,62%	237.870,30	- 113.248,57	- 317.260,57
DAPQ30	- 40,92	1,65	- 1,58	0,00%	- 2,95	1,03	5,83
DAPK35	- 318.859,60	17.254,28	- 16.004,07	-0,43%	-	-	-
COMPROMISSADA	15.418.663,59	422,09	111,89	0,00%	846,49	- 439,50	- 1.303,09
ALSCA0	4.074.317,00	74.337,39	67.875,82	1,81%	62.796,06	- 30.826,23	- 88.064,75
APRB28	1.388.882,04	1.240,17	1.139,93	0,03%	952,51	- 477,49	- 1.383,13
DE252 BCBF CDI - BCBF15	2.629.463,68	3.977,22	3.684,12	0,10%	3.198,82	- 1.618,52	- 4.717,11
DE252 BKBR CDI - BKBR18	1.462.529,26	1.102,62	1.019,50	0,03%	848,14	- 430,59	- 1.257,59
DE252 BRKA CDI - BRKP18	2.688.471,51	6.676,70	6.188,14	0,16%	5.371,85	- 2.716,45	- 7.914,12
BRML17	3.204.980,09	11.377,67	10.447,92	-0,28%	- 9.081,82	4.564,89	13.247,85
CCPRA3	2.165.131,86	3.918,35	2.870,38	-0,08%	- 3.076,24	1.443,45	3.992,45
CEAB11	2.126.613,01	2.643,25	2.447,46	0,07%	2.094,18	- 1.061,24	- 3.095,98
CELP15	2.575.945,07	378,52	336,38	0,01%	239,59	- 123,11	- 362,15
RSAN24	1.638.544,57	42.116,25	38.582,04	1,03%	32.836,97	- 16.436,23	- 47.536,58
RLOG11	1.663.074,28	2.090,02	1.936,11	0,05%	1.670,50	- 846,24	- 2.468,23
CSAN23	1.153.708,07	7.341,21	6.771,38	0,18%	6.728,82	- 3.274,36	- 9.307,21
DASAA2	2.661.475,77	1.408,79	1.300,48	0,03%	1.066,25	- 542,01	- 1.584,27
ERDVA0	2.192.574,78	983,26	910,12	0,02%	861,81	- 441,53	- 1.297,28
ELEK27	557.720,51	1.644,35	1.542,13	-0,04%	- 1.396,64	715,70	2.103,66
ETEV13	4.661.343,81	171.888,04	159.003,49	4,23%	160.891,22	- 77.996,42	- 221.220,75
GUAR24	2.724.711,98	5.162,24	4.786,17	0,13%	4.163,94	- 2.107,36	- 6.142,90
IGTA19	2.342.527,93	772,73	713,10	0,02%	678,61	- 348,16	- 1.023,79
IGTA37	2.138.910,97	8.354,01	7.678,47	-0,20%	- 6.534,33	3.301,12	9.612,15
LIGHD3	1.659.569,44	6.954,30	6.414,20	0,17%	5.876,88	- 2.908,98	- 8.358,47
LCAMA9	1.999.347,79	3.942,86	3.646,68	0,10%	3.111,96	- 1.569,99	- 4.566,93
MOVI16	1.110.949,35	2.741,24	2.534,73	0,07%	2.236,43	- 1.123,57	- 3.259,60
MOVI27	1.212.246,85	7.786,03	7.186,32	0,19%	6.722,77	- 3.315,31	- 9.503,57
MULP16	3.136.127,65	9.056,11	8.373,72	-0,22%	- 7.057,31	3.579,09	10.448,11
OMGE13	2.212.455,03	7.563,07	6.979,58	0,19%	6.403,59	- 3.169,09	- 9.105,08
DE252 OURO VER CDI -	1.533.852,72	3.799,88	3.509,85	0,09%	3.015,26	- 1.516,89	- 4.404,34
RDCO10	3.237.145,03	89.152,62	81.607,11	2,17%	71.286,52	- 35.693,06	- 103.195,05
LRENB1	1.419.402,87	1.129,86	1.045,35	0,03%	877,77	- 445,53	- 1.301,05
CBAN22	2.339.858,67	5.045,15	4.656,48	0,12%	4.036,17	- 2.023,10	- 5.860,34



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/12/2021

FIM EMB VI A CRED PRIV CNPJ - 41837660000109

Dados Gerais

PL:	154.297.322,89	VAR / PL:	2,436%
VAR:	3.758.105,23	ETL / PL:	3,0544%
ETL:	4.712.817,20	VAR / CDI:	7009,15%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	5.480.197,06	BAIXA 1:	5.956.224,93	Cenário 1:	4.777.462,67
				Cenário 2:	- 1.849.971,11
				Cenário 3:	- 8.204.140,04

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
RDORB9	1.140.759,41	6.970,24	6.429,01	0,17%	6.389,09	- 3.108,81	- 8.836,20
SBSPC3	1.208.685,11	1.034,87	949,89	0,03%	787,69	- 394,80	- 1.143,48
SNGO18	2.609.162,95	3.337,91	3.090,85	0,08%	2.668,42	- 1.351,01	- 3.939,06
SBFC11	4.094.974,88	98.559,79	90.136,98	2,40%	72.583,74	- 36.754,52	- 107.079,58
JSM LA5	1.221.525,42	11.615,12	10.720,91	0,29%	10.475,32	- 5.117,96	- 14.584,41
USIM17	3.409.300,37	26.666,57	24.791,23	0,66%	19.823,91	- 10.161,37	- 29.860,96
VAMO23	293.193,72	2.460,93	2.270,84	0,06%	2.248,14	- 1.095,25	- 3.115,45
VIXL14	1.076.845,26	1.959,02	1.813,64	0,05%	1.567,54	- 791,41	- 2.303,27
LF selic	1.945.608,67	17.077,54	15.751,01	-0,42%	- 12.905,28	6.722,76	19.977,36
LF002100BMM	1.050.243,87	78,99	59,31	0,00%	- 0,06	0,00	0,08
LF002100BMX	1.050.243,87	78,99	59,31	0,00%	- 0,06	0,00	0,08
LF0021003Q1	1.955.678,11	147,09	110,44	0,00%	- 0,11	0,00	0,15
LF002100E1F	1.048.339,55	78,85	59,20	0,00%	- 0,06	0,00	0,08
LF002100BC4	1.583.774,45	119,12	89,44	0,00%	- 0,09	0,00	0,12
LFSN210029N	3.451.476,62	259,60	194,91	0,01%	- 0,19	-	0,26
LSVEZ9	1.332.251,53	11.655,63	3.985,43	0,11%	9.771,03	- 3.509,29	- 21.056,55
LCAMD1	5.718.506,77	179.568,60	176.850,95	4,71%	288.921,50	- 101.007,74	- 538.003,42
DE252 MOV_PART IPCA -	1.818.022,53	59.500,80	58.699,77	1,56%	92.544,05	- 33.093,26	- 169.731,10
DE252 SIMPAR IPCA M D -	930.251,18	31.013,32	30.599,72	0,81%	47.755,36	- 17.179,99	- 87.222,38
DE252 VAMOS IPCA -	274.258,24	8.827,72	8.700,55	0,23%	14.095,37	- 4.919,99	- 26.410,47
DEBI ANEMUS IPCA -	3.031.368,65	110.828,85	108.674,35	2,89%	178.252,18	- 62.194,10	- 314.132,47
DEBI CART IPCA -	1.713.114,68	55.810,06	54.967,19	1,46%	89.511,44	- 31.280,48	- 163.765,72
DEBI CORSAN IPCA -	765.412,93	18.963,47	18.637,96	0,50%	28.605,25	- 9.806,45	- 56.506,55
DEBI ECHOENER IPCA -	1.272.258,89	60.603,25	59.178,30	1,57%	80.416,66	- 32.595,60	- 130.941,06
DEBI ECHOENER IPCA -	1.715.666,10	37.764,11	36.954,29	0,98%	56.146,62	- 19.330,82	- 112.051,38
DEBI ENSINOP IPCA -	1.766.146,53	51.310,07	50.991,98	1,36%	75.287,81	- 27.150,57	- 140.940,55
DEBI HAZTEC IPCA -	2.244.231,65	72.746,17	71.665,41	1,91%	116.535,37	- 40.664,04	- 213.485,44
DEBI HOLDARAG IPCA -	832.214,50	29.342,80	28.679,92	0,76%	48.108,39	- 16.591,20	- 86.185,61
DEBI METRORIO IPCA -	2.550.374,33	74.423,50	73.959,85	1,97%	108.490,56	- 38.690,20	- 207.513,06
DEBI NORTE EN IPCA -	2.892.502,04	78.675,31	78.151,44	2,08%	111.539,94	- 40.025,74	- 215.268,67
DEBI PARANAGU IPCA -	724.325,88	14.103,90	13.845,32	0,37%	19.882,35	- 7.023,73	- 39.324,56
DEBI TUCANOHO IPCA -	1.713.987,79	67.893,61	66.185,85	1,76%	111.684,55	- 38.122,96	- 197.536,02
DEBI UTE GNA IPCA -	4.272.781,31	168.169,98	161.331,84	4,29%	289.639,16	- 96.583,01	- 510.054,13
LF ipca	1.355.549,03	10.140,84	8.795,29	0,23%	10.782,47	- 3.909,92	- 23.480,98
NTNB	9.850.620,50	240.634,75	231.713,64	6,17%	497.378,82	- 171.270,81	- 965.155,21
IDIJQF5	3,58	14,19	0,66	0,00%	3,58	3,58	-2.421.928,61
IDIJQF6	3,58	15,07	0,70	0,00%	3,58	3,58	2.456.659,02
BR ELETRO FIDC S1	12.416,86	40.297,29	829,19	-0,02%	- 11.341,28	-	332.461,03
FARM SYN AGRO FIDC	3.235.813,55	23.716,98	16.937,33	0,45%	90.302,89	-	- 118.795,86
FIDC VERDECARD SM4	1.809.720,17	108,35	70,57	0,00%	- 37.705,53	-	- 52.527,17
RB CAP CREDIT AL SN4	632.175,66	3.188,77	672,61	-0,02%	23.955,27	-	- 31.157,17
Total	258.511.877,46	5.409.041,40	3.758.105,23	100,00%	4.777.462,67	- 1.849.971,11	- 8.204.140,04



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/12/2021

FIM EMB VII A CRED PRIV CNPJ - 41687175000104

Dados Gerais

PL:	237.593.223,96	VAR / PL:	2,691%
VAR:	6.392.704,10	ETL / PL:	3,3741%
ETL:	8.016.711,60	VAR / CDI:	7742,93%

Cenários de STRESS

ALTA 1: - 11.292.826,54	BAIXA 1: 12.272.110,09	Cenário 1: 8.897.773,73
		Cenário 2: - 3.539.097,84
		Cenário 3: - 16.913.117,75

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	1.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	- 134.342,60	-	-	0,00%	-	-	-
COMPROMISSADA	1.979.114,25	54,18 -	14,02	0,00%	108,65 -	56,41 -	167,26
LFT	785.180,35	420,02 -	342,40	-0,01%	- 0,04	-	0,06
21K0001807	2.573.606,61	104.217,62	101.992,91	1,60%	181.604,45 -	60.671,99 -	316.564,23
CSAN33	5.600.699,34	166.457,25	166.208,35	2,60%	273.630,91 -	94.071,00 -	516.006,51
DE252 IRB IPCA - IRBR12	9.359.549,62	227.874,51	224.543,01	3,51%	296.690,70 -	106.396,56 -	595.511,42
LIGHD7	4.710.046,89	111.774,65	109.542,27	1,71%	144.412,93 -	51.045,37 -	295.562,52
LSVE29	3.053.930,43	26.718,29	9.367,15	0,15%	22.398,20 -	8.044,38 -	48.268,10
LORTA7	8.768.898,50	265.009,68	264.637,30	4,14%	445.959,19 -	151.828,54 -	840.997,95
LCAMD1	4.514.189,24	141.751,45	141.429,59	2,21%	228.074,63 -	79.735,51 -	424.699,90
MOVI37	1.202.318,90	39.349,86	39.167,25	0,61%	61.202,46 -	21.885,67 -	112.248,83
MVLV16	6.118.782,68	213.847,30	212.112,24	3,32%	329.051,96 -	115.851,26 -	668.959,82
VAMO33	5.441.631,81	175.153,11	174.653,75	2,73%	279.670,01 -	97.618,76 -	524.017,36
VAMO34	2.367.320,66	79.912,98	79.484,79	1,24%	124.623,30 -	44.586,74 -	228.047,05
TCII11	4.905.468,28	192.913,69	191.227,40	2,99%	324.602,31 -	109.054,96 -	575.249,89
ANEM11	9.872.330,19	360.938,93	358.870,31	5,61%	580.518,10 -	202.549,01 -	1.023.042,65
DEBI ANET IPCA - ANET11	6.521.338,76	137.703,48	134.402,78	2,10%	185.623,69 -	65.426,08 -	373.919,66
DEBI B2W IPCA - BTOW15	6.748.025,36	228.331,04	227.478,64	3,56%	364.204,51 -	128.355,01 -	671.487,43
BRST11	5.562.219,67	130.049,80	128.145,86	2,00%	174.793,14 -	61.832,46 -	351.323,53
DEBI BRKA IPCA - BRKP28	7.035.724,54	212.985,69	210.892,41	3,30%	380.332,16 -	123.298,36 -	721.274,11
CAEC21	4.829.292,01	76.403,62	50.311,69	0,79%	126.582,97 -	32.505,63 -	301.151,25
CART13	2.855.191,14	93.016,77	92.853,80	1,45%	149.185,74 -	52.134,13 -	272.942,86
CEED21	4.151.173,38	115.044,12	114.574,72	1,79%	177.487,09 -	61.404,77 -	344.311,79
DEBI CELP IPCA - CEPEC1	2.171.236,66	67.583,95	67.474,45	1,06%	111.834,67 -	38.502,84 -	209.937,20
CEEBC3	2.165.138,38	67.232,63	67.126,45	1,05%	111.461,76 -	38.325,50 -	209.408,66
GASP19	3.317.779,67	98.357,91	98.212,85	1,54%	163.914,21 -	55.491,95 -	312.636,90
RSAN44	4.917.778,08	121.840,32	120.983,90	1,89%	183.788,72 -	63.006,46 -	363.054,59
CTEE29	892.556,05	29.874,92	29.461,79	0,46%	52.785,96 -	17.150,81 -	93.723,24
MGSP12	5.425.521,85	140.520,47	138.707,77	2,17%	248.826,87 -	79.985,41 -	464.643,51
EKTRC0	2.159.027,18	66.880,95	66.777,72	1,04%	111.088,08 -	38.147,80 -	208.879,02
ENGIA5	3.074.152,19	96.605,82	96.428,49	1,51%	158.673,36 -	54.904,93 -	296.895,34
HBSA21	4.232.199,29	134.181,06	133.929,53	2,10%	220.357,91 -	76.171,60 -	412.561,39
HARG11	6.613.625,20	233.187,84	231.946,13	3,63%	382.318,35 -	131.850,60 -	684.918,73
LAMEA6	7.086.468,25	233.374,54	232.342,08	3,63%	367.688,49 -	130.867,75 -	675.819,27
MTRJ19	7.523.984,59	219.560,42	218.750,25	3,42%	320.063,34 -	114.141,87 -	612.194,48
CRMG15	4.200.729,44	109.858,82	109.337,33	1,71%	163.060,16 -	57.069,80 -	316.751,24
CNRD11	9.863.076,02	336.888,24	335.592,38	5,25%	563.975,47 -	191.969,26 -	1.030.318,43
NTEN11	4.360.070,95	118.592,81	117.963,25	1,85%	168.131,97 -	60.333,61 -	324.489,55
UTPS11	1.194.144,82	25.222,27	24.705,46	0,39%	34.021,71 -	12.108,53 -	68.211,90
UTPS21	3.550.348,42	133.677,96	132.529,38	2,07%	218.832,41 -	76.913,62 -	384.373,06
UTPS22	2.483.037,61	78.120,25	78.028,08	1,22%	131.973,72 -	45.065,06 -	246.084,10
DEBI QUATA IPCA -	6.531.360,12	146.661,47	143.050,80	2,24%	183.239,34 -	66.226,19 -	370.862,40
LTTE15	9.510.227,66	263.344,47	261.455,20	4,09%	440.890,81 -	146.332,93 -	822.501,45
DEBI TESC IPCA - CJEN13	9.913.966,37	350.951,91	349.113,39	5,46%	541.287,27 -	194.122,52 -	968.308,74
TNHL11	1.760.946,36	69.753,71	69.254,74	1,08%	114.744,40 -	39.167,43 -	202.947,96



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/12/2021

FIM EMB VII A CRED PRIV CNPJ - 41687175000104

Dados Gerais

PL:	237.593.223,96	VAR / PL:	2,691%
VAR:	6.392.704,10	ETL / PL:	3,3741%
ETL:	8.016.711,60	VAR / CDI:	7742,93%

Cenários de STRESS

ALTA 1: - 11.292.826,54	BAIXA 1: 12.272.110,09	Cenário 1: 8.897.773,73
		Cenário 2: - 3.539.097,84
		Cenário 3: -16.913.117,75

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
VSJH11	1.336.910,20	28.417,11	28.067,46	0,44%	37.150,15 - 13.653,55	- 72.549,86	
VRDN12	7.303.087,26	226.888,40	226.738,41	3,55%	374.705,52 - 127.213,22	- 702.339,28	
FIDC CELG DIST SN B	3.294.028,73	35.432,92	8.716,27	-0,14%	- 480.001,95 - 2.021,97	786.109,93	
FIDC CREDZ MZ4	1.051.986,34	15.690,66	704,49	0,01%	- 142.615,47	- 230.303,97	
FIDC VERDECARD SM4	5.467.078,45	327,33	211,26	0,00%	- 113.906,61	- 158.682,09	
SANEAGOIFR IV 1 FIDC	2.577.472,93	51.394,97	8.589,95	-0,13%	- 621.273,97	- 1.171.950,63	
Total	232.800.629,03	6.600.352,19	6.392.704,10	100,00%	8.897.773,73 - 3.539.097,84	-16.913.117,75	



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/12/2021

FIM EMB III A IMOBILIÁRIO CNPJ - 32711990000162

Dados Gerais

PL:	89.401.961,31	VAR / PL:	1,437%
VAR:	1.284.273,26	ETL / PL:	1,8014%
ETL:	1.610.531,03	VAR / CDI:	4133,95%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	3,34	BAIXA 1:	3,41	Cenário 1:	33.486.467,39
				Cenário 2:	100.487,16
				Cenário 3:	-34.938.617,75

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	1.000,00	90,73	64,29	-0,01%	168,67	0,61	190,87
RECEBER	- 46.278,18	4.198,63	2.975,08	0,23%	- 7.805,54	28,13	8.833,34
AIEC11	2.021.397,00	130.009,33	87.594,55	-6,82%	270.554,20	1.228,69	286.098,72
BLCP11	1.526.877,30	138.527,29	98.158,20	-7,64%	257.531,89	928,10	291.442,46
BMLC11	2.027.821,20	183.975,87	130.362,32	-10,15%	342.023,97	1.232,59	387.060,04
BPML11	1.165.343,31	114.670,34	55.919,26	-4,35%	- 39.426,37	319,22	197.080,76
CBOP11	43.029,00	2.145,70	258,28	0,02%	13.337,62	48,33	15.287,14
CEOC11	856.200,00	71.653,22	59.541,62	4,64%	334.925,67	1.191,33	367.987,48
CNES11	530.541,00	53.693,39	32.111,40	-2,50%	7.732,68	23,54	34.198,67
GALG11	1.300.861,80	62.751,29	34.983,49	-2,72%	365.129,97	790,72	423.081,15
GALG13	492,10	40,79	27,83	0,00%	83,00	0,30	93,93
HBRH11	2.385.752,80	216.449,53	153.372,64	-11,94%	402.394,76	1.450,16	455.380,18
HSML11	9.040.545,60	679.920,62	424.134,62	33,03%	3.262.549,38	11.693,99	3.646.863,12
JRDM11	1.176.897,30	92.738,29	56.713,36	4,42%	559.402,17	1.943,24	583.283,29
LVBH11	4.038.344,57	432.119,28	367.923,22	28,65%	2.361.150,42	7.934,94	2.291.969,49
MALL11	7.692.568,63	687.988,09	579.103,87	45,09%	4.753.763,97	15.812,92	4.514.958,28
MAXR11	1.467.419,35	57.174,67	7.477,48	-0,58%	297.808,92	1.084,81	345.791,81
NEWU11	600.237,00	54.457,03	38.587,37	-3,00%	101.239,42	364,85	114.570,14
PATC11	8.201.927,02	441.182,69	279.980,99	-21,80%	2.114.343,50	7.715,76	2.463.927,29
QAGR11	8.384.942,23	398.721,23	136.637,97	-10,64%	2.222.974,50	5.096,70	2.586.644,47
RBGS11	494.859,30	38.772,61	9.929,29	-0,77%	- 37.000,24	237,12	133.649,72
RBRL11	1.953.012,14	143.931,32	60.559,54	4,72%	654.450,27	1.187,12	741.448,37
RCRB11	1.625.466,00	111.278,19	8.929,02	-0,70%	442.724,27	1.613,43	514.227,22
RNGO11	140.582,38	7.998,46	317,62	0,02%	19.917,44	70,46	21.508,77
SDIL11	382.570,89	12.659,50	3.097,23	-0,24%	131.311,11	472,60	148.158,05
TEPP11	8.330.280,00	655.111,53	565.875,53	44,06%	4.918.765,86	16.500,76	4.756.555,80
TRXF11	13.375.098,45	387.577,27	99.120,19	-7,72%	4.209.107,53	15.239,42	4.814.466,78
VISC11	6.829,68	174,67	33,93	0,00%	2.209,85	7,99	2.517,53
VVPR11	1.339.880,00	121.561,80	86.136,72	-6,71%	225.991,85	814,43	255.749,38
XPIN11	4.063.318,39	324.762,94	221.834,06	17,27%	2.096.595,55	2.469,85	2.129.053,89
XPPR11	3.582.900,00	310.199,98	242.407,02	18,88%	2.046.647,44	2.177,83	2.004.314,73
COMPROMISSADA	115.290,57	10.460,40	7.413,04	-0,58%	19.451,90	66,79	22.015,81
FII HSI LOGISTICA	1.253.967,00	161.685,43	98.808,40	7,69%	805.020,71	762,21	752.707,00
FII VIA PQ SHOPPING	1.964.779,90	178.256,39	126.309,60	-9,84%	331.391,06	1.194,27	375.027,04
Total	91.044.753,73	6.286.938,49	1.284.273,26	100,00%	33.486.467,39	100.487,16	-34.938.617,75



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/12/2021

FIA RVA EMB II CNPJ - 13294268000125

Dados Gerais

PL:	401.476.829,63	VAR / PL:	0,598%
VAR:	2.402.807,69	ETL / PL:	0,7505%
ETL:	3.013.218,81	VAR / CDI:	1722,32%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	262,59	BAIXA 1:	267,64	Cenário 1:	207.913.504,20
				Cenário 2:	469.675,32
				Cenário 3:	- 19.940.750,91

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	10.000,00	805,10	562,98	0,02%	2.693,04	6,38	- 399,46
RECEBER	1.318.213,95	106.129,77	74.212,18	3,09%	355.000,12	841,33	- 52.657,00
ABEV3	17.315.195,10	3.292.742,47	2.545.285,26	105,93%	641.715,45	- 6.780,25	6.789.997,34
AMER3	2.100.070,00	400.420,84	116.338,77	4,84%	198.857,70	1.340,34	541.800,79
ASAI3	4.192.560,00	498.225,99	131.065,73	-5,45%	1.017.934,70	2.675,84	- 11.583,45
B3SA3	12.947.231,06	1.065.968,14	849.367,22	35,35%	2.375.285,20	3.733,63	1.162.302,76
UNT	9.370.200,00	883.849,75	307.531,16	-12,80%	2.874.841,41	7.325,46	- 831.559,96
BBAS3	12.010.255,00	1.710.997,11	647.015,68	26,93%	5.380.356,08	15.365,31	- 2.884.197,56
BBDC4	22.925.041,11	2.172.830,32	1.483.323,38	61,73%	5.718.725,27	12.839,62	- 282.546,08
BPAN4	2.155.224,00	266.736,12	121.762,37	-5,07%	219.623,89	- 163,27	523.154,02
CASH3	1.205.280,00	341.796,92	31.066,63	-1,29%	- 9.326,24	769,25	619.578,61
CESP6	2.852.226,00	690.165,96	505.080,98	21,02%	- 367.078,98	- 3.817,38	2.718.348,72
CIEL3	2.063.172,00	226.461,38	20.775,49	-0,86%	775.430,20	2.131,27	- 347.591,16
CPFE3	5.379.415,00	327.078,71	84.167,31	3,50%	2.902.258,66	8.451,89	- 1.707.612,30
CSED3	2.801.260,00	592.424,41	268.726,78	-11,18%	2.617.361,91	1.787,87	- 1.512.097,76
CYRE3	2.736.252,00	387.152,20	130.576,91	-5,43%	1.511.935,78	4.408,18	- 895.841,47
EGIE3	4.743.635,00	489.851,92	365.555,70	15,21%	1.175.696,20	2.626,44	- 47.588,61
ELET6	4.060.230,00	234.859,70	79.426,94	-3,31%	1.486.214,65	4.053,35	- 641.002,57
ENEV3	2.329.090,00	247.954,10	198.852,02	8,28%	358.585,76	373,92	329.025,08
GGBR4	7.060.340,00	693.903,94	186.337,43	-7,75%	6.531.822,20	18.401,31	- 3.784.401,04
GNDI3	6.041.035,00	865.799,37	745.325,42	31,02%	39.510,85	- 3.319,85	2.859.210,28
HAPV3	10.934.292,00	1.803.977,09	1.576.968,33	65,63%	- 683.321,75	- 10.194,32	7.540.287,83
INTB3	3.115.858,00	349.646,92	222.172,34	9,25%	767.338,41	1.988,65	- 24.211,32
ITSA4	10.215.696,75	659.203,92	304.684,39	12,68%	2.041.805,76	3.654,33	641.398,01
ITUB4	26.014.390,15	1.563.234,23	954.671,54	39,73%	4.259.561,73	5.290,91	3.219.350,22
JBSS3	15.187.590,00	2.415.118,01	713.067,82	29,68%	4.370.844,75	10.777,93	- 980.064,27
LAME4	2.663.458,00	547.938,89	263.144,84	10,95%	772.392,24	1.912,60	- 179.499,96
LREN3	6.196.762,00	1.455.706,87	1.190.891,29	49,56%	- 1.073.839,58	- 10.148,97	7.267.432,91
LWSA3	2.710.960,00	823.469,99	51.028,63	-2,12%	- 537.579,73	- 4.923,98	3.565.452,26
MGLU3	5.788.274,00	2.101.943,89	668.198,08	27,81%	- 2.598.770,66	- 24.823,03	26.353.420,32
MOVI3	7.211.460,00	992.223,46	405.575,37	16,88%	3.251.918,20	9.296,48	- 1.751.400,53
MULT3	4.533.984,00	647.450,72	541.824,54	22,55%	791.817,24	1.136,20	474.942,71
NTCO3	3.900.962,00	922.855,90	99.878,55	-4,16%	- 777.086,41	- 7.111,22	5.151.809,66
PETR3	21.235.190,00	2.679.148,67	1.942.169,28	-80,83%	31.423.759,58	79.323,97	-14.856.906,27
PETR4	28.505.733,55	3.318.130,30	2.005.071,02	-83,45%	35.333.226,61	93.657,50	-18.301.629,33
PRI03	6.017.037,00	1.905.607,60	625.760,66	26,04%	- 415.690,34	- 5.842,04	4.290.504,01
RADL3	6.398.190,00	645.393,21	184.071,80	7,66%	2.612.079,97	7.329,79	- 1.292.428,60
RAPT4	3.558.838,00	292.222,93	198.040,48	8,24%	1.124.745,88	2.905,23	- 356.355,48
RENT3	1.982.200,00	207.659,05	974,05	-0,04%	1.331.547,47	3.880,57	- 809.557,17
STBP3	6.349.625,00	1.193.879,14	612.784,93	-25,50%	5.422.329,76	15.459,20	- 3.206.571,98
SUZB3	14.282.136,00	1.956.222,33	316.805,73	-13,18%	12.496.679,64	35.507,48	- 7.348.136,54



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/12/2021

FIA RVA EMB II CNPJ - 13294268000125

Dados Gerais

PL:	401.476.829,63	VAR / PL:	0,598%
VAR:	2.402.807,69	ETL / PL:	0,7505%
ETL:	3.013.218,81	VAR / CDI:	1722,32%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	262,59	BAIXA 1:	267,64	Cenário 1:	207.913.504,20
				Cenário 2:	469.675,32
				Cenário 3:	- 19.940.750,91

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
TIMS3	2.305.195,00	444.850,87	332.817,07	13,85%	545.313,30	1.172,06	14.605,58
TOTS3	5.300.777,12	824.276,92	654.842,62	27,25%	- 402.841,81	5.363,27	3.913.317,32
USIM5	5.923.012,00	1.158.917,45	861.723,02	-35,86%	7.573.845,66	19.916,63	- 3.865.033,75
VALE3	52.942.246,20	9.742.698,74	7.602.606,86	-316,41%	59.066.304,19	160.512,24	-32.047.837,75
VBBR3	3.978.260,00	202.203,60	108.760,49	4,53%	1.101.481,21	2.539,07	- 199.482,59
WEGE3	9.547.710,00	1.148.145,42	102.500,21	4,27%	1.868.368,75	3.247,78	664.095,28
COMPROMISSADA	9.057.920,18	729.337,14	510.040,42	21,23%	2.439.830,24	5.522,90	- 362.590,65
Total	401.473.682,17	56.227.617,50	2.402.807,69	100,00%	207.913.504,20	469.675,32	-19.940.750,91



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/12/2021

FIA RVA EMB III CNPJ - 38452593000108

Dados Gerais

PL:	94.727.033,37	VAR / PL:	3,723%
VAR:	3.526.535,76	ETL / PL:	4,6686%
ETL:	4.422.419,64	VAR / CDI:	10713,44%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	192,78	BAIXA 1:	196,49	Cenário 1:	32.495.764,92
				Cenário 2:	64.925,09
				Cenário 3:	3.997.460,39

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	1.000,00	80,51	58,49	0,00%	269,30	0,64	39,95
RECEBER	336.511,15	27.092,61	19.683,09	0,56%	90.623,75	214,77	13.442,18
ALSO3	2.029.542,00	205.787,66	136.698,89	3,88%	626.062,69	1.599,37	184.321,72
AMER3	1.717.952,00	327.562,31	163.297,64	4,63%	162.674,57	1.096,46	443.217,49
ANIM3	123.480,00	32.823,04	22.159,87	-0,63%	169.953,28	438,12	83.563,50
ASAI3	843.501,60	100.238,14	2.905,92	-0,08%	204.798,39	538,35	2.330,48
B3SA3	2.649.938,64	218.174,08	181.485,71	5,15%	486.154,92	764,17	237.891,10
UNT	1.911.000,00	180.256,22	27.022,79	-0,77%	586.307,86	1.493,99	169.592,01
BBDC4	941.290,00	89.215,26	41.621,03	1,18%	234.807,82	527,19	11.601,19
BBRK3	20.130,00	4.752,24	1.231,36	0,03%	3.092,78	30,26	21.559,62
BBSE3	614.200,00	123.927,06	90.201,66	2,56%	40.260,39	153,35	198.364,66
BIDI11	859.957,00	144.878,32	114.508,57	3,25%	251.152,48	2.209,54	1.740.872,18
BMBG4	189.696,00	39.071,65	10.833,43	-0,31%	115.583,54	337,64	69.825,49
BRML3	4.823.265,27	587.687,65	421.930,14	11,96%	1.375.442,72	3.374,37	294.738,34
BRPR3	42.398,00	2.567,52	1.904,65	0,05%	11.299,73	26,60	1.532,44
CESP6	2.430.156,78	588.035,97	443.475,03	12,58%	312.759,04	3.252,49	2.316.090,51
CPFE3	1.505.163,00	91.516,79	24.424,36	0,69%	812.053,42	2.364,84	477.790,77
CRFB3	1.606.374,00	146.603,22	102.802,76	2,92%	208.201,82	83,19	300.277,24
CSED3	164.010,00	34.685,65	14.399,60	-0,41%	153.243,01	104,68	88.531,29
CYRE3	1.360.725,18	192.528,96	20.019,30	-0,57%	751.878,51	2.192,17	445.497,73
ELET3	651.495,00	37.347,49	3.099,43	-0,09%	239.011,04	652,30	103.439,63
ELET6	2.135.747,00	123.540,02	21.291,67	-0,60%	781.773,07	2.132,13	337.177,77
EQTL3	4.540.088,00	283.373,00	191.686,42	5,44%	1.265.077,87	3.062,24	238.365,73
ESPA3	14.976,00	2.832,25	949,23	0,03%	1.131,26	9,56	11.030,77
EUCATEX PN	120.697,00	11.493,38	4.370,31	-0,12%	81.737,02	238,12	49.695,41
GNDI3	567.290,00	81.303,84	74.647,91	2,12%	3.710,31	311,17	268.497,27
GOAU4	961.610,00	73.561,69	51.413,91	-1,46%	786.345,43	2.254,36	469.194,25
HAPV3	1.381.370,40	227.903,24	209.451,72	5,94%	86.326,62	1.287,89	952.593,04
HBSA3	422.145,45	114.353,48	41.405,67	-1,17%	324.790,61	937,36	195.708,63
HYPE3	3.031.109,40	208.010,56	92.640,63	2,63%	1.013.598,87	2.679,90	370.018,73
IGTI11	147.631,90	279.827,60	19.831,64	0,56%	39.757,84	94,22	5.897,26
ITSA4	2.261.969,00	145.961,54	73.956,78	2,10%	452.098,51	809,15	142.018,94
ITUB4	2.881.882,00	173.175,56	71.397,74	2,02%	471.875,54	586,13	356.640,59
LCAM3	1.415.302,00	159.898,62	5.128,13	0,15%	933.099,78	2.721,45	567.124,41
LREN3	2.073.147,44	487.011,60	379.048,15	10,75%	359.256,62	3.395,37	2.431.343,97
MDNE3	81.176,00	21.060,11	6.020,65	-0,17%	57.659,91	167,51	35.008,29
MEGA3	1.237.853,10	94.558,81	77.052,97	2,18%	333.358,63	790,04	49.446,93
MRVE3	218.400,00	22.570,33	10.758,30	0,31%	102.036,78	293,19	56.245,32
NINJ3	57.452,00	33.943,50	1.323,09	0,04%	10.466,54	36,67	70.185,93
NTCO3	4.473.772,75	1.058.366,52	207.462,69	5,88%	891.192,48	8.155,42	5.908.292,79
PARD3	665.560,50	59.869,62	11.616,64	0,33%	180.522,63	429,79	28.327,98
PETR3	1.729.576,60	218.212,92	200.578,40	-5,69%	2.559.421,38	6.460,83	-1.210.074,29
PETR4	1.965.895,00	228.834,52	195.521,28	-5,54%	2.436.752,36	6.459,08	-1.262.170,00
POWE3	37.135,00	8.646,11	7.607,83	0,22%	5.751,82	23,70	40.003,45
PRI03	1.194.726,00	378.372,10	168.736,56	4,78%	82.538,31	1.159,98	851.910,45
QUAL3	267.020,00	31.844,92	19.087,19	0,54%	47.352,71	70,01	26.737,71



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/12/2021

FIA RVA EMB III CNPJ - 38452593000108

Dados Gerais

PL:	94.727.033,37	VAR / PL:	3,723%
VAR:	3.526.535,76	ETL / PL:	4,6686%
ETL:	4.422.419,64	VAR / CDI:	10713,44%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	192,78	BAIXA 1:	196,49	Cenário 1:	32.495.764,92
				Cenário 2:	64.925,09
				Cenário 3:	3.997.460,39

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
RAIL3	2.973.379,20	209.234,07	21.267,74	0,60%	1.447.178,45	4.179,05	- 816.262,86
RECV3	1.546.490,00	351.101,57	32.376,86	-0,92%	1.261.277,46	987,03	- 752.948,21
RENT3	3.676.451,00	385.152,01	18.157,78	-0,51%	2.469.664,53	7.197,42	-1.501.512,08
SEER3	641.998,49	48.403,54	16.764,92	-0,48%	242.328,48	666,84	- 109.268,48
SOMA3	3.185.211,49	355.988,53	280.126,51	7,94%	49.455,63	1.600,16	1.428.849,66
SULA11	1.912.286,87	297.361,52	247.471,81	7,02%	282.755,61	255,47	291.472,63
SUZB3	4.753.258,36	651.053,19	194.995,51	-5,53%	4.159.038,04	11.817,30	-2.445.543,96
TEND3	1.924.992,00	285.264,22	238.966,31	6,78%	257.020,86	133,69	345.334,83
USIM5	1.026.332,00	200.815,74	167.208,39	-4,74%	1.312.386,36	3.451,13	- 669.728,14
VALE3	1.147.103,44	211.095,75	179.512,30	-5,09%	1.279.793,84	3.477,83	- 694.382,80
VBBR3	5.540.374,40	281.601,42	204.493,35	5,80%	1.533.991,82	3.536,07	- 277.811,97
WEST3	56.700,00	35.302,07	5.584,84	-0,16%	9.582,03	36,19	6.493,46
YDUQ3	984.824,00	100.409,29	15.072,00	0,43%	264.127,01	624,30	- 37.856,50
COMPROMISSADA	6.650.003,22	535.453,42	389.073,87	11,03%	1.791.236,69	4.054,72	- 266.201,17
Total	94.724.722,63	11.651.594,53	3.526.535,76	100,00%	32.495.764,92	64.925,09	3.997.460,39



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/12/2021

FIA RVA EMB VI CNPJ - 41901871000163

Dados Gerais

PL:	105.201.691,19	VAR / PL:	8,326%
VAR:	8.759.353,70	ETL / PL:	10,4415%
ETL:	10.984.586,69	VAR / CDI:	23960,94%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	1.121,21	BAIXA 1:	1.293,09	Cenário 1:	26.005.795,46
				Cenário 2:	61.925,72
				Cenário 3:	- 4.063.427,00

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	9.000,00	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	334.303,59	-	-	0,00%	-	-	-
ABEV3	3.405.568,68	456.332,12	282.120,53	-3,22%	765.843,30	3.380,50	1.408.650,36
ALPA4	314.225,76	32.409,50	20.428,96	0,23%	62.529,11	271,71	110.580,79
AMER3	634.694,84	114.177,80	28.682,18	0,33%	105.965,80	-	178.826,35
ASAI3	520.668,00	78.136,47	47.613,08	0,54%	5.309,24	-	7.302,50
AZUL4	403.961,88	77.847,85	49.749,26	0,57%	37.659,92	154,10	57.456,77
B3SA3	3.422.998,94	199.742,41	59.425,70	0,68%	277.043,64	1.126,13	415.983,63
UNT	1.383.333,00	200.449,98	156.033,68	1,78%	67.499,25	256,96	86.719,65
BBAS3	2.078.152,05	245.077,08	35.234,04	0,40%	350.364,69	1.262,69	396.527,34
BBDC3	1.130.806,74	77.756,66	8.048,52	0,09%	72.151,15	290,63	105.990,99
BBDC4	4.562.836,04	323.190,50	83.721,82	0,96%	85.902,66	338,09	119.380,88
BBSF3	705.624,50	95.527,93	75.190,79	-0,86%	140.134,10	608,78	247.675,57
BEEF3	136.422,00	31.190,51	10.472,76	0,12%	46.244,43	155,34	44.670,98
BIDI11	833.986,87	114.813,23	24.516,48	-0,28%	455.511,93	2.564,90	1.606.224,51
BPAN4	184.048,44	31.271,20	23.207,76	0,26%	26.952,13	113,58	44.184,54
BRAP4	317.997,75	115.036,20	103.902,25	1,19%	498.402,52	1.171,08	229.693,14
BRFS3	925.189,16	164.366,91	38.446,98	0,44%	80.607,36	328,74	122.006,26
BRKM5	771.492,81	268.616,24	251.054,87	2,87%	1.190.036,23	2.811,83	554.412,40
BRML3	352.402,17	42.718,48	13.594,11	0,16%	3.172,25	12,31	4.265,46
CASH3	89.420,76	25.681,26	15.800,75	0,18%	22.953,67	-	44.395,10
CCRO3	654.452,53	55.954,34	34.629,52	0,40%	124.813,72	445,52	138.198,89
CIEL3	132.167,04	19.228,52	13.919,20	0,16%	13.979,11	51,82	16.878,03
CMIG4	739.377,78	49.216,21	25.260,86	0,29%	108.750,05	395,66	125.781,21
CMIN3	382.036,68	84.599,74	79.718,58	0,91%	291.377,57	-	205.198,89
COGN3	228.743,10	26.230,87	19.738,52	0,23%	1.959,77	7,61	2.636,48
CPFE3	254.858,17	22.709,67	17.111,43	0,20%	66.596,96	230,77	68.952,80
CPLF6	510.002,92	38.381,53	30.447,58	0,35%	86.237,22	310,72	97.550,98
CRFB3	317.276,25	20.100,12	4.021,16	0,05%	41.091,67	171,52	65.808,72
CSAN3	1.284.069,69	129.120,61	103.694,64	1,18%	296.639,38	1.040,89	315.948,28
CSNA3	812.224,98	274.194,50	265.961,07	3,04%	629.888,18	1.819,93	439.943,36
CVCB3	152.545,14	22.079,60	11.383,24	0,13%	15.757,92	64,83	24.362,31
CYRE3	225.101,70	44.440,64	39.134,13	0,45%	63.335,90	217,68	64.384,66
DXCO3	223.951,20	34.075,43	24.325,08	0,28%	59.711,24	-	61.521,83
ECOR3	125.618,52	14.295,46	5.071,20	-0,06%	33.908,65	153,99	67.014,32
EGIE3	496.180,38	16.785,05	9.495,10	-0,11%	10.445,99	41,16	14.556,02
ELET3	605.556,25	57.884,69	45.669,06	0,52%	60.042,16	223,23	73.005,36
ELET6	406.056,01	42.809,69	34.997,02	0,40%	40.417,99	150,25	49.124,08
ENBR3	244.830,48	19.591,50	12.385,81	-0,14%	12.469,08	47,42	15.981,39
ENEV3	907.680,05	62.600,32	4.112,95	-0,05%	102.409,34	423,53	160.349,20
ENH11	558.485,19	62.171,86	29.159,50	0,33%	121.437,24	428,56	131.023,83
EQTL3	1.155.823,20	53.771,70	33.655,11	0,38%	10.510,86	40,79	14.131,54
EZTC3	105.215,25	23.261,60	21.304,11	0,24%	36.529,64	122,32	35.037,71
FLRY3	276.506,30	25.300,58	13.233,48	0,15%	32.441,24	134,50	51.103,26
GGBR4	1.515.546,96	228.610,16	185.360,20	2,12%	960.955,53	2.904,32	737.944,04
GNDI3	1.808.327,40	193.597,73	40.486,37	-0,46%	463.756,62	2.087,92	896.617,19



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/12/2021

FIA RVA EMB VI CNPJ - 41901871000163

Dados Gerais

PL:	105.201.691,19	VAR / PL:	8,326%
VAR:	8.759.353,70	ETL / PL:	10,4415%
ETL:	10.984.586,69	VAR / CDI:	23960,94%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	1.121,21	BAIXA 1:	1.293,09	Cenário 1:	26.005.795,46
				Cenário 2:	61.925,72
				Cenário 3:	- 4.063.427,00

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
GOAU4	402.533,36	52.971,10	44.753,25	0,51%	215.850,94	674,33	- 177.924,83
GOLL4	144.141,92	30.081,53	23.339,34	0,27%	55.656,91	183,60	- 51.651,90
HAPV3	686.533,20	84.801,36	29.985,99	-0,34%	222.744,23	1.049,01	483.337,64
HYPE3	586.885,20	61.978,76	47.893,50	0,55%	39.958,46	150,73	- 50.248,48
IGTI11	154.932,18	264.414,38	125.899,45	-1,44%	-	-	-
IRBR3	255.619,74	27.888,49	8.682,97	0,10%	27.459,88	113,23	42.686,98
ITSA4	2.142.378,44	99.759,35	60.586,25	0,69%	136.524,92	549,91	200.536,85
ITUB4	5.070.298,05	422.980,05	314.887,81	3,59%	502.162,55	2.061,21	772.005,97
JBSS3	2.479.994,55	314.581,47	64.488,40	-0,74%	53.057,45	204,68	- 70.322,98
JHSF3	86.311,44	17.458,40	15.306,69	0,17%	34.340,18	112,78	- 31.559,89
KLBN11	1.056.345,22	156.687,74	135.276,76	1,54%	545.257,68	1.715,40	- 456.296,82
LAME4	253.758,87	47.592,12	1.379,92	0,02%	4.468,51	17,27	- 5.948,58
LCAM3	385.822,61	60.245,00	42.319,87	0,48%	140.344,02	466,94	- 132.720,61
LREN3	1.210.122,16	208.096,41	153.653,43	-1,75%	526.129,01	2.688,68	1.417.323,44
LWSA3	287.835,52	84.909,62	10.496,98	0,12%	127.554,11	656,24	349.928,06
MGLU3	1.056.379,86	345.382,51	46.137,33	-0,53%	741.699,80	4.975,89	4.420.512,49
MRFG3	388.961,68	86.419,23	54.399,56	-0,62%	110.373,47	505,77	223.207,10
MRVE3	178.956,00	24.847,38	16.924,25	0,19%	33.304,26	119,12	- 37.043,26
MULT3	258.616,80	26.179,58	6.352,22	-0,07%	25.193,96	103,32	38.649,67
NTCO3	1.085.454,12	262.313,28	58.374,49	0,67%	481.076,96	2.475,13	1.319.928,25
PACUCAR_CBD ON ED	172.666,58	19.443,52	13.767,60	0,16%	1.437,65	5,63	1.972,99
PETR3	4.199.913,50	841.432,64	775.137,86	8,85%	4.900.604,44	12.680,60	-2.731.369,11
PETR4	6.576.331,30	1.176.025,75	1.018.540,07	11,63%	6.164.238,48	16.977,21	-3.899.007,53
PETZ3	249.904,42	23.119,70	10.369,98	0,12%	54.601,02	240,07	99.447,62
POS13	43.055,00	11.534,47	10.400,86	0,12%	26.373,42	80,28	- 20.562,72
PRI03	877.792,89	247.912,67	121.351,87	-1,39%	288.958,87	1.365,31	632.370,71
QUAL3	236.718,30	29.849,56	13.542,12	0,15%	20.798,52	84,86	31.510,53
RADL3	1.318.420,80	157.146,04	90.998,35	1,04%	184.838,07	674,55	- 215.296,74
RAIL3	1.093.394,40	114.715,69	84.204,38	0,96%	227.766,38	806,91	- 247.912,87
RDOR3	1.276.489,42	118.511,78	49.244,64	-0,56%	544.836,92	-	1.442.953,09
RENT3	1.591.855,00	243.794,59	183.520,81	2,10%	601.495,15	1.990,48	- 562.088,61
RRRP3	338.653,70	83.760,97	45.818,41	0,52%	53.445,78	193,53	- 61.146,09
SANB11	550.642,66	41.436,74	20.763,00	-0,24%	134.716,10	602,00	255.581,92
SBSP3	691.658,52	113.225,98	97.112,27	1,11%	417.030,26	1.273,51	- 327.383,83
SOMA3	314.711,06	29.124,68	5.189,52	0,06%	77.833,71	348,40	148.292,64
SULA11	396.268,35	49.595,02	6.249,02	-0,07%	48.615,35	202,16	77.137,73
SUZB3	2.211.507,01	425.301,62	323.064,74	3,69%	1.266.766,86	3.907,98	-1.016.346,43
TAE11	402.470,42	33.380,94	28.763,25	0,33%	81.858,09	290,61	- 89.523,81
TIMS3	538.637,15	77.993,44	34.068,26	-0,39%	25.729,47	102,78	37.044,73
TOTS3	753.117,44	72.962,30	47.583,17	-0,54%	253.570,12	1.204,38	562.517,67
UGPA3	798.202,38	129.214,60	106.930,92	1,22%	404.513,07	1.276,83	- 340.944,45
USIM5	394.463,20	111.190,40	107.400,16	1,23%	385.596,63	1.049,99	- 238.289,67
VALE3	15.165.169,00	4.071.690,50	3.915.794,91	44,70%	12.623.087,82	35.848,38	-8.505.728,42
VBBR3	1.224.636,40	92.251,30	73.106,88	0,83%	10.618,26	-	- 14.283,00
VIIA3	424.415,25	59.642,61	23.393,10	0,27%	180.836,62	-	478.177,62



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/12/2021

FIA RVA EMB VI CNPJ - 41901871000163

Dados Gerais

PL:	105.201.691,19	VAR / PL:	8,326%
VAR:	8.759.353,70	ETL / PL:	10,4415%
ETL:	10.984.586,69	VAR / CDI:	23960,94%

Cenários de STRESS

ALTA 1: -	1.121,21	BAIXA 1:	1.293,09	Cenário 1:	26.005.795,46
				Cenário 2:	61.925,72
				Cenário 3:	- 4.063.427,00

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3	
VIVT3	1.058.156,02	114.845,43	-	88.904,75	-1,01%	- 78.686,89	- 318,73	117.155,34
WEGE3	2.479.898,12	267.600,31	-	33.416,73	0,38%	- 155.050,40	- 624,13	227.402,30
YDUQ3	312.861,52	31.981,02	-	14.854,90	0,17%	- 1.824,90	- 7,14	2.497,02
INDG22	4.338.415,00	328.969,69	-	327.886,88	3,74%	-	-	-
COMPROMISSADA	4.393.325,27	111,98	-	49,01	0,00%	241,19	- 125,23	- 371,30
EMP AÇÃO PROVISÃO	35.849,37	348,57	-	312,35	0,00%	503,04	- 213,91	- 570,32
LFT	303.187,62	36,99	-	26,28	0,00%	- 0,02	- 0,00	0,02
Total	109.574.435,14	16.113.093,68		8.759.353,70	100,00%	26.005.795,46	61.925,72	-4.063.427,00



Bradesco

Relatório de Risco de Mercado - EMBRAER PREV

Data: 31/12/2021

FIM EMB V A INVEST NO EXT CNPJ - 41252756000105

Dados Gerais

PL:	82.581.321,54	VAR / PL:	4,395%
VAR:	3.629.115,45	ETL / PL:	5,5110%
ETL:	4.551.058,75	VAR / CDI:	12646,59%

Cenários de STRESS

ALTA 1:	8.871.548,37	BAIXA 1:	-	8.941.898,79	Cenário 1:	2.885.657,76
					Cenário 2:	- 666.884,74
					Cenário 3:	- 501.239,63

Parâmetros do Cálculo

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário 1	Cenário 2	Cenário 3
CAIXA	191.826,42	-	-	0,00%	-	-	-
RECEBER	11.830,56	-	-	0,00%	-	-	-
EWJ_US	4.413.046,01	172.397,64	114.988,42	3,17%	572,19	- 39.717,41	- 777,43
SPY	14.007.967,97	615.429,20	591.433,26	16,30%	1.463.558,72	- 124.628,00	-1.769.480,74
VTV_US	8.320.301,44	393.656,16	309.767,58	8,54%	1.110.417,84	- 74.882,71	-1.302.402,06
LFT	11.125,63	4,80	0,06	0,00%	- 0,00	-	0,00
AB AMERICAN GROWTH	10.017.505,13	472.114,23	444.329,51	12,24%	778.878,92	- 90.157,55	- 969.144,99
FUNDSMITH EQ FUND	11.270.185,56	481.585,66	346.718,64	9,55%	992.439,33	- 101.431,67	-1.221.154,44
GLOBAL DOL FICFIA IE	3.959.062,11	685.080,01	404.639,42	11,15%	-1.826.856,08	-	5.220.337,27
LOOMIS US GROWTH	8.129.874,69	442.442,45	432.905,63	11,93%	105.347,17	- 73.168,87	- 140.999,55
EUROPEA	7.189.380,45	411.635,53	324.236,64	8,93%	313.585,01	- 64.704,42	- 405.230,03
PICTET GL FIC FIM IE	4.034.637,85	188.274,47	173.654,85	4,79%	- 183.363,80	-	263.244,27
QUAL	10.910.456,09	499.553,47	486.441,55	13,40%	131.078,47	- 98.194,10	- 175.631,92
Total	82.467.199,92	4.362.173,62	3.629.115,45	100,00%	2.885.657,76	- 666.884,74	- 501.239,63



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

31/12/2021

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	Data Aquisição	Data Vencimento	Emissor	Financeiro	Cód. ISIN	S&P	Moody's	Fitch
FI RF EMB II	20/10/14	15/01/23	SABESP	1.171.917,78	BRSPSPDBS130	brAAA	Aa2.br	AA(bra)
FI RF EMB II	21/10/14	15/01/23	SABESP	5.856.215,73	BRSPSPDBS130	brAAA	Aa2.br	AA(bra)
FI RF EMB II	24/02/15	15/01/23	SABESP	3.023.605,65	BRSPSPDBS130	brAAA	Aa2.br	AA(bra)
FI RF EMB II	04/03/15	02/03/22	B VOTORA	25.093.914,20	BRZXSZLFN364	brAAA	Aa3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	25/05/15	15/04/23	RD COLIN	1.134.945,26	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	27/05/15	15/04/23	RD COLIN	1.134.281,41	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	27/05/15	15/04/23	RD COLIN	1.247.884,63	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	01/06/15	15/04/23	RD COLIN	1.463.387,74	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB II	09/06/15	07/06/22	B VOTORA	11.638.193,39	BRZXSZLFN6P8	brAAA	Aa3.br	-
FI RF EMB II	30/06/15	28/06/22	B VOTORA	11.701.609,19	BRZXSZLFN7G5	brAAA	Aa3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	12/08/15	16/07/23	DUKE GEP	2.752.237,56	BRGEPADBS079	-	Aaa.br	-
FI RF EMB II	06/11/15	04/11/22	BRADESCO	7.097.600,63	BRBBDCLFR744	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	18/11/15	16/11/22	BRADESCO	17.618.278,25	BRBBDCLFR8X2	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	05/02/16	15/04/22	ECPT	17.185,51	BRASCPDBS011	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	05/02/16	15/07/22	ECPT	16.742,92	BRASCPDBS029	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	05/02/16	15/10/22	ECPT	16.303,53	BRASCPDBS037	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	05/02/16	15/01/23	ECPT	51.406,66	BRASCPDBS003	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	11/02/16	15/01/23	ECPT	178.666,08	BRASCPDBS003	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	16/02/16	15/07/22	ECPT	146.170,64	BRASCPDBS029	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	16/02/16	15/10/22	ECPT	142.513,98	BRASCPDBS037	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	16/02/16	15/04/22	ECPT	68.843,61	BRASCPDBS011	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	01/03/16	15/04/22	ECPT	80.964,68	BRASCPDBS011	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	01/03/16	15/01/23	ECPT	859.223,84	BRASCPDBS003	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	18/05/16	15/10/24	TRANS AL	1.666.802,44	BRTAEEDBS076	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/24	TRANS AL	615.011,56	BRTAEEDBS076	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/24	TRANS AL	369.006,94	BRTAEEDBS076	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	20/06/16	15/10/24	TRANS AL	1.228.173,15	BRTAEEDBS076	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	25/08/16	15/01/23	ECPT	449.840,04	BRASCPDBS003	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	25/08/16	15/01/23	ECPT	289.332,13	BRASCPDBS003	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/09/16	15/10/22	ECPT	382.582,43	BRASCPDBS037	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	10/10/16	15/01/23	SABESP	232.563,87	BRSPSPDBS130	brAAA	Aa2.br	AA(bra)
FIM EMB II A	12/12/16	12/01/22	LOCALIZA	532.919,92	BRRENTDBS0C4	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB I A	12/12/16	12/01/22	LOCALIZA	603.305,57	BRRENTDBS0C4	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB I A	08/02/17	08/02/22	TELEF BR	1.141.314,47	BRVIVTDBS069	brAAA	-	-
FIM EMB II A	08/02/17	08/02/22	TELEF BR	1.542.316,85	BRVIVTDBS069	brAAA	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	24/03/17	15/04/22	ECPT	289.386,91	BRASCPDBS011	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	24/03/17	15/07/22	ECPT	284.402,45	BRASCPDBS029	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	24/03/17	15/10/22	ECPT	279.437,93	BRASCPDBS037	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	24/03/17	15/01/23	ECPT	416.456,97	BRASCPDBS003	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	16/05/17	15/01/23	ECPT	784.312,59	BRASCPDBS003	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	16/05/17	15/07/22	ECPT	18.206,78	BRASCPDBS029	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/07/17	15/04/23	RD COLIN	2.693.594,37	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB II	25/08/17	15/08/24	PETR	16.700.818,51	BRPETRDBS084	AAA	Aaa.br	AA(bra)
FIM EMB II A	22/09/17	15/09/22	ENERSUL	272.228,52	BRENERDBS024	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	18/12/17	06/11/27	RB CAPIT	4.049.980,38	BRBRACR4IG2	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	21/12/17	06/11/27	RB CAPIT	1.181.994,93	BRBRACR4IG2	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/01/18	06/11/27	RB CAPIT	4.219.518,03	BRBRACR4IG2	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	29/01/18	27/10/22	SUL AME	657.294,67	BRSLADBS0A0	-	-	A+(bra)
FI RF EMB II	19/02/18	15/02/25	SABESP	8.921.273,44	BRSPSPDBS1A7	brAAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/02/18	15/02/25	SABESP	5.536.624,74	BRSPSPDBS1A7	brAAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	11.329.471,29	BRENTVDBS008	brAA	-	-
FI RF EMB II	23/05/18	15/05/28	COMGAS	25.417.071,35	BRCGASDBS093	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	557.131,47	BRENTVDBS008	brAA	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	557.131,47	BRENTVDBS008	brAA	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	557.131,47	BRENTVDBS008	brAA	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	555.680,35	BRENTVDBS008	brAA	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	15/12/30	ENTREVIA	557.131,47	BRENTVDBS008	brAA	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	11.368.280,99	BRERDVBS0E8	-	A2.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/07/18	15/07/25	AEGEA SA	13.093.677,18	BR AEGPDBS038	brA	Aa1.br	-
FI RF EMB II	26/07/18	15/07/25	CSMG	14.663.679,85	BRCSMGDBS0E7	-	Aa3.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/02/22	CEMIG G	1.606.378,36	BRCMGTDBS062	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/02/22	CEMIG G	77.707,44	BRCMGTDBS062	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/02/22	CEMIG G	545.225,96	BRCMGTDBS062	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/04/23	RD COLIN	842.126,23	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/04/23	RD COLIN	477.963,54	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/04/23	RD COLIN	1.263.189,34	BRCOLNDBS053	brAA+	A3.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/02/25	CEMIG	2.461.275,10	BRCMGDDBS041	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FIM EMB II A	14/11/18	15/03/24	BRADESCO	309.503,09	BRBBDCLTR6K7	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB I A	04/01/19	07/06/24	MOV_PART	1.156.663,88	BRMOVDBS085	brAA+	-	AA-(bra)
FIM EMB II A	17/01/19	16/09/24	ITAUBB	298.280,04	BRBIFALFIU67	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB I A	12/02/19	15/01/25	ITAUBB	2.567.345,21	BRBIFALFITJ2	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB II A	12/02/19	15/01/25	ITAUBB	2.567.345,21	BRBIFALFITJ2	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB I A	19/08/20	14/08/24	B3SA	1.707.179,50	BRB3SADBS032	-	Aaa.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/05/26	OMEGA GE	526.523,06	BROMGEDBS028	-	-	AA(bra)



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/12/2021

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	Data Aquisição	Data Vencimento	Emissor	Financeiro	Cód. ISIN	S&P	Moody's	Fitch
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/05/26	OMEGA GE	3.333.802,32	BROMGEDBS028	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/05/26	OMEGA GE	1.898.520,68	BROMGEDBS028	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/05/26	OMEGA GE	5.739.860,87	BROMGEDBS028	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/07/29	GUARIROB	649.098,06	BRGRRBDBS042	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/07/29	GUARIROB	5.251.793,46	BRGRRBDBS042	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/07/29	GUARIROB	7.789.176,81	BRGRRBDBS042	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/07/29	GUARIROB	802.521,25	BRGRRBDBS042	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	15/05/26	OMEGA GE	575.884,60	BROMGEDBS028	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	30/09/20	22/09/25	BCBF	261.636,94	BRBCFBDBS032	-	-	AA+(bra)
FIM EMB II A	08/01/21	15/04/24	ECORODOV	1.338.961,32	BRERDVDBS0F5	-	-	AA(bra)
FIM EMB II A	20/01/21	15/07/23	AEGEA SA	587.659,76	BRAEGPDBS020	-	Aa1.br	-
FIM EMB II A	20/01/21	23/07/23	COPEL GT	181.612,04	BRCPGTDBS032	-	-	AA+(bra)
FIM EMB II A	04/02/21	15/07/23	AEGEA SA	198.645,55	BRAEGPDBS020	-	Aa1.br	-
FIM EMB II A	05/02/21	23/07/23	COPEL GT	114.139,54	BRCPGTDBS032	-	-	AA+(bra)
FIM EMB II A	05/02/21	15/07/23	AEGEA SA	273.137,64	BRAEGPDBS020	-	Aa1.br	-
FIM EMB II A	05/02/21	15/07/24	COPEL GT	291.262,43	BRCPGTDBS057	-	-	AA+(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	22/08/22	ITAU	5.092.194,22	BRBITALFIBU7	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	15/12/30	ENTREVIA	5.549.326,61	BRENTVDBS008	brAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/12/30	ENTREVIA	5.564.114,55	BRENTVDBS008	brAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/05/29	ELETROB	3.776.626,61	BRELETDBS032	brAAA	Ba2	AA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	15/06/29	NEOENERG	541.453,50	BRNEODBS047	brAA+	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/06/29	NEOENERG	5.382.317,98	BRNEODBS047	brAA+	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/05/29	ELETROB	1.563.884,72	BRELETDBS032	brAAA	Ba2	AA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	15/05/29	ELETROB	2.997.404,27	BRELETDBS032	brAAA	Ba2	AA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	15/05/29	ELETROB	3.206.923,25	BRELETDBS032	brAAA	Ba2	AA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	15/07/34	IGUA SAN	2.504.609,70	BRIGSNDBS044	brAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	15/05/28	COMGAS	22.137.449,24	BRCGASDBS093	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	07/11/22	ITAU	9.574.706,34	BRBITALFIDK4	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	07/11/22	ITAU	803.171,10	BRBITALFIDK4	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	07/11/22	ITAU	803.171,10	BRBITALFIDK4	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	07/11/22	ITAU	6.425.368,83	BRBITALFIDK4	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	07/11/22	ITAU	4.015.855,52	BRBITALFIDK4	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	07/11/22	ITAU	5.622.197,73	BRBITALFIDK4	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/02/22	CEMIG G	637.376,43	BRCMGTDBS062	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/02/22	CEMIG G	159.344,11	BRCMGTDBS062	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/02/22	CEMIG G	1.137.716,92	BRCMGTDBS062	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	16/07/23	DUKE GEP	11.128.209,77	BRGEPADBS079	-	Aaa.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	631.568,99	BRTAEEDBS076	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/02/22	CEMIG G	161.893,61	BRCMGTDBS062	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	1.111.561,42	BRTAEEDBS076	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/02/22	CEMIG G	1.160.025,10	BRCMGTDBS062	brAA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	1.263.137,97	BRTAEEDBS076	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	631.568,99	BRTAEEDBS076	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/22	ECPT	170.855,43	BRASCPDBS037	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/07/22	ECPT	136.547,31	BRASCPDBS029	-	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	773.040,44	BRTAEEDBS076	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	14/11/22	ITAU	8.038.114,55	BRBITALFIDR9	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/22	ECORODOV	1.723.934,51	BRERDVDBS052	brAAA	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/22	ECORODOV	575.107,67	BRERDVDBS052	brAAA	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/05/22	SUL AME	1.623.763,31	BRSULADBS053	-	-	A+(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/22	ECORODOV	719.108,33	BRERDVDBS052	brAAA	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	647.734,49	BRTAEEDBS076	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/24	TRANS AL	1.879.307,02	BRTAEEDBS076	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	27/01/25	BRADESCO	11.401.600,12	BRBBDCFLRZJ5	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/11/24	CCR	5.648.724,62	BRCCRODBS0G5	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/11/24	ECORODOV	3.764.813,55	BRERDVDBS0D0	brAAA	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/02/25	SABESP	1.300.287,63	BRBSPDBS1A7	brAAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/05/28	COMGAS	9.838.866,33	BRCGASDBS093	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/06/27	JAGUARA	1.770.611,89	BRENJGDBS018	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/06/27	ENERGMIR	1.082.731,37	BRENMDDBS018	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	01/08/25	BRADESCO	3.714.757,50	BRBBDCFLRZJ8	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB I A	28/05/21	28/11/23	B.ALFA	1.000.540,10	BRBRVLFII52	-	Aa1.br	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/34	VIARONDO	1.166.036,75	BRVRDNDBS012	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/34	VIARONDO	648.273,64	BRVRDNDBS012	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/34	VIARONDO	495.298,18	BRVRDNDBS012	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/34	VIARONDO	1.326.500,52	BRVRDNDBS012	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/09/34	BRKA	3.373.546,33	BRBRKPDDBS055	-	Aa3.br	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/10/30	LAME	2.031.935,57	BRAMERDBS081	brAAA	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/10/38	TAUBATE	8.911.557,87	BRLTTEDBS048	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/26	IRB	2.414.177,48	BRIRBRDBS022	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/10/30	LAME	968.741,63	BRAMERDBS081	brAAA	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/31	METRORIO	3.668.483,97	BRMGPRDBS068	brAA	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/03/29	ANET	1.762.858,05	BRANETDBS002	brA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/03/28	BRISANET	3.266.688,99	BRBRSTDBS001	brA+	-	-



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/12/2021

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataVencimento	Emissor	Financeiro	Cód.ISIN	S&P	Moody's	Fitch
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/10/36	PAMPASUL	1.005.735,60	BRUTPSDBS013	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/05/23	LIGHT	846.868,77	BRLIGHDBS007	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/05/23	LIGHT	1.895.372,97	BRLIGHDBS007	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/05/23	LIGHT	1.193.681,70	BRLIGHDBS007	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/05/23	LIGHT	871.065,03	BRLIGHDBS007	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/10/30	LAME	454.097,64	BRAMERDBS081	brAAA	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/31	METRORIO	3.439.203,72	BRMGPRDBS068	brAA	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/03/31	LOCALIZA	8.328.190,13	BRRENTDBS0K7	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/05/30	NORTE EN	1.267.309,41	BRNTENDBS005	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	15/12/34	VIARONDO	1.576.824,01	BRVRDNDBS012	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	09/06/21	15/11/25	QUATA	4.383.709,02	BRQUATDBS019	-	-	A-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	10/06/21	15/12/35	MS 306	2.165.104,09	BRCNRDDBS004	-	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/08/25	COSAN LO	31.000,66	BRRLOGDBS006	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/11/24	DASA	424.229,53	BRDASADBS0G1	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/08/25	COSAN LO	837.017,89	BRRLOGDBS006	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	04/11/25	BCBF	504.515,54	BRBCBFDBS040	-	-	AA+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	04/11/25	BCBF	504.515,54	BRBCBFDBS040	-	-	AA+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	27/11/25	SANEAMEN	499.035,93	BRNSGODBS0J1	-	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	27/11/25	SANEAMEN	1.014.300,66	BRNSGODBS0J1	-	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	27/11/25	SANEAMEN	999.086,15	BRNSGODBS0J1	-	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/11/24	DASA	1.722.993,68	BRDASADBS0G1	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/11/24	DASA	430.246,97	BRDASADBS0G1	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/08/25	COSAN LO	209.254,47	BRRLOGDBS006	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	25/08/25	COSAN LO	523.689,76	BRRLOGDBS006	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	10/06/21	04/11/25	BCBF	1.512.508,52	BRBCBFDBS040	-	-	AA+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	14/06/21	19/06/24	BNBBM	563.789,04	BRBNBRLF0F8	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	14/06/21	12/06/24	BNBBM	853.365,79	BRBNBRLF062	-	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/06/21	29/06/24	SBF COME	721.137,32	BRSBFCDBS002	brA+	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/06/21	29/06/24	SBF COME	1.726.666,83	BRSBFCDBS002	brA+	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/06/21	15/09/25	BRKA	1.889.517,59	BRBRKPDBS048	-	Aa3.br	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/06/21	15/09/25	BRKA	628.065,00	BRBRKPDBS048	-	Aa3.br	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/06/21	25/04/23	CELPA	2.541.290,91	BREQPADBS060	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	15/06/21	15/12/30	B2W	470.309,25	BRBTOWDBS034	brAAA	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	15/06/21	15/09/34	BRKA	1.000.347,12	BRBRKPDBS055	-	Aa3.br	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	15/06/21	15/10/36	PAMPASUL	2.441.555,65	BRUTPSDBS039	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	16/06/21	13/07/23	ECORODOV	2.121.211,22	BRERDVDBS0J7	brAAA	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	16/06/21	15/05/23	LIGHT	2.097.008,39	BRLIGHDBS007	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	16/06/21	15/03/29	OMEGA GE	2.039.979,57	BROMGEDBS069	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	16/06/21	20/04/26	SMARTIFI	2.043.376,19	BRSMFTDBS045	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	16/06/21	30/09/23	USIMINAS	2.052.839,77	BRUSIMDBS005	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	16/06/21	30/09/23	USIMINAS	513.209,94	BRUSIMDBS005	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	17/06/21	15/02/31	CORSAN	750.073,28	BRRSANDBS055	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	17/06/21	15/02/26	CORSAN	1.045.821,34	BRRSANDBS030	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	18/06/21	15/12/30	MG050	502.799,49	BRRDVIDBS061	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	21/06/21	15/04/28	PAMPASUL	1.278.290,59	BRUTPSDBS005	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	25/06/21	27/11/25	GUAR	1.227.752,22	BRGUARDBS055	-	-	A+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	15/10/30	LAME	296.677,12	BRAMERDBS081	brAAA	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	15/12/35	MS 306	1.584.535,44	BRCNRDDBS004	-	-	A+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	15/10/30	LAME	1.537.877,34	BRAMERDBS081	brAAA	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	15/12/35	MS 306	86.604,16	BRCNRDDBS004	-	-	A+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	20/06/26	OURO VER	1.421.958,47	BRVOSADBS0E8	-	-	A+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	28/06/21	15/09/34	BRKA	1.691.194,59	BRBRKPDBS055	-	Aa3.br	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	30/06/21	27/11/25	GUAR	1.341.241,92	BRGUARDBS055	-	-	A+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	30/06/21	15/12/35	MS 306	3.207.561,61	BRCNRDDBS004	-	-	A+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	01/07/21	15/10/26	LIGHT	5.119.971,00	BRLIGHDBS055	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	01/07/21	15/12/35	MS 306	2.805.547,22	BRCNRDDBS004	-	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	02/07/21	18/02/25	RENNER	1.138.109,59	BRLRENDBS0B4	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	02/07/21	18/02/25	RENNER	240.694,10	BRLRENDBS0B4	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	07/07/21	15/03/29	CAGECE	1.156.327,45	BRCAECDBS019	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	07/07/21	15/07/28	VENSJOR	336.586,11	BRVJHDBS001	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	07/07/21	15/07/28	VENSJOR	1.623.848,95	BRVJHDBS001	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	08/07/21	15/06/31	VAMOS	252.183,28	BRVAMODBS033	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	08/07/21	15/06/31	VAMOS	256.103,34	BRVAMODBS041	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	08/07/21	15/03/29	CAGECE	2.635.326,33	BRCAECDBS019	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	08/07/21	15/06/31	VAMOS	5.081.415,43	BRVAMODBS041	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	12/07/21	31/10/22	ITAU	1.344.822,44	BRBITALFIDB3	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	12/07/21	12/07/26	BRADESCO	3.139.749,18	BRBBDCLTRQT4	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/07/29	GUARIROB	1.188.618,17	BRGRRBDBS042	-	-	AA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/26	IRB	1.896.234,55	BRIRBRDBS022	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/34	VIARONDO	217.160,97	BRVRDNDBS012	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/26	IRB	921.028,21	BRIRBRDBS022	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/30	B2W	1.693.576,64	BRBTOWDBS034	brAAA	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/09/34	BRKA	457.617,36	BRBRKPDBS055	-	Aa3.br	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/26	IRB	478.934,67	BRIRBRDBS022	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/30	B2W	1.494.332,33	BRBTOWDBS034	brAAA	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/30	B2W	2.191.687,42	BRBTOWDBS034	brAAA	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/30	B2W	1.095.843,71	BRBTOWDBS034	brAAA	-	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/09/34	BRKA	763.800,95	BRBRKPDBS055	-	Aa3.br	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/34	VIARONDO	1.827.147,49	BRVRDNDBS012	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/34	VIARONDO	285.625,52	BRVRDNDBS012	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/12/26	IRB	3.792.469,11	BRIRBRDBS022	brAAA	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	15/03/29	ANET	1.074.258,41	BRANETDBS002	brA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	11/03/25	BRML	3.087.691,15	BRBRMLDBS076	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	10/05/24	MULTIPLA	3.055.408,75	BRMULTDBS031	brAAA	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	20/09/24	IGUATEMI	372.525,33	BRIGTADBS072	-	-	AAA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	15/07/21	20/09/24	IGUATEMI	372.525,33	BRIGTADBS072	-	-	AAA(bra)



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/12/2021

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	Data Aquisição	Data Vencimento	Emissor	Financeiro	Cód.ISIN	S&P	Moody's	Fitch
FIMEMB VI A CRED PRIV	15/07/21	20/09/24	IGUATEMI	1.328.133,78	BRIGTADBS072	-	-	AAA(bra)
FIMEMB VI A CRED PRIV	15/07/21	15/07/27	RT BANDE	2.321.547,41	BRCRBDBS033	-	-	AAA(bra)
FIMEMB VI A CRED PRIV	15/07/21	15/05/23	ELEKTRO	548.593,91	BREKTRDBS0F0	brAAA	-	-
FIMEMB VI A CRED PRIV	15/07/21	15/09/23	SONAE	3.058.286,13	BRALSCDBS036	-	-	AA-(bra)
FIMEMB VII A CRED PRIV	16/07/21	15/02/31	CORSAN	2.764.853,45	BRRSANDBS055	-	-	AA-(bra)
FIMEMB VI A CRED PRIV	19/07/21	15/07/30	PARANAGU	761.360,36	BRPASNDBS018	brAA	-	-
FIMEMB VII A CRED PRIV	19/07/21	15/05/30	NORTE EN	1.789.417,53	BRNTENDBS005	-	-	AA(bra)
FIMEMB VI A CRED PRIV	19/07/21	15/10/30	LAME	1.959.279,95	BRAMERDBS081	brAAA	-	AA(bra)
FIMEMB VII A CRED PRIV	21/07/21	15/10/36	PAMPASUL	1.943.011,48	BRUTPSDBS013	-	-	AAA(bra)
FIMEMB VII A CRED PRIV	21/07/21	15/10/36	PAMPASUL	711.981,15	BRUTPSDBS013	-	-	AAA(bra)
FIMEMB I A	21/07/21	15/05/25	INTERVIA	1.265.811,61	BRVIADBS074	-	AA,br	-
FIMEMB I A	21/07/21	05/03/24	ENERG TR	1.307.076,92	BRETENDBS061	-	-	AAA(bra)
FIMEMB I A	21/07/21	15/01/26	AERIS	1.227.132,60	BRAERIDBS006	-	-	AA(bra)
FIMEMB I A	21/07/21	15/07/27	RT BANDE	1.116.019,62	BRCRBDBS033	-	-	AAA(bra)
FIMEMB I A	21/07/21	15/03/29	OMEGA GE	1.031.209,67	BROMGEDBS069	-	-	AA(bra)
FIMEMB I A	21/07/21	20/08/26	VAMOS	1.050.088,52	BRVAMODBS017	-	-	AA-(bra)
FIMEMB VII A CRED PRIV	23/07/21	15/12/30	MG050	1.508.398,46	BRRDVIDBS061	brAA+	-	-
FIMEMB VII A CRED PRIV	26/07/21	15/03/29	ANET	2.685.646,02	BRANETDBS002	brA	-	-
FIMEMB VI A CRED PRIV	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	546.760,05	BRANEMDBS007	-	-	AA(bra)
FIMEMB VII A CRED PRIV	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	1.399.189,10	BRANEMDBS007	-	-	AA(bra)
FIMEMB VII A CRED PRIV	27/07/21	15/06/28	MOVIDA L	1.488.071,23	BRMLVDBS050	brAA+	-	-
FIMEMB VII A CRED PRIV	27/07/21	15/06/28	MOVIDA L	3.780.262,47	BRMLVDBS050	brAA+	-	-
FIMEMB VI A CRED PRIV	29/07/21	15/10/24	BKBR	1.400.545,17	BRBKRDBS048	-	-	AA(bra)
FIMEMB VI A CRED PRIV	29/07/21	15/12/26	RD COLIN	2.082.947,42	BRCOLNDBS0C7	brAA+	-	-
FIMEMB VII A CRED PRIV	30/07/21	15/05/30	NORTE EN	992.823,04	BRNTENDBS005	-	-	AA(bra)
FIMEMB VI A CRED PRIV	02/08/21	15/01/31	ECHOENER	1.617.950,64	BRECHPDBS024	-	-	A+(bra)
FIMEMB VI A CRED PRIV	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	1.032.141,73	BRUNEGDBS007	brAA	-	-
FIMEMB VI A CRED PRIV	04/08/21	15/04/27	MOV_PART	1.033.817,06	BRMOVIDBS0E6	brAA+	-	AA-(bra)
FIMEMB VI A CRED PRIV	05/08/21	15/06/32	ENSINOP	683.525,94	BRCSNPDBS022	-	-	AA(bra)
FIMEMB VI A CRED PRIV	06/08/21	15/12/31	METRORIO	1.054.689,14	BRMGPRDBS068	brAA	-	AA-(bra)
FIMEMB VI A CRED PRIV	10/08/21	10/08/23	PARANAB	517.105,88	BRPRBCLFICE4	brAA+	-	AA-(bra)
FIMEMB VI A CRED PRIV	11/08/21	15/08/31	CSAN	1.043.547,06	BRCSANDBS040	-	-	AAA(bra)
FIMEMB VI A CRED PRIV	11/08/21	15/06/27	AUTOPIST	1.408.141,81	BRAPRDBS023	brAAA	-	-
FIMEMB VII A CRED PRIV	11/08/21	15/08/31	CSAN	5.010.492,40	BRCSANDBS057	-	-	AAA(bra)
FIMEMB VI A CRED PRIV	12/08/21	14/08/23	ABC	1.033.372,51	BRABCLFI3Q1	brAAA	AA+,br	AAA(bra)
FIMEMB VI A CRED PRIV	17/08/21	15/05/30	NORTE EN	3.011.173,89	BRNTENDBS005	-	-	AA(bra)
FIMEMB VI A CRED PRIV	18/08/21	15/12/31	METRORIO	1.069.592,36	BRMGPRDBS068	brAA	-	AA-(bra)
FIMEMB VII A CRED PRIV	18/08/21	15/12/31	METRORIO	829.994,50	BRMGPRDBS068	brAA	-	AA-(bra)
FIMEMB VII A CRED PRIV	20/08/21	15/05/44	CTEEP	916.588,57	BRTRPLDBS0D1	-	-	AAA(bra)
FIMEMB VII A CRED PRIV	25/08/21	15/08/29	CEEE D	3.952.617,84	BRCEEDDBS019	brAA+	-	-
FIMEMB VI A CRED PRIV	27/08/21	20/08/31	S LUIZ A	1.030.291,98	BRRDORDBS0A0	-	-	AAA(bra)
FIMEMB VII A CRED PRIV	06/09/21	15/08/31	COMGAS	3.178.084,44	BRCGASDBS0B7	-	AAA,br	-
FIMEMB VII A CRED PRIV	08/09/21	15/05/30	NORTE EN	489.403,36	BRNTENDBS005	-	-	AA(bra)
FIMEMB I A	16/09/21	15/07/26	GUARIROB	673.786,57	BRGRRBDBS034	-	-	AA(bra)
FIMEMB I A	16/09/21	15/07/26	GUARIROB	60.339,10	BRGRRBDBS034	-	-	AA(bra)
FIMEMB I A	16/09/21	15/07/26	GUARIROB	301.695,48	BRGRRBDBS034	-	-	AA(bra)
FIMEMB I A	16/09/21	15/06/24	PROLAGOS	2.181.208,72	BRPRLGDBS037	-	-	AA(bra)
FIMEMB I A	16/09/21	15/04/26	ELETROB	1.994.203,81	BRELETDBS040	brAAA	-	-
FIMEMB I A	16/09/21	21/10/26	AUTOBAN	902.354,03	BRANHBDBS0F3	brAAA	-	-
FIMEMB I A	17/09/21	01/10/24	EQUATENE	1.422.576,86	BREQLTDBS036	brAA+	-	-
FIMEMB VII A CRED PRIV	17/09/21	15/03/28	BRISANET	1.432.474,90	BRBRSTDBS001	brA+	-	-
FIMEMB VI A CRED PRIV	20/09/21	15/09/29	MOV_PART	1.062.292,59	BRMOVIDBS0G1	brAA+	-	-
FIMEMB VI A CRED PRIV	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	1.540.437,84	BRMOVIDBS0H9	brAA+	-	-
FIMEMB VII A CRED PRIV	20/09/21	15/12/30	MG050	1.005.598,97	BRRDVIDBS061	brAA+	-	-
FIMEMB VII A CRED PRIV	20/09/21	15/12/30	MG050	1.005.598,97	BRRDVIDBS061	brAA+	-	-
FIMEMB VII A CRED PRIV	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	1.018.742,89	BRMOVIDBS0H9	brAA+	-	-
FIMEMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/07/39	EDPM	2.041.849,00	BRMGSPDBS017	-	-	AA+(bra)
FIMEMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/02/31	CORSAN	770.908,65	BRRSANDBS055	-	-	AA-(bra)
FIMEMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/02/31	CORSAN	770.908,65	BRRSANDBS055	-	-	AA-(bra)
FIMEMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/02/31	CORSAN	256.275,04	BRRSANDBS055	-	-	AA-(bra)
FIMEMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/02/31	CORSAN	256.275,04	BRRSANDBS055	-	-	AA-(bra)
FIMEMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/04/26	ECORODOV	713.907,79	BRERDVDBS0H1	-	-	AA(bra)
FIMEMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/04/26	ECORODOV	713.907,79	BRERDVDBS0H1	-	-	AA(bra)
FIMEMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/04/26	ECORODOV	917.377,39	BRERDVDBS0H1	-	-	AA(bra)
FIMEMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/04/26	ECORODOV	356.365,83	BRERDVDBS0H1	-	-	AA(bra)
FIMEMB VII A CRED PRIV	22/09/21	15/04/26	ECORODOV	356.365,83	BRERDVDBS0H1	-	-	AA(bra)
FIMEMB VII A CRED PRIV	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	4.044.554,36	BRLCAMDBS0R2	brAA	-	-
FIMEMB VI A CRED PRIV	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	5.123.580,40	BRLCAMDBS0R2	brAA	-	-
FIMEMB VI A CRED PRIV	23/09/21	14/08/23	ABC	1.033.372,51	BRABCLFI3Q1	brAAA	AA+,br	AAA(bra)
FIMEMB VI A CRED PRIV	24/09/21	15/03/24	CCPR	2.052.277,20	BRCCPRDBS0D1	-	A,br	-
FIMEMB VI A CRED PRIV	24/09/21	20/05/25	CEA MODA	2.032.782,39	BRCEABDBS011	-	-	AA-(bra)
FIMEMB VI A CRED PRIV	24/09/21	11/09/23	PANAMERI	1.025.069,12	BRBPANLFI654	-	-	-
FIMEMB VI A CRED PRIV	27/09/21	28/05/23	IGUATEMI	2.308.618,79	BRIGTADBS080	-	-	AAA(bra)
FIMEMB VI A CRED PRIV	27/09/21	15/01/26	LOCAMERI	1.894.549,52	BRLCAMDBS009	brAAA	-	-
FIMEMB VI A CRED PRIV	27/09/21	05/03/24	ENERG TR	2.046.444,00	BRETENDBS061	-	-	AAA(bra)
FIMEMB VI A CRED PRIV	27/09/21	10/08/23	PARANAB	1.034.211,75	BRPRBCLFICE4	brAA+	-	AA-(bra)
FIMEMB VI A CRED PRIV	27/09/21	01/04/24	CNH	1.899.438,74	BRCNHCLFI317	-	-	AAA(bra)
FIMEMB VI A CRED PRIV	27/09/21	10/05/27	SABESP	1.148.882,30	BRSPDBS1B5	brAAA	-	-
FIMEMB VI A CRED PRIV	30/09/21	15/09/31	SIMPAR	773.924,81	BRSIMHDBS044	brAA+	-	-
FIMEMB VI A CRED PRIV	30/09/21	15/01/31	SIMPAR	1.031.819,66	BRSIMHDBS036	brAA+	-	-



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/12/2021

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	Data Aquisição	Data Vencimento	Emissor	Financeiro	Cód.ISIN	S&P	Moody's	Fitch
FIMEMB VI A CRED PRIV	01/10/21	15/09/41	TUCANOHO	1.777.859,19	BRTNHLDBS002	-	-	AA(bra)
FIMEMB VII A CRED PRIV	01/10/21	15/09/41	TUCANOHO	1.826.567,66	BRTNHLDBS002	-	-	AA(bra)
FIMEMB VI A CRED PRIV	04/10/21	15/12/31	METRORIO	566.322,21	BRMGPRDBS068	brAA	-	AA-(bra)
FIMEMB VII A CRED PRIV	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	5.064.303,06	BRTCIDDBS009	-	-	AA(bra)
FIMEMB VI A CRED PRIV	19/10/21	15/06/30	ECHOENER	1.094.637,17	BRECHPDBS008	-	-	A+(bra)
FIMEMB I A	20/10/21	20/10/25	DAYCOVAL	2.090.213,53	BRDAYCLFNKX1	brAA+	AAbr	AA(bra)
FIMEMB I A	20/10/21	20/10/24	DAYCOVAL	1.170.846,39	BRDAYCLFNKW3	brAA+	AAbr	AA(bra)
FIMEMB VI A CRED PRIV	22/10/21	15/12/35	CART	2.602.999,28	BRRPTADBS033	brAA+	-	-
FIMEMB VI A CRED PRIV	22/10/21	15/12/35	CART	1.561.799,57	BRRPTADBS033	brAA+	-	-
FIMEMB VI A CRED PRIV	25/10/21	15/03/26	VIX LOGI	1.023.096,88	BRVIXLDBS047	-	-	A+(bra)
FIMEMB VI A CRED PRIV	27/10/21	15/06/39	ANEMUS	248.625,14	BRANEMDBS007	-	-	AA(bra)
FIMEMB VI A CRED PRIV	27/10/21	15/06/39	ANEMUS	251.854,04	BRANEMDBS007	-	-	AA(bra)
FIMEMB VI A CRED PRIV	27/10/21	15/06/39	ANEMUS	269.074,83	BRANEMDBS007	-	-	AA(bra)
FIMEMB VI A CRED PRIV	27/10/21	15/06/39	ANEMUS	248.625,14	BRANEMDBS007	-	-	AA(bra)
FIMEMB I A	27/10/21	15/10/29	CONT GLO	2.244.133,61	BRGCBPDBS014	-	-	AA(bra)
FIMEMB VI A CRED PRIV	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	802.829,31	BRHARGDBS003	brAAA	-	-
FIMEMB VI A CRED PRIV	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	6.380.100,49	BRHARGDBS003	brAAA	-	-
FIMEMB I A	28/10/21	07/11/23	TOYOTA	2.235.299,72	BRBTOYLF2F4	brAAA	-	-
FIMEMB VI A CRED PRIV	29/10/21	15/06/39	ANEMUS	1.076.299,31	BRANEMDBS007	-	-	AA(bra)
FIMEMB VI A CRED PRIV	29/10/21	15/10/31	ENERGISA	2.932.513,21	BRENGIDBS000	-	-	AA+(bra)
FIMEMB VII A CRED PRIV	29/10/21	15/10/31	CELP	2.094.240,38	BRCEPEDBS007	brAAA	-	-
FIMEMB VII A CRED PRIV	29/10/21	15/10/31	ELEKTRO	2.094.010,84	BREKTRDBS0L8	brAAA	-	-
FIMEMB VII A CRED PRIV	29/10/21	15/10/31	COELBA	2.094.113,62	BRCEEBDBS019	brAAA	-	-
FIMEMB VI A CRED PRIV	03/11/21	15/06/32	ENSINOP	1.510.592,32	BRCSNPDBS022	-	-	AA(bra)
FIMEMB VI A CRED PRIV	04/11/21	15/07/39	UTE GNA	3.088.298,09	BRUNEGDBS007	brAA	-	-
FIMEMB VI A CRED PRIV	10/11/21	15/10/28	LIGHT	1.523.262,38	BRLIGHDBS020	brAA+	-	-
FIMEMB VI A CRED PRIV	12/11/21	15/10/31	VAMOS	2.045.312,58	BRVAMODBS074	brAA+	-	-
FIMEMB VII A CRED PRIV	18/11/21	15/10/31	HIDRO BR	3.991.896,76	BRHBSADBS010	-	-	AA(bra)
FIMEMB VII A CRED PRIV	22/11/21	15/06/39	ANEMUS	5.108.116,50	BRANEMDBS007	-	-	AA(bra)
FIMEMB VII A CRED PRIV	26/11/21	15/07/29	GUARIROB	2.027.018,49	BRGRRBDBS042	-	-	AA(bra)
FIMEMB VII A CRED PRIV	26/11/21	15/04/26	ECORODOV	2.032.343,76	BRERDVDBS0H1	-	-	AA(bra)
FIMEMB VII A CRED PRIV	30/11/21	15/06/39	ANEMUS	2.094.478,45	BRANEMDBS007	-	-	AA(bra)
FIMEMB VII A CRED PRIV	30/11/21	15/03/28	BRISANET	816.402,99	BRBRSTDBS001	brA+	-	-
FIMEMB VII A CRED PRIV	03/12/21	15/12/36	REIT SEC	2.361.098,52	BRBRACRIGW8	-	-	AAAsf(bra)
FIMEMB VI A CRED PRIV	03/12/21	11/06/24	BNBBM	563.277,75	BRBNBRLF005	-	-	-
FIMEMB VII A CRED PRIV	06/12/21	15/12/35	TESC	8.402.699,10	BRJENDBS009	-	-	A+(exp)(bra)
FIMEMB VII A CRED PRIV	09/12/21	15/11/25	QUATA	2.516.188,96	BRQUATDBS019	-	-	A-(bra)
FIMEMB VII A CRED PRIV	09/12/21	15/07/39	EDPM	3.553.591,31	BRMGSPDBS017	-	-	AA+(bra)
FIMEMB VII A CRED PRIV	09/12/21	15/03/29	ANET	997.986,06	BRANETDBS002	brA	-	-
FIMEMB VI A CRED PRIV	20/12/21	15/11/35	HAZTEC	2.009.531,67	BRHZTCDBS013	brAA	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	FIDC VERDECARD SN6	1.401.231,44	BRVDCRCTF057	brAAA(sf)	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	FIDC VERDECARD SN5	700.588,49	BRVDCRCTF040	brAAA(sf)	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	FIDC VERDECARD SN3	4.764.471,95	BRVDCRCTF024	brAAA(sf)	-	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	FIDC CREDZ SN6	2.518.149,81	BRCRDZCTF0A0	brAA (sf)	-	A+s(f)(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	FIDC CREDZ SN4	13.897,48	BRCRDZCTF074	-	-	AAAsf(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	FIDC CELG DIST SN B	3.294.028,73	BRFCLGCTF015	-	-	AA-sf(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	SANEAGOIFR IV 1 FIDC	2.577.472,93	BRSGSCTF002	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	FARM SYN AGRO FIDC	3.235.813,55	BR032XCTF002	-	-	AAAsf(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	-	-	BR ELETRO FIDC S1	4.614.909,75	BR0402CTF000	-	-	AAsf(bra)

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



4. RISCO OPERACIONAL

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

5. RISCO DE LIQUIDEZ

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

6. RISCO LEGAL

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

6.1. Relatório de Enquadramentos Legais



Relatório Resumo de Enquadramento

Patrimônio Líquido da Fundação **3.830.226.086,65**

Tópico do Enquadramento	Limite	Aplicação Atual	Valor Limite	% Aplicado	Status
% do Segmento RF/PL PLANO	100,00%	2.900.190.941,50	3.830.226.086,65	75,72%	Enquadrado
% do PL em Títulos de Emissão do Tesouro Nacional e/ou do BACE	100,00%	2.094.337.390,92	3.830.226.086,65	54,68%	Enquadrado
% do PL em Títulos RFI, exceto títulos do Tesouro Nacional	80,00%	805.853.550,58	3.064.180.914,98	21,04%	Enquadrado
% do PL em FIDC	20,00%	Verificar ReL. de Diversificação de FIDC's	766.045.228,74	0,00%	Enquadrado
% do PL em uma mesma pessoa jurídica não-financeira	10,00%	Verificar ReL. de Diversificação Inst. Não Financ.	383.022.614,37	0,00%	Enquadrado
% do PL em Instituições Financeiras	25,00%	Verificar ReL. de Diversificação Inst. Financ.	957.556.521,66	0,00%	Enquadrado
% de uma mesma Série de Debêntures	25,00%	Verificar ReL. de Diversificação Debêntures	957.556.521,66	0,00%	Enquadrado
% do PL em RV	70,00%	662.097.750,99	2.681.158.215,00	17,29%	Enquadrado
% do capital votante de uma empresa	25,00%	Verificar ReL. de Diversificação RV	957.556.521,66	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Imobiliários	20,00%	103.084.500,73	766.045.228,74	2,69%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Empréstimos	15,00%	32.075.993,13	574.533.935,83	0,84%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Estruturados	20,00%	0,00	766.045.228,74	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos no Exterior	10,00%	130.082.068,40	383.022.614,37	3,40%	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 2021 À 31 DE DEZEMBRO DE 2021



FIM EMB I A

DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	FUNTE ANBIMA			DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
								TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.		
01/12/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,3100%	5,3537%	5,1344%	5,4636%	-0,0437%	NÃO
02/12/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	RENASCEN	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,3495%	5,3143%	5,1470%	5,5159%	0,0352%	NÃO
14/12/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/03/2022	Compra	0,0601%	0,0600%	-0,0263%	0,0912%	0,0001%	NÃO
14/12/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/03/2022	Compra	0,0601%	0,0600%	-0,0263%	0,0912%	0,0001%	NÃO
30/12/2021	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/03/2023	Compra	0,0496%	0,0502%	-0,0042%	0,1291%	-0,0006%	NÃO

FIM EMB II A

DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	FUNTE ANBIMA			DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
								TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.		
09/12/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	LTN	01/07/2023	Compra	11,5568%	11,5350%	11,0410%	11,9444%	0,0218%	NÃO
10/12/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	LTN	01/07/2023	Compra	11,5594%	11,3139%	10,8659%	12,1462%	0,2455%	NÃO
16/12/2021	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2022	Compra	5,4991%	5,6223%	4,9602%	5,9262%	-0,1232%	NÃO
16/12/2021	FIM EMB II A	BNP	XP CCTVM	NTN-B	15/08/2026	Compra	5,0229%	5,0851%	4,7384%	5,2492%	-0,0622%	NÃO
16/12/2021	FIM EMB II A	BNP	XP CCTVM	NTN-B	15/08/2028	Compra	5,0390%	5,0964%	4,7914%	5,2370%	-0,0574%	NÃO
16/12/2021	FIM EMB II A	BNP	GUIDE CT	NTN-B	15/08/2050	Venda	5,2305%	5,3228%	5,0661%	5,3956%	-0,0923%	NÃO

FIM EMB VI A CRED PRIV

DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	FUNTE ANBIMA			DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
								TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.		
01/12/2021	FIM EMB VI A CRED PRIV	ICATU VA	TERRA	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,2990%	5,3537%	5,1344%	5,4636%	-0,0547%	NÃO



RELATÓRIO DE CONTROLE DE RISCO
E RENTABILIDADE - DEZEMBRO DE 2021



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



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
01-12-21	FIA RVA EMB II	Venda	BIDI11	35,82	48.600,00	1.740.731,00	33,33	35,71	38,58	35.285,00
01-12-21	FIA RVA EMB II	Venda	IFCM3	15,11	70.000,00	1.057.700,00	14,56	14,88	15,30	5.017,00
01-12-21	FIA RVA EMB II	Compra	ITUB4	22,83	38.900,00	887.914,00	22,20	22,50	22,92	43.115,00
01-12-21	FIA RVA EMB II	Venda	MGLU3	7,56	143.100,00	1.081.864,87	6,88	7,32	8,10	91.812,00
01-12-21	FIA RVA EMB II	Compra	PETRA	30,44	37.000,00	1.126.119,00	29,48	30,09	30,67	167.331,00
01-12-21	FIA RVA EMB II	Compra	VBRR3	21,31	90.300,00	1.924.509,00	21,00	21,36	21,99	37.984,00
01-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	ANIM3	8,12	7.300,00	59.249,98	7,89	8,24	8,80	27.093,00
01-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	10,58	9.400,00	99.420,17	10,29	10,52	11,07	30.835,00
01-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	9,74	14.900,00	145.065,96	9,62	9,75	9,89	38.741,00
01-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	17,65	3.800,00	67.058,39	17,40	17,61	17,97	14.447,00
01-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	SULA11	25,11	2.000,00	50.220,61	24,35	25,28	26,25	24.408,00
01-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	58,52	3.400,00	198.954,50	56,30	58,43	59,49	43.950,00
01-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	VALE3	70,97	2.200,00	156.127,58	69,97	70,99	71,95	80.962,00
01-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	VBRR3	21,60	4.000,00	86.400,00	21,00	21,36	21,99	37.984,00
01-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	VBRR3	21,42	16.600,00	355.644,44	21,00	21,36	21,99	37.984,00
01-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	VBRR3	21,40	4.000,00	85.592,25	21,00	21,36	21,99	37.984,00
01-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	22,24	2.700,00	60.045,56	21,83	22,36	23,04	20.875,00
01-12-21	FIM EMB I A	Compra	GGBR4	26,82	1.104,00	29.609,28	26,17	26,67	27,24	37.615,00
01-12-21	FIM EMB I A	Compra	GGBR4	26,71	3.096,00	82.683,35	26,17	27,24	27,24	37.615,00
01-12-21	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	PVBI11	84,77	2.023,00	171.482,89	83,35	84,49	85,19	4.986,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	ABEV3	15,86	12.000,00	190.320,00	15,64	15,85	16,20	63.980,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	ALPA4	38,26	400,00	15.304,00	37,68	39,00	40,34	16.562,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	AMER3	28,29	1.438,00	40.681,78	28,25	29,36	31,35	21.486,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	ASAI3	12,47	2.100,00	26.187,00	12,36	12,59	12,95	23.671,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	AZUL4	21,86	900,00	19.674,00	21,83	23,02	24,50	32.934,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	B3SA3	11,01	16.400,00	180.564,00	10,99	11,20	11,51	62.234,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	BBAS3	31,30	3.700,00	115.810,00	31,30	31,99	32,80	61.606,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	BBDC3	16,94	3.690,00	62.497,80	16,91	17,21	17,52	14.481,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	BBDC4	19,83	12.590,00	249.657,00	19,81	20,14	20,56	65.144,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	BBSE3	20,43	1.900,00	38.817,00	20,41	20,64	21,12	25.729,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	BEEF3	8,40	600,00	5.040,00	8,40	8,52	8,70	16.294,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	BIDI11	33,44	1.300,00	43.472,00	33,33	35,71	38,58	35.285,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	BIDI4	11,37	500,00	5.685,00	11,23	11,99	12,70	29.013,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	BPAC11	20,78	3.500,00	72.730,00	20,63	21,29	22,09	42.157,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	BPAN4	10,94	900,00	9.846,00	10,86	11,31	11,84	12.607,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	BRAP4	49,95	671,00	33.514,39	49,86	50,53	51,12	13.792,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	BRFS3	19,24	2.200,00	42.328,00	18,91	19,27	19,97	24.045,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	BRKM5	52,78	700,00	36.946,00	51,10	53,38	54,58	30.395,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	BRML3	7,69	2.200,00	16.918,00	7,66	7,88	8,20	26.636,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	CASH3	2,65	1.400,00	3.710,00	2,65	2,81	3,12	33.424,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	CCRO3	11,70	3.000,00	35.100,00	11,66	11,95	12,62	39.872,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	CIEL3	2,01	3.100,00	6.231,00	2,01	2,06	2,13	19.032,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	CMIG4	12,96	2.989,00	38.734,77	12,95	13,12	13,50	22.953,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	COGN3	2,36	4.900,00	11.564,00	2,35	2,44	2,55	23.405,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	CPFE3	26,67	500,00	13.335,00	26,52	26,97	27,34	34.142,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	CPLE6	6,11	4.200,00	25.662,00	6,11	6,18	6,27	30.578,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	CRFB3	15,03	1.100,00	16.533,00	14,89	15,15	15,55	20.244,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	CSAN3	21,22	3.200,00	67.904,00	21,02	21,35	21,81	27.303,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	CSNA3	21,59	1.800,00	38.862,00	21,55	22,21	22,80	22.312,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	CVCB3	13,33	600,00	7.998,00	13,28	13,75	14,42	21.730,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	CYRE3	13,17	800,00	10.536,00	13,16	13,68	14,21	35.814,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	DCOX3	17,97	800,00	14.376,00	17,82	18,10	18,70	20.163,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	ECOR3	8,14	900,00	7.326,00	8,04	8,29	8,64	22.863,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	EGIE3	38,37	700,00	26.859,00	38,21	38,54	39,19	8.699,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	ELET3	32,75	1.000,00	32.750,00	32,30	33,03	33,70	18.106,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	ELET6	32,04	700,00	22.428,00	31,67	32,36	33,10	16.858,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	ENBR3	21,20	700,00	14.840,00	21,12	21,33	21,67	27.592,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	ENEV3	13,75	3.400,00	46.750,00	13,70	13,99	14,45	21.426,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	ENGI11	45,59	700,00	31.913,00	44,91	45,83	46,50	19.539,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	EQLT3	22,65	2.700,00	61.155,00	22,38	22,69	22,92	31.656,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	EZTC3	17,69	300,00	5.307,00	17,69	18,37	19,07	15.108,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	FLRY3	16,93	800,00	13.544,00	16,86	17,20	17,77	8.671,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	GGBR4	26,17	3.000,00	78.510,00	26,17	26,67	27,24	37.615,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	GNDI3	58,48	1.500,00	87.720,00	58,29	59,78	62,37	22.769,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	GOAU4	10,80	1.900,00	20.520,00	10,73	10,95	11,17	26.644,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	GOLL4	14,81	476,00	7.049,36	14,80	15,59	16,73	21.152,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	HAPV3	10,33	3.400,00	35.122,00	10,29	10,52	11,07	30.835,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	HYPE3	26,80	1.100,00	29.480,00	26,80	27,24	27,81	17.523,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	IGTI11	169,77	47,00	7.979,19	175,00	181,70	195,20	1.723,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	IRBR3	4,16	3.300,00	13.728,00	4,12	4,24	4,37	13.104,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	ITSA4	9,62	12.200,00	117.364,00	9,62	9,75	9,89	38.741,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	ITUB4	22,22	12.900,00	286.638,00	22,20	22,50	22,92	43.115,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	JBS53	33,98	3.700,00	125.726,00	33,77	34,47	36,26	40.048,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	JHSF3	4,63	800,00	3.704,00	4,63	4,77	4,92	14.249,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	KLBN11	24,02	2.200,00	52.844,00	23,79	24,31	24,78	33.006,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	LAME4	5,10	2.300,00	11.730,00	5,08	5,29	5,65	22.383,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	LCAM3	22,67	900,00	20.403,00	22,44	22,85	23,60	11.851,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	LEN3	28,29	2.730,00	77.235,90	27,97	28,77	29,66	40.907,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	LWSA3	11,88	1.100,00	13.068,00	11,81	12,62	13,94	33.368,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	MGLU3	6,88	8.000,00	55.040,00	6,88	7,32	8,10	91.812,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	MRF3	21,87	900,00	19.683,00	21,82	22,44	23,96	34.024,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	MRVE3	10,87	800,00	8.696,00	10,86	11,16	11,46	19.264,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	MULT3	19,22	800,00	15.376,00	19,11	19,64	20,41	31.058,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	NTCO3	25,69	2.300,00	59.087,00	25,54	26,23	27,48	39.378,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	PCAR3	21,71	400,00	8.684,00	21,67	22,38	23,06	9.619,00



RELATÓRIO DE CONTROLE DE RISCO
E RENTABILIDADE - DEZEMBRO DE 2021



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



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	PETR3	30,35	9.200,00	279.220,00	30,32	30,75	31,26	42.748,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	PETRA	29,60	12.300,00	364.080,00	29,48	30,09	30,67	167.331,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	PETZ3	18,45	700,00	12.915,00	17,81	18,41	18,99	24.009,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	PRI03	20,31	2.300,00	46.713,00	20,21	20,86	21,54	41.395,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	QUAL3	15,11	800,00	12.088,00	15,09	15,45	16,01	13.150,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	RADL3	21,81	2.900,00	63.249,00	21,73	21,98	22,61	23.538,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	RAIL3	17,51	3.300,00	57.783,00	17,40	17,61	17,97	41.447,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	RDOR3	48,01	900,00	43.209,00	47,56	48,88	50,99	15.362,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	RENT3	50,41	1.700,00	85.697,00	50,18	51,21	52,26	30.514,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	SBS3	33,96	900,00	30.564,00	33,21	33,89	34,37	12.842,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	SOMA3	12,92	1.137,00	14.691,79	12,73	13,18	14,00	17.033,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	SULA11	24,35	800,00	19.480,00	24,35	25,28	26,25	24.408,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	SUZB3	58,05	2.000,00	116.100,00	56,30	58,43	59,49	43.950,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	TAE11	35,90	600,00	21.540,00	35,74	36,05	36,67	11.554,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	TIMS3	13,79	2.100,00	28.959,00	13,70	13,87	14,08	15.955,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	TOTS3	29,81	1.400,00	41.734,00	29,50	30,31	32,21	30.150,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	UGPA3	13,92	2.900,00	40.368,00	13,86	14,22	14,72	26.283,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	USIM5	13,43	1.400,00	18.802,00	13,35	13,88	14,34	26.132,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	VALE3	70,23	9.000,00	632.070,00	69,97	70,99	71,95	80.962,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	VBBR3	21,17	3.200,00	67.744,00	21,00	21,36	21,99	37.984,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	VIIA3	5,20	4.300,00	22.360,00	5,20	5,49	5,85	32.993,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	VIVT3	49,98	1.200,00	59.976,00	49,80	50,26	51,07	13.097,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	WEGE3	32,49	4.000,00	129.960,00	32,39	32,80	33,27	39.728,00
01-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB V	Venda	YDUQ3	21,89	800,00	17.512,00	21,83	22,36	23,04	20.875,00
02-12-21	FIA RVA EMB II	Compra	CMIG4	13,39	100.000,00	1.338.517,00	13,11	13,46	13,65	26.657,00
02-12-21	FIA RVA EMB II	Compra	ELET6	33,72	25.700,00	866.638,00	32,28	33,67	34,15	15.254,00
02-12-21	FIA RVA EMB II	Venda	IFCM3	14,79	73.700,00	1.089.695,00	13,87	14,81	15,07	8.128,00
02-12-21	FIA RVA EMB II	Venda	IINTB3	25,37	25.200,00	639.299,00	24,60	25,24	25,76	6.832,00
02-12-21	FIA RVA EMB II	Compra	ITUB4	22,97	47.100,00	1.081.952,00	22,34	22,93	23,16	58.871,00
02-12-21	FIA RVA EMB II	Venda	NTCO3	25,25	71.800,00	1.812.947,41	25,00	25,63	26,40	49.271,00
02-12-21	FIA RVA EMB II	Compra	PRI03	20,85	69.200,00	1.442.714,00	19,51	20,44	21,06	39.336,00
02-12-21	FIA RVA EMB II	Compra	RENT3	53,00	31.200,00	1.653.532,53	51,26	52,89	53,72	44.656,00
02-12-21	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	57,12	9.300,00	531.231,39	55,56	57,09	59,19	41.753,00
02-12-21	FIA RVA EMB II	Venda	TOTS3	30,00	68.300,00	2.048.730,00	29,68	30,47	31,63	29.081,00
02-12-21	FIA RVA EMB II	Compra	VALE3	72,66	24.200,00	1.758.486,09	70,11	72,24	73,56	76.102,00
02-12-21	FIA RVA EMB II	Compra	VALE3	73,23	20.000,00	1.464.698,00	70,11	72,24	73,56	76.102,00
02-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	AMER3	27,30	2.000,00	54.601,40	26,58	27,73	28,97	27.356,00
02-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	ANIM3	8,17	4.100,00	33.500,09	7,81	8,13	8,30	14.015,00
02-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	ASA13	12,48	4.100,00	51.165,65	12,26	12,48	12,71	20.344,00
02-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	ASA13	12,45	2.300,00	28.635,00	12,26	12,48	12,71	20.344,00
02-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	CPFE3	27,83	3.000,00	83.487,85	26,78	27,76	28,48	18.404,00
02-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	GGBR4	27,47	5.700,00	156.579,44	26,43	27,38	27,73	35.764,00
02-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	GOAU4	11,32	9.300,00	105.297,87	10,90	11,27	11,42	20.811,00
02-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	10,61	7.600,00	80.664,88	10,38	10,72	11,02	25.449,00
02-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	HYPE3	27,06	5.900,00	159.642,73	26,78	27,23	27,56	21.010,00
02-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	25,67	1.600,00	41.079,11	25,00	25,63	26,40	49.271,00
02-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	PETR3	28,38	12.000,00	340.582,28	26,90	28,65	29,60	77.809,00
02-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	17,60	3.200,00	56.326,68	17,41	17,61	17,92	29.353,00
02-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	12,66	1.100,00	13.926,00	12,50	12,82	13,27	15.318,00
02-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	12,60	2.100,00	26.463,31	12,50	12,82	13,27	15.318,00
02-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	SULA11	25,90	1.000,00	25.901,08	24,50	25,72	26,07	28.125,00
02-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	SULA11	25,90	1.500,00	38.855,39	24,50	25,72	26,07	28.125,00
02-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	57,34	1.400,00	80.277,30	55,56	57,09	59,19	41.753,00
02-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	USIM5	14,25	3.800,00	54.148,93	13,45	14,03	14,43	39.378,00
02-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	VALE3	72,96	1.500,00	109.442,14	70,11	72,24	73,56	76.102,00
02-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	21,32	5.000,00	106.604,53	21,10	21,41	21,70	28.746,00
02-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	22,92	1.500,00	34.374,13	21,71	22,79	23,26	18.197,00
02-12-21	FIA RVA EMB IV	Compra	CLSA3	8,79	9.112,00	80.126,23	8,20	8,72	9,13	6.763,00
02-12-21	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	5,71	6.249,00	35.663,16	5,58	5,68	5,80	21.099,00
02-12-21	FIA RVA EMB IV	Venda	UGPA3	14,18	23.086,00	327.385,00	13,83	14,10	14,52	28.090,00
02-12-21	FIM EMB I A	Venda	AMER3	26,98	1.200,00	32.381,49	26,58	27,73	28,97	27.356,00
02-12-21	FIM EMB I A	Venda	CBAV3	11,28	446,00	5.029,90	10,97	11,28	11,93	8.212,00
02-12-21	FIM EMB I A	Venda	CBAV3	11,21	2.004,00	22.456,25	10,97	11,28	11,93	8.212,00
02-12-21	FIM EMB I A	Venda	CRFB3	14,83	3.337,00	49.480,16	14,73	14,89	15,25	20.615,00
02-12-21	FIM EMB I A	Compra	GGBR4	26,99	2.100,00	56.684,54	26,43	27,38	27,73	35.764,00
02-12-21	FIM EMB I A	Compra	RENT3	52,94	1.100,00	58.239,24	51,26	52,89	53,72	44.656,00
02-12-21	FIM EMB I A	Venda	VALE3	70,76	800,00	56.607,39	70,11	72,24	73,56	76.102,00
02-12-21	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	PVBI11	85,25	1.387,00	118.240,09	83,99	85,23	87,41	5.458,00
03-12-21	FIA RVA EMB II	Compra	ASA13	13,07	62.700,00	819.801,81	12,51	13,17	13,34	29.358,00
03-12-21	FIA RVA EMB II	Compra	RENT3	54,94	6.200,00	340.647,20	54,01	55,29	56,98	44.179,00
03-12-21	FIA RVA EMB II	Venda	USIM5	14,10	89.600,00	1.263.178,39	13,88	14,21	14,73	32.379,00
03-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	BRAP4	51,47	2.700,00	138.957,72	50,83	51,72	53,25	22.033,00
03-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	GGBR4	27,80	2.700,00	75.066,98	27,53	27,92	28,59	38.080,00
03-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	196,82	100,00	19.681,89	188,00	197,43	206,34	2.886,00
03-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	9,88	6.700,00	66.201,49	9,76	9,90	10,08	38.709,00
03-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	NINJ3	4,17	3.800,00	15.846,00	3,92	4,28	4,57	5.359,00
03-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	18,09	3.900,00	70.541,84	17,60	18,14	18,55	33.037,00
03-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	54,89	2.200,00	120.749,65	54,01	55,29	56,98	44.179,00
03-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	VALE3	71,70	1.900,00	136.227,75	71,00	72,15	74,34	91.116,00
03-12-21	FIA RVA EMB IV	Compra	CLSA3	9,54	15.325,00	146.163,87	8,86	9,50	9,77	6.455,00
03-12-21	FIA RVA EMB IV	Compra	GNDI3	64,81	4.300,00	278.693,00	61,76	64,70	66,03	23.127,00
03-12-21	FIA RVA EMB IV	Compra	IINTB3	25,89	3.500,00	90.632,00	25,46	26,09	26,65	5.154,00
03-12-21	FIA RVA EMB IV	Compra	PETRA	28,67	9.700,00	278.059,00	28,22	28,61	28,94	140.388,00
03-12-21	FIA RVA EMB IV	Compra	PRI03	21,28	12.900,00	274.464,00	21,03	21,45	22,04	35.577,00
03-12-21	FIA RVA EMB IV	Venda	UGPA3	14,70	12.614,00	185.425,43	14,25	14,77	15,15	33.237,00
03-12-21	FIM EMB I A	Compra	CASH3	3,36	3.500,00	11.749,39	2,74	3,11	3,49	44.446,00
03-12-21	FIM EMB I A	Venda	CBAV3	11,55	2.400,00	27.720,14	11,17	11,63	12,01	10.050,00
03-12-21	FIM EMB I A	Venda	CRFB3	14,95	6.000,00	89.726,57	14,69	14,92	15,32	42.125,00
03-12-21	FIM EMB I A	Compra	GGBR4	28,08	2.000,00	56.164,15	27,53	27,92	28,59	38.080,00
03-12-21	FIM EMB I A	Venda	NTCO3	25,26	2.200,00	55.569,62	25,06	25,90	27,66	56.616,00



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



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
03-12-21	FIM EMB I A	Venda	NTCO3	25,76	4.300,00	110.757,15	25,06	25,90	27,66	56.616,00
03-12-21	FIM EMB I A	Compra	RAIZ4	5,96	4.800,00	28.586,69	5,63	5,85	6,03	10.999,00
03-12-21	FIM EMB I A	Compra	RENT3	54,95	1.000,00	54.953,12	54,01	55,29	56,98	44.179,00
03-12-21	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	PVB111	88,89	2.047,00	181.957,83	84,96	87,10	89,88	7.027,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	AMER3	29,29	700,00	20.503,99	27,76	29,00	29,98	20.800,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	ANIM3	8,55	400,00	3.419,09	8,25	8,51	8,74	8.650,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	ANIM3	8,55	2.600,00	22.242,37	8,25	8,51	8,74	8.650,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	13,77	500,00	6.885,00	13,37	13,75	13,90	19.864,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	B3SA3	11,85	1.400,00	16.584,85	11,64	11,82	12,02	62.398,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	BBDC4	21,47	500,00	10.733,77	20,77	21,43	21,75	84.007,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	21,28	300,00	6.385,29	21,17	21,30	21,50	10.902,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	BIDI11	33,20	500,00	16.598,44	32,86	33,53	34,78	24.325,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	BMGBA	3,05	600,00	1.827,00	2,98	3,03	3,09	2.563,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	21,35	700,00	14.947,88	20,84	21,24	21,60	28.067,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	BRAP4	53,33	200,00	10.666,00	51,95	53,13	53,97	21.212,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	CESP6	23,16	400,00	9.263,10	22,84	23,09	23,39	8.260,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	CESP6	23,11	2.300,00	53.148,21	22,84	23,09	23,39	8.260,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	CPFE3	27,72	1.000,00	27.715,72	27,45	27,73	28,42	12.224,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	CRFB3	15,09	1.100,00	16.602,66	14,85	15,06	15,19	20.175,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	CSED3	7,16	1.100,00	7.876,92	6,91	7,11	7,27	2.526,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	CYRE3	15,57	800,00	12.452,00	14,89	15,44	15,75	27.923,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	36,00	300,00	10.800,57	35,54	36,11	36,73	28.395,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	ELET6	35,19	400,00	14.076,87	34,69	35,28	35,76	19.887,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	23,47	1.900,00	44.600,80	23,32	23,49	23,84	17.489,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	EUCA4	9,28	400,00	3.712,66	9,06	9,24	9,66	201,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	GNDI3	63,90	100,00	6.390,00	63,18	64,11	65,18	10.910,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	GOAU4	11,73	4.100,00	48.092,09	11,49	11,69	11,80	19.842,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	11,32	3.600,00	40.755,87	11,23	11,34	11,55	23.870,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	HBSA3	3,09	1.200,00	3.705,38	3,00	3,06	3,14	4.634,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	HYPE3	28,64	1.100,00	31.508,80	28,27	28,56	28,93	10.290,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	201,92	100,00	20.192,00	198,05	201,65	204,40	1.977,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	202,55	100,00	20.255,46	198,05	201,65	204,40	1.977,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	10,02	7.600,00	76.157,09	9,85	9,99	10,09	34.302,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	23,51	300,00	7.052,50	23,00	23,41	23,77	52.098,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	LCAM3	24,23	400,00	9.690,80	23,94	24,27	24,76	19.366,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	LREN3	29,59	700,00	20.714,86	28,98	29,59	30,00	25.696,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	MRVE3	12,17	200,00	2.434,00	11,88	12,11	12,36	20.688,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	NINJ3	4,34	6.800,00	29.512,00	4,11	4,35	4,59	2.446,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	26,20	1.700,00	44.533,70	25,51	26,11	26,76	29.795,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	OMGE3	27,96	600,00	16.775,99	27,58	27,75	28,00	6.848,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	PARD3	20,64	400,00	8.256,91	20,10	20,55	20,78	974,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	PETR3	30,49	1.300,00	39.635,55	30,08	30,44	30,70	31.511,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	PRIO3	21,63	300,00	6.487,99	21,36	21,64	21,99	28.339,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	QUAL3	16,51	200,00	3.301,00	16,29	16,47	16,66	9.796,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	17,73	1.600,00	28.373,81	17,50	17,80	18,37	27.304,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	14,43	800,00	11.540,99	13,98	14,36	14,70	2.389,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	54,85	800,00	43.883,40	54,34	55,04	56,27	33.130,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	SEER3	11,12	500,00	5.558,32	10,74	11,07	11,25	2.479,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	13,52	800,00	10.818,14	13,18	13,54	13,79	9.488,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	SULA11	26,33	1.600,00	42.127,98	26,06	26,40	26,93	17.049,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	58,23	700,00	40.761,50	57,16	59,18	61,25	24.253,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	SYNE3	14,19	300,00	4.257,03	13,55	14,12	14,45	4.579,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	TEND3	18,71	1.100,00	20.580,52	17,90	18,58	18,93	7.673,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	USIM5	14,66	500,00	7.331,68	14,15	14,56	14,82	28.812,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	VALE3	75,29	200,00	15.058,00	71,96	74,70	75,99	74.546,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	22,00	2.200,00	48.399,44	21,65	21,96	22,21	17.078,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	WEST3	3,63	300,00	1.088,00	3,55	3,62	3,76	1.656,00
06-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	24,07	900,00	21.664,55	23,37	23,91	24,37	11.504,00
06-12-21	FIA RVA EMB IV	Compra	BIDI11	33,05	1.700,00	56.183,23	32,86	33,53	34,78	24.325,00
06-12-21	FIA RVA EMB IV	Compra	BPAC11	21,28	9.500,00	202.166,35	20,84	21,24	21,60	28.067,00
06-12-21	FIA RVA EMB IV	Compra	BRML3	8,12	23.300,00	189.138,23	7,86	8,05	8,20	21.653,00
06-12-21	FIA RVA EMB IV	Compra	CLSA3	9,85	9.896,00	97.444,99	9,29	9,96	10,58	5.660,00
06-12-21	FIA RVA EMB IV	Compra	ELET3	35,71	3.400,00	121.404,21	35,54	36,11	36,73	28.395,00
06-12-21	FIA RVA EMB IV	Compra	ESPA3	8,54	8.075,00	68.940,31	8,26	8,50	8,69	5.787,00
06-12-21	FIA RVA EMB IV	Compra	GGPS3	16,28	9.300,00	151.425,07	15,30	15,99	16,48	4.972,00
06-12-21	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	6,01	5.037,00	30.287,08	5,90	6,09	6,20	15.390,00
06-12-21	FIA RVA EMB IV	Compra	GNDI3	64,14	2.885,00	185.035,40	63,18	64,11	65,18	10.910,00
06-12-21	FIA RVA EMB IV	Compra	INTB3	26,25	2.600,00	68.261,55	25,75	26,20	26,73	5.081,00
06-12-21	FIA RVA EMB IV	Compra	MATD3	15,97	6.100,00	97.404,06	15,41	15,99	16,25	5.095,00
06-12-21	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	20,56	4.300,00	88.411,18	20,39	20,59	20,95	16.762,00
06-12-21	FIA RVA EMB IV	Compra	NTCO3	26,50	6.200,00	164.301,41	25,51	26,11	26,76	29.795,00
06-12-21	FIA RVA EMB IV	Compra	PETRA	28,93	8.700,00	251.679,98	28,68	29,01	29,27	123.336,00
06-12-21	FIA RVA EMB IV	Compra	PRIO3	21,62	11.300,00	244.251,87	21,36	21,64	21,99	28.339,00
06-12-21	FIA RVA EMB IV	Compra	RAIL3	17,60	22.100,00	389.041,73	17,50	17,80	18,37	27.304,00
06-12-21	FIA RVA EMB IV	Venda	UGPA3	14,87	12.370,00	183.919,73	14,59	14,85	15,03	21.243,00
06-12-21	FIM EMB I A	Venda	AMER3	29,25	900,00	26.324,97	27,76	29,00	29,98	20.800,00
06-12-21	FIM EMB I A	Compra	BBDC4	21,64	1.500,00	32.465,45	20,77	21,43	21,75	84.007,00
06-12-21	FIM EMB I A	Venda	NTCO3	26,03	800,00	20.825,05	25,51	26,11	26,76	29.795,00
06-12-21	FIM EMB I A	Venda	NTCO3	25,71	1.700,00	43.713,17	25,51	26,11	26,76	29.795,00
06-12-21	FIM EMB I A	Compra	RENT3	55,06	1.200,00	66.068,17	54,34	55,04	56,27	33.130,00
06-12-21	FIM EMB I A	Compra	RENT3	54,95	500,00	27.474,37	54,34	55,04	56,27	33.130,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ABEV3	16,08	12.635,00	203.170,80	15,95	16,16	16,34	36.769,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ALPA4	39,31	475,00	18.671,75	38,57	39,14	39,58	9.218,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	AMER3	29,83	1.615,00	48.170,50	27,76	29,00	29,98	20.800,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ASAI3	13,75	2.280,00	31.346,00	13,37	13,75	13,90	19.864,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	AZUL4	24,80	950,00	23.559,00	22,57	24,11	25,11	26.484,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	B3SA3	11,78	17.575,00	207.038,00	11,64	11,82	12,02	62.398,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBAS3	33,07	4.085,00	135.095,20	32,62	33,26	33,60	47.212,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBDC3	18,02	3.990,00	71.904,30	17,88	18,22	18,49	15.868,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBDC4	21,20	13.585,00	287.994,35	20,77	21,43	21,75	84.007,00



RELATÓRIO DE CONTROLE DE RISCO
E RENTABILIDADE - DEZEMBRO DE 2021



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



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBovespa			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBSÉ3	21,29	1.900,00	40.451,00	21,17	21,30	21,50	10.902,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BEEF3	8,62	665,00	5.731,00	8,60	8,71	8,84	9.434,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BIDI11	33,00	1.425,00	47.024,50	32,86	33,53	34,78	24.325,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BID4	11,04	570,00	6.293,50	11,00	11,21	11,64	16.185,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BPAC11	21,20	3.800,00	80.560,00	20,84	21,24	21,60	28.067,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BPAN4	11,71	950,00	11.128,00	11,17	11,59	11,93	13.115,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRAP4	53,56	760,00	40.705,00	51,95	53,13	53,97	21.212,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRFS3	20,61	2.375,00	48.944,50	19,68	20,74	21,23	23.147,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRKM5	66,37	760,00	50.440,00	61,63	64,76	66,92	28.425,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRML3	8,09	2.470,00	19.980,20	7,86	8,05	8,20	21.653,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CASH3	3,02	1.615,00	4.877,75	3,00	3,14	3,61	36.284,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CCRO3	12,95	3.230,00	41.825,50	12,88	13,19	13,56	32.362,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CIEL3	2,27	3.325,00	7.547,25	2,18	2,24	2,29	12.561,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CMIG4	13,67	3.230,00	44.157,70	13,66	13,76	13,95	12.926,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	COGN3	2,56	5.320,00	13.618,00	2,47	2,54	2,62	18.533,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CPFE3	27,54	570,00	15.700,50	27,45	27,73	28,42	12.224,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CPL66	6,14	4.560,00	28.002,60	6,10	6,18	6,28	21.424,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CRFB3	15,09	1.235,00	18.630,55	14,85	15,06	15,19	20.175,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CSAN3	21,89	3.420,00	74.863,00	21,78	22,05	22,77	32.461,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CSNA3	24,13	1.900,00	45.847,00	23,15	23,85	24,28	23.798,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CVCB3	14,97	665,00	9.953,25	13,91	14,66	15,29	17.550,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CYRE3	15,40	855,00	13.163,15	14,89	15,44	15,75	27.923,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	DXCO3	18,19	760,00	13.825,40	18,05	18,23	18,48	11.337,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ECOR3	9,00	950,00	8.547,50	8,82	9,06	9,25	18.918,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	EGIE3	39,74	760,00	30.201,80	39,43	39,62	39,91	7.648,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ELET3	35,67	1.045,00	37.274,35	35,54	36,11	36,73	28.395,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ELET6	34,87	665,00	23.191,30	34,69	35,28	35,76	19.887,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ENBR3	21,42	665,00	14.242,50	21,25	21,48	21,76	8.611,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ENEV3	14,58	3.610,00	52.633,70	14,47	14,64	14,84	17.374,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ENGI11	46,23	760,00	35.135,60	46,03	46,53	47,47	11.259,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	EQLT3	23,32	2.945,00	68.673,80	23,32	23,49	23,84	17.489,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	EZTC3	20,48	285,00	5.836,75	19,69	20,27	20,59	10.786,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	FLRY3	18,46	855,00	15.781,65	18,35	18,48	18,78	5.855,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	GETT11	3,82	285,00	1.088,40	3,78	3,84	3,97	3.237,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	GGBR4	28,50	3.135,00	89.342,95	28,33	28,64	29,01	33.964,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	GNDI3	64,04	1.710,00	109.502,00	63,18	64,11	65,18	10.910,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	GOAU4	11,71	1.995,00	23.355,75	11,49	11,69	11,80	19.842,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	GOLL4	16,87	475,00	8.013,00	15,35	16,37	17,13	18.189,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	HAPV3	11,23	3.800,00	42.674,00	11,23	11,34	11,55	23.870,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	HYPE3	28,36	1.235,00	35.026,00	28,27	28,56	28,93	10.290,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	IRBR3	4,33	3.610,00	15.631,00	4,17	4,32	4,42	13.112,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ITSA4	9,97	13.015,00	129.759,55	9,85	9,99	10,09	34.302,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ITUB4	23,25	13.775,00	320.264,25	23,00	23,41	23,77	52.098,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	JBS53	33,74	3.895,00	131.423,00	33,07	33,61	34,07	30.183,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	JHSF3	5,42	855,00	4.633,55	5,23	5,35	5,44	11.469,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	KLBN11	25,13	2.375,00	59.695,00	24,27	25,07	25,34	28.030,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	LAME4	5,45	2.470,00	13.458,70	5,10	5,32	5,50	22.095,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	LCAM3	24,17	950,00	22.966,00	23,94	24,27	24,76	19.366,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	LEN3	29,79	2.850,00	84.912,00	28,98	29,59	30,00	25.696,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	LWSA3	12,92	1.235,00	15.951,30	12,20	12,62	12,96	19.567,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	MGLU3	7,30	8.170,00	59.640,30	7,10	7,28	7,44	74.578,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	MRF3	20,84	1.045,00	21.781,95	20,59	21,08	21,49	23.316,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	MRFV3	12,11	855,00	10.349,90	11,88	12,11	12,36	20.688,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	MULT3	20,64	760,00	15.685,60	20,39	20,59	20,95	16.762,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	NTCO3	26,76	2.470,00	66.091,60	25,51	26,11	26,76	29.795,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PCAR3	22,32	475,00	10.603,75	22,13	22,36	22,76	7.676,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PETR3	30,35	9.880,00	299.852,40	30,08	30,44	30,70	31.511,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PETRA	28,89	13.205,00	381.492,05	28,68	29,01	29,27	123.336,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PETZ3	18,91	855,00	16.170,00	18,92	19,11	19,45	14.405,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PRI03	21,61	2.470,00	53.365,50	21,36	21,64	21,99	28.339,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	QUAL3	16,56	855,00	14.160,45	16,29	16,47	16,66	9.796,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RADL3	22,79	3.135,00	71.442,80	22,71	22,87	23,25	18.607,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RAIL3	17,60	3.515,00	61.864,30	17,50	17,80	18,37	27.304,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RDOR3	47,71	950,00	45.324,50	47,25	47,92	50,12	14.692,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RENT3	54,77	1.710,00	93.654,70	54,34	55,04	56,27	33.130,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SANB11	33,65	1.045,00	35.167,50	33,13	33,80	34,28	10.609,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SBSF3	37,83	950,00	35.939,00	37,44	38,12	38,53	12.984,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SOMA3	13,63	1.235,00	16.830,60	13,18	13,54	13,79	9.488,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SULA11	26,10	855,00	22.318,55	26,06	26,40	26,93	17.049,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SUZB3	57,88	2.090,00	120.969,00	57,16	58,21	59,18	24.253,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	TAE11	38,06	665,00	25.307,80	37,97	38,14	38,57	14.213,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	TIMS3	13,60	2.375,00	32.300,00	13,59	13,74	14,00	11.864,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	TOTS3	30,62	1.520,00	46.535,00	29,80	30,23	30,87	24.785,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	UGPA3	14,97	3.135,00	46.932,35	14,59	14,85	15,03	21.243,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	USIM5	14,78	1.520,00	22.463,40	14,15	14,56	14,82	28.812,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VALE3	75,77	9.785,00	741.417,95	71,96	74,70	75,99	74.546,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VBBR3	22,10	3.325,00	73.484,25	21,65	21,96	22,21	17.078,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VIIA3	5,61	4.655,00	26.113,45	5,36	5,52	5,63	26.429,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VIVT3	50,11	1.235,00	61.880,50	50,10	50,38	51,02	10.130,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	WEGE3	33,01	4.275,00	141.113,25	32,76	32,98	33,25	21.543,00
06-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	YDUQ3	23,83	855,00	20.370,80	23,37	23,91	24,37	11.504,00
07-12-21	FIA RVA EMB II	Compra	CASH3	3,20	272.000,00	870.796,22	3,12	3,28	3,52	39.227,00
07-12-21	FIA RVA EMB II	Venda	CIEL3	2,26	290.900,00	657.136,00	2,24	2,26	2,31	10.725,00
07-12-21	FIA RVA EMB II	Compra	CYRE3	15,39	133.300,00	2.051.587,71	15,11	15,33	15,84	19.194,00
07-12-21	FIA RVA EMB II	Compra	LAME4	5,52	113.900,00	629.153,81	5,36	5,48	5,61	18.826,00
07-12-21	FIA RVA EMB II	Venda	RAPT4	11,06	38.000,00	420.212,77	10,86	11,01	11,47	15.475,00
07-12-21	FIA RVA EMB II	Venda	STBP3	6,13	102.300,00	627.115,44	5,93	6,08	6,41	9.125,00
07-12-21	FIA RVA EMB II	Compra	VALE3	78,55	14.200,00	1.115.445,50	76,10	77,69	79,81	97.246,00
07-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	BRAP4	54,39	1.300,00	70.706,86	53,57	54,38	56,04	27.655,00
07-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	CESP6	23,15	5.100,00	118.076,01	22,91	23,14	23,43	6.268,00



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



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	
07-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	CPFE3	27,27	1.400,00	38.178,01	27,08	27,27	27,84	12.456,00
07-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	CPFE3	27,25	800,00	21.801,04	27,08	27,27	27,84	12.456,00
07-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	ELET6	34,69	800,00	27.753,38	34,22	34,68	35,59	7.959,00
07-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	11,16	3.500,00	39.070,43	11,02	11,15	11,40	14.686,00
07-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	202,49	100,00	20.249,29	199,76	202,18	207,50	1.107,00
07-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	9,92	13.900,00	137.947,51	9,85	9,91	10,09	17.869,00
07-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	LCAM3	23,72	3.600,00	85.387,22	23,49	23,80	24,66	15.739,00
07-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	LCAM3	23,98	1.100,00	26.378,00	23,49	23,80	24,66	15.739,00
07-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	PRIO3	22,14	2.500,00	55.358,32	21,85	22,26	22,90	34.625,00
07-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	53,63	1.500,00	101.889,95	53,01	53,70	55,99	22.500,00
07-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	SULA11	26,21	1.400,00	36.688,18	26,02	26,27	26,64	16.471,00
07-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	VALE3	77,75	1.300,00	101.070,68	76,10	77,69	79,81	97.246,00
07-12-21	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	6,19	9.786,00	60.548,04	6,15	6,24	6,24	12.135,00
07-12-21	FIA RVA EMB IV	Venda	UGPA3	14,90	22.095,00	329.292,58	14,70	14,91	15,15	18.490,00
07-12-21	FIM EMB I A	Compra	RENT3	53,47	1.000,00	53.473,30	53,01	53,70	55,59	22.500,00
08-12-21	FIA RVA EMB II	Venda	B3SA3	12,13	83.200,00	1.008.913,20	11,94	12,11	12,27	68.516,00
08-12-21	FIA RVA EMB II	Compra	CASH3	3,45	100.000,00	345.000,00	3,26	3,38	3,62	30.658,00
08-12-21	FIA RVA EMB II	Compra	CYRE3	15,84	40.100,00	635.279,04	15,07	15,88	16,21	25.039,00
08-12-21	FIA RVA EMB II	Venda	ITSA4	9,90	50.000,00	495.000,00	9,80	9,86	9,96	26.375,00
08-12-21	FIA RVA EMB II	Venda	LWSA3	13,35	20.500,00	273.675,00	13,26	14,36	14,96	21.177,00
08-12-21	FIA RVA EMB II	Compra	MGLU3	7,04	43.800,00	308.299,44	6,63	6,92	7,57	115.495,00
08-12-21	FIA RVA EMB II	Compra	VBBR3	22,97	95.600,00	2.195.466,96	22,17	22,82	23,31	32.346,00
08-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	CESP6	23,31	1.500,00	34.957,50	23,13	23,39	23,86	10.036,00
08-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	CESP6	23,38	1.300,00	30.389,65	23,13	23,39	23,86	10.036,00
08-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	CESP6	23,49	1.000,00	23.492,51	23,13	23,39	23,86	10.036,00
08-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	CPFE3	27,45	400,00	10.978,62	27,22	27,41	27,70	11.664,00
08-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	CPFE3	27,38	500,00	13.690,92	27,22	27,41	27,70	11.664,00
08-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	CPFE3	27,36	700,00	19.151,54	27,22	27,41	27,70	11.664,00
08-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	36,20	4.000,00	144.785,10	35,06	35,80	36,88	25.221,00
08-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	ELET6	35,11	100,00	3.510,55	34,20	35,03	36,25	17.882,00
08-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	ELET6	35,39	100,00	3.539,20	34,20	35,03	36,25	17.882,00
08-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	ELET6	34,42	200,00	6.883,21	34,20	35,03	36,25	17.882,00
08-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	11,38	6.000,00	68.300,35	11,16	11,37	11,50	16.272,00
08-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	22,58	2.500,00	56.447,94	22,45	22,69	23,14	46.161,00
08-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	22,63	4.800,00	108.616,58	22,45	22,69	23,14	46.161,00
08-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	LCAM3	24,51	5.000,00	122.528,53	23,46	24,42	24,71	18.445,00
08-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	MGLU3	6,81	40.800,00	277.848,00	6,63	6,92	7,57	115.495,00
08-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	PETR3	31,25	7.300,00	228.096,18	31,08	31,31	31,93	38.571,00
08-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	PETR3	31,23	38.000,00	1.186.774,44	31,08	31,31	31,93	38.571,00
08-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	PETRA	29,51	7.700,00	227.264,51	29,22	29,57	30,07	91.784,00
08-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	PETRA	29,50	40.200,00	1.185.790,61	29,22	29,57	30,07	91.784,00
08-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	55,48	1.200,00	66.577,82	53,06	55,04	56,05	29.367,00
08-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	SULA11	26,44	2.600,00	68.746,15	25,93	26,47	26,97	16.394,00
08-12-21	FIA RVA EMB IV	Compra	GNDI3	64,69	4.307,00	278.619,67	63,01	64,54	65,39	13.553,00
08-12-21	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	17,39	5.335,00	92.797,82	17,05	17,50	17,78	24.305,00
08-12-21	FIA RVA EMB IV	Venda	UGPA3	15,27	5.995,00	91.566,86	14,78	15,24	15,47	26.943,00
08-12-21	FIM EMB I A	Venda	CBAV3	12,70	1.063,00	13.502,31	12,53	12,71	13,02	6.548,00
08-12-21	FIM EMB I A	Compra	RENT3	54,43	1.000,00	54.428,99	53,06	55,04	56,05	29.367,00
09-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	CESP6	23,18	300,00	6.952,88	22,95	23,14	23,42	7.864,00
09-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	CESP6	23,18	600,00	13.906,67	22,95	23,14	23,42	7.864,00
09-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	CESP6	23,11	1.000,00	23.108,69	22,95	23,14	23,42	7.864,00
09-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	CPFE3	27,14	600,00	16.282,28	27,02	27,21	27,57	8.523,00
09-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	CPFE3	27,21	200,00	5.441,86	27,02	27,21	27,57	8.523,00
09-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	CPFE3	27,21	300,00	8.164,45	27,02	27,21	27,57	8.523,00
09-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	ELET6	33,90	200,00	6.779,03	33,55	33,83	34,47	9.287,00
09-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	ELET6	33,87	100,00	3.386,81	33,55	33,83	34,47	9.287,00
09-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	ELET6	33,86	100,00	3.385,94	33,55	33,83	34,47	9.287,00
09-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	11,24	6.100,00	68.536,40	11,04	11,28	11,47	19.004,00
09-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	HYPE3	29,20	4.700,00	137.246,11	28,68	29,10	29,39	12.477,00
09-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	HYPE3	29,28	100,00	2.928,04	28,68	29,10	29,39	12.477,00
09-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	200,63	100,00	20.063,22	197,90	200,67	207,00	778,00
09-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	22,18	4.400,00	97.602,69	21,95	22,20	22,79	43.270,00
09-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	22,15	3.200,00	70.882,47	21,95	22,20	22,79	43.270,00
09-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	LCAM3	24,38	2.000,00	48.761,19	24,01	24,42	24,85	16.651,00
09-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	LCAM3	24,60	1.500,00	36.899,28	24,01	24,42	24,85	16.651,00
09-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	LCAM3	24,37	1.200,00	29.249,89	24,01	24,42	24,85	16.651,00
09-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	6,39	21.000,00	135.398,47	6,21	6,39	6,76	84.006,00
09-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	55,56	1.200,00	66.675,24	54,31	55,33	56,26	29.693,00
09-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	55,33	900,00	49.800,13	54,31	55,33	56,26	29.693,00
09-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	SULA11	26,00	2.600,00	67.608,38	25,78	26,03	26,70	15.100,00
09-12-21	FIM EMB I A	Venda	CBAV3	12,46	600,00	7.475,76	12,32	12,48	12,79	9.043,00
09-12-21	FIM EMB I A	Compra	GGBR4	28,86	2.000,00	57.717,53	28,19	28,81	29,20	19.435,00
10-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	AMER3	28,34	4.800,00	136.036,23	27,95	28,49	29,29	16.230,00
10-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	CESP6	22,88	3.400,00	77.806,58	22,77	22,96	23,39	10.052,00
10-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	CESP6	23,13	1.900,00	43.944,61	22,77	22,96	23,39	10.052,00
10-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	CPFE3	26,48	1.500,00	39.724,80	26,37	26,62	26,94	9.974,00
10-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	CPFE3	26,62	200,00	5.323,68	26,37	26,62	26,94	9.974,00
10-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	CPFE3	26,69	600,00	16.014,08	26,37	26,62	26,94	9.974,00
10-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	ELET6	34,50	500,00	17.250,12	34,08	34,58	34,92	9.792,00
10-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	ELET6	34,36	100,00	3.435,90	34,08	34,58	34,92	9.792,00
10-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	ELET6	34,46	200,00	6.891,54	34,08	34,58	34,92	9.792,00
10-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	11,29	4.800,00	54.210,42	11,20	11,28	11,46	22.927,00
10-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	LCAM3	25,14	1.200,00	30.168,00	24,64	25,41	25,93	19.442,00
10-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	LCAM3	25,46	600,00	15.276,69	24,64	25,41	25,93	19.442,00
10-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	6,12	4.700,00	28.771,87	6,01	6,24	6,51	121.316,00
10-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	MRVE3	12,32	2.200,00	27.109,12	11,83	12,30	12,49	22.634,00
10-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	15,15	100,00	1.515,43	14,52	15,33	15,68	2.665,00
10-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	15,26	1.100,00	16.788,42	14,52	15,33	15,68	2.665,00
10-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	56,90	500,00	28.450,06	55,76	57,20	58,29	30.512,00
10-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	57,39	300,00	17.216,12	55,76	57,20	58,29	30.512,00



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



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
10-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	14,40	4.200,00	60.494,97	14,05	14,38	14,58	10.798,00
10-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	14,38	2.700,00	38.836,71	14,05	14,38	14,58	10.798,00
10-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	SULA11	26,41	2.100,00	55.471,12	26,18	26,45	26,86	11.942,00
10-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	TEND3	18,41	1.500,00	27.611,73	17,94	18,34	18,64	6.157,00
10-12-21	FIM EMB I A	Venda	AMER3	28,50	2.321,00	66.147,24	27,95	28,49	29,29	16.230,00
10-12-21	FIM EMB I A	Venda	BBDC4	20,21	27.500,00	555.775,00	19,98	20,19	20,51	52.230,00
10-12-21	FIM EMB I A	Venda	BKBR3	7,17	29.200,00	209.364,00	7,12	7,22	7,48	5.582,00
10-12-21	FIM EMB I A	Venda	BRIT3	5,27	17.900,00	94.333,00	5,14	5,29	5,44	975,00
10-12-21	FIM EMB I A	Venda	CASH3	3,85	70.900,00	272.965,00	3,41	3,72	3,92	37.415,00
10-12-21	FIM EMB I A	Venda	CBAV3	12,13	4.687,00	56.861,05	11,90	12,13	12,52	7.616,00
10-12-21	FIM EMB I A	Venda	CRFB3	15,55	12.163,00	189.126,46	14,89	15,47	15,64	19.241,00
10-12-21	FIM EMB I A	Venda	CSAN3	22,26	31.598,00	703.363,64	22,12	22,36	22,55	20.111,00
10-12-21	FIM EMB I A	Venda	CURY3	7,08	11.300,00	80.004,00	6,94	7,12	7,22	3.576,00
10-12-21	FIM EMB I A	Venda	ENEV3	14,83	40.600,00	602.098,00	14,83	15,04	15,40	11.402,00
10-12-21	FIM EMB I A	Venda	EQTL3	23,91	29.900,00	714.909,00	23,83	24,00	24,28	23.931,00
10-12-21	FIM EMB I A	Venda	GGBR4	29,59	10.300,00	304.777,00	29,24	29,56	29,89	28.324,00
10-12-21	FIM EMB I A	Venda	HAPV3	11,20	75.200,00	842.240,00	11,20	11,28	11,46	22.927,00
10-12-21	FIM EMB I A	Venda	LAME4	5,25	37.376,00	196.219,44	5,11	5,22	5,37	20.510,00
10-12-21	FIM EMB I A	Venda	LIQO3	10,91	14.545,00	158.676,50	10,74	10,89	11,02	6.660,00
10-12-21	FIM EMB I A	Venda	LREN3	28,40	41.000,00	1.164.400,00	28,14	28,49	29,04	28.665,00
10-12-21	FIM EMB I A	Venda	MGLU3	6,37	27.727,00	176.620,99	6,01	6,24	6,51	121.316,00
10-12-21	FIM EMB I A	Venda	MULT3	20,64	18.200,00	375.648,00	20,47	20,71	20,92	18.938,00
10-12-21	FIM EMB I A	Venda	NTCO3	26,15	23.396,00	611.809,24	26,00	26,29	27,08	23.094,00
10-12-21	FIM EMB I A	Venda	ONCO3	11,16	19.600,00	218.736,00	10,28	10,93	11,16	4.050,00
10-12-21	FIM EMB I A	Venda	PETZ3	19,84	24.800,00	492.032,00	19,48	19,91	20,20	14.372,00
10-12-21	FIM EMB I A	Venda	RADL3	24,01	26.472,00	635.599,20	23,68	23,93	24,15	17.190,00
10-12-21	FIM EMB I A	Venda	RAIZ4	6,16	85.399,00	526.065,76	5,93	6,16	6,30	14.432,00
10-12-21	FIM EMB I A	Venda	RDO3	50,22	6.400,00	321.408,00	48,79	49,70	50,22	7.325,00
10-12-21	FIM EMB I A	Venda	RENT3	56,70	8.800,00	498.960,00	55,76	57,20	58,29	30.512,00
10-12-21	FIM EMB I A	Venda	SMFT3	19,36	12.200,00	236.192,00	19,17	19,39	19,72	3.265,00
10-12-21	FIM EMB I A	Venda	SQIA3	17,59	8.600,00	151.274,00	17,06	17,40	17,83	5.647,00
10-12-21	FIM EMB I A	Venda	SUZB3	58,50	4.000,00	234.000,00	57,80	58,44	59,28	18.351,00
10-12-21	FIM EMB I A	Venda	UGPA3	15,28	16.800,00	256.704,00	15,12	15,33	15,50	12.237,00
10-12-21	FIM EMB I A	Venda	VALE3	75,65	2.600,00	196.690,00	74,84	75,41	76,20	57.809,00
13-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	AMER3	28,04	2.900,00	81.314,71	27,22	28,20	29,20	17.949,00
13-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	CESP6	22,70	400,00	9.078,29	22,53	22,77	23,19	12.575,00
13-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	CESP6	22,85	800,00	18.282,07	22,53	22,77	23,19	12.575,00
13-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	CESP6	22,73	2.600,00	59.085,93	22,53	22,77	23,19	12.575,00
13-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	CPFE3	26,93	300,00	8.077,54	26,37	26,99	27,30	13.425,00
13-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	CPFE3	27,03	800,00	21.622,97	26,37	26,99	27,30	13.425,00
13-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	11,78	5.800,00	68.334,57	11,22	11,67	11,96	34.193,00
13-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	21,67	5.700,00	123.513,11	21,57	21,84	22,42	48.100,00
13-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	22,03	6.900,00	152.014,62	21,57	21,84	22,42	48.100,00
13-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	LCAM3	25,68	1.700,00	43.656,00	25,07	25,51	26,00	17.495,00
13-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	LCAM3	25,46	1.500,00	38.196,21	25,07	25,51	26,00	17.495,00
13-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	IMGLU3	6,28	6.200,00	38.943,24	6,05	6,32	6,72	127.658,00
13-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	MRVE3	12,11	2.100,00	25.425,45	11,99	12,18	12,53	16.917,00
13-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	PETR3	31,34	6.300,00	197.435,90	31,04	31,44	31,92	42.647,00
13-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	58,06	800,00	46.448,00	55,98	57,62	58,70	31.477,00
13-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	57,64	3.300,00	190.215,28	55,98	57,62	58,70	31.477,00
13-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	14,40	800,00	11.520,00	13,86	14,12	14,52	14.630,00
13-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	14,36	200,00	2.872,88	13,86	14,11	14,52	14.630,00
13-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	TEND3	17,70	1.400,00	24.786,79	17,36	17,77	18,56	4.609,00
13-12-21	FIA RVA EMB IV	Compra	GNDI3	66,65	2.825,00	188.295,56	63,59	66,22	67,61	21.242,00
13-12-21	FIA RVA EMB IV	Venda	UGPA3	15,52	12.049,00	186.963,86	15,10	15,56	15,75	34.954,00
14-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	CESP6	21,72	2.600,00	56.468,44	21,58	21,99	22,89	13.691,00
14-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	CESP6	21,75	3.000,00	65.238,53	21,58	21,99	22,89	13.691,00
14-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	CESP6	21,83	4.300,00	93.877,90	21,58	21,99	22,89	13.691,00
14-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	CESP6	21,75	1.500,00	32.629,37	21,58	21,99	22,89	13.691,00
14-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	CESP6	22,75	3.000,00	68.250,00	21,58	21,99	22,89	13.691,00
14-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	34,18	1.000,00	34.176,01	33,47	34,50	36,59	39.686,00
14-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	34,04	1.800,00	61.277,40	33,47	34,50	36,59	39.686,00
14-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	34,12	1.600,00	54.584,88	33,47	34,50	36,59	39.686,00
14-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	33,90	1.000,00	33.898,37	33,47	34,50	36,59	39.686,00
14-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	11,33	3.600,00	40.797,03	11,17	11,38	11,79	17.116,00
14-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	198,57	100,00	19.856,94	193,93	198,63	206,68	1.593,00
14-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	PETR3	31,21	2.400,00	74.901,51	30,93	31,24	31,80	30.647,00
14-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	18,52	3.700,00	68.530,30	18,30	18,53	18,78	25.328,00
14-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	57,64	1.700,00	97.983,71	57,16	57,62	58,48	24.727,00
14-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	SULA11	25,93	1.800,00	46.668,73	25,64	25,93	26,80	11.331,00
14-12-21	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	6,12	1.923,00	11.777,45	6,02	6,12	6,22	8.855,00
14-12-21	FIM EMB I A	Compra	GGBR4	29,25	1.500,00	43.876,17	29,00	29,41	30,28	25.244,00
15-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	AMER3	28,13	1.900,00	53.445,53	25,78	27,16	28,92	39.607,00
15-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	14,59	1.100,00	16.044,00	14,37	14,57	14,71	20.134,00
15-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	B3SA3	12,02	5.700,00	68.529,73	11,88	11,98	12,24	82.698,00
15-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	BBDC4	20,13	1.200,00	24.150,46	19,80	20,04	20,40	54.484,00
15-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	21,04	700,00	14.730,00	20,70	21,04	21,24	22.332,00
15-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	22,37	2.200,00	49.203,00	21,27	22,05	22,64	27.427,00
15-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	BRAP4	54,50	200,00	10.899,00	53,90	54,42	55,38	31.968,00
15-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	CESP6	21,43	1.700,00	36.431,25	20,65	21,22	21,80	13.630,00
15-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	CESP6	20,80	3.400,00	70.720,00	20,65	21,22	21,80	13.630,00
15-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	CPFE3	27,57	700,00	19.299,66	27,01	27,53	27,78	17.247,00
15-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	CRFB3	15,58	2.900,00	45.189,85	15,28	15,52	15,68	17.285,00
15-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	CYRE3	15,55	2.100,00	32.647,72	15,04	15,37	15,69	23.138,00
15-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	30,84	2.000,00	61.686,70	29,90	32,13	34,54	81.019,00
15-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	34,28	600,00	20.568,00	29,90	32,13	34,54	81.019,00
15-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	ELET6	30,64	1.000,00	30.641,88	29,96	31,97	34,33	50.486,00
15-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	23,78	4.700,00	111.764,07	23,61	23,84	24,07	18.406,00
15-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	GNDI3	63,69	300,00	19.106,00	62,33	63,81	64,71	14.877,00
15-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	GOAU4	11,98	1.900,00	22.754,86	11,70	11,94	12,21	20.982,00



RELATÓRIO DE CONTROLE DE RISCO
E RENTABILIDADE - DEZEMBRO DE 2021



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



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
15-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	11,28	3.200,00	36.107,66	10,99	11,25	11,48	16.422,00
15-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	HYPE3	29,31	2.600,00	76.194,35	29,00	29,28	29,47	13.975,00
15-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	IGT11	194,80	100,00	19.479,76	192,00	194,14	197,73	1.427,00
15-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	9,65	10.500,00	101.346,94	9,52	9,64	9,74	37.634,00
15-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	21,71	1.000,00	21.714,55	21,38	21,65	21,97	56.135,00
15-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	LCAM3	26,13	600,00	15.677,00	25,39	26,61	27,40	38.517,00
15-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	LCAM3	26,61	1.200,00	31.934,09	25,39	26,61	27,40	38.517,00
15-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	26,87	1.900,00	51.061,61	25,97	26,54	27,13	41.796,00
15-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	MRVE3	11,59	2.600,00	30.144,41	11,43	11,67	11,88	19.689,00
15-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	25,75	4.300,00	110.713,06	25,11	25,73	26,05	26.220,00
15-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	OMGE3	25,83	1.400,00	36.162,82	24,75	24,99	26,25	8.662,00
15-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	PAR3	20,22	2.900,00	18.201,00	20,07	20,50	21,00	2.312,00
15-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	PETR3	30,86	2.800,00	86.401,44	30,45	30,82	31,09	29.516,00
15-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	PETRA	29,10	600,00	17.462,22	28,59	28,98	29,30	86.504,00
15-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	POWE3	10,92	700,00	7.644,00	10,51	10,77	11,40	4.462,00
15-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	18,68	4.200,00	78.472,66	18,57	18,78	19,13	36.530,00
15-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	18,66	2.300,00	42.922,62	18,57	18,78	19,13	36.530,00
15-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	15,69	2.200,00	34.513,53	15,12	15,55	16,00	2.792,00
15-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	59,07	4.600,00	271.708,22	57,01	59,33	61,18	77.621,00
15-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	59,12	1.600,00	94.598,86	57,01	59,33	61,18	77.621,00
15-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	SEER3	10,85	1.400,00	15.193,00	10,32	10,65	10,94	3.602,00
15-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	13,05	6.100,00	79.592,39	12,75	13,01	13,29	14.155,00
15-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	SULA11	26,22	1.100,00	28.838,06	25,66	26,08	26,43	15.397,00
15-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	58,59	1.200,00	70.309,25	57,80	58,53	59,10	19.977,00
15-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	SYNE3	15,91	8.700,00	138.405,97	15,51	15,92	16,35	35.901,00
15-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	SYNE3	15,93	700,00	11.152,00	15,51	15,92	16,35	35.901,00
15-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	USIM5	15,34	1.700,00	26.074,42	14,97	15,24	15,54	23.343,00
15-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	VALE3	77,20	200,00	15.440,66	76,20	77,12	78,18	74.844,00
15-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	22,26	7.000,00	155.852,60	22,03	22,30	22,74	23.633,00
15-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	23,33	400,00	9.330,00	22,70	23,19	23,58	12.266,00
15-12-21	FIA RVA EMB IV	Venda	UGPA3	14,95	11.879,00	177.587,41	14,85	15,06	15,35	20.632,00
15-12-21	FIM EMB I A	Venda	GGBR4	29,21	1.500,00	43.815,00	28,27	28,84	29,59	31.145,00
15-12-21	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	AIEC11	70,07	14.727,00	1.031.947,80	69,20	70,25	72,39	661,00
16-12-21	FIA RVA EMB II	Venda	B3SA3	12,09	174.000,00	2.104.247,92	11,99	12,18	12,54	71.364,00
16-12-21	FIA RVA EMB II	Venda	CMIG4	13,95	100.000,00	1.395.000,00	13,71	14,01	14,21	16.922,00
16-12-21	FIA RVA EMB II	Venda	ENAT3	14,60	64.200,00	937.242,00	14,47	14,66	14,94	7.159,00
16-12-21	FIA RVA EMB II	Compra	MGLU3	6,40	153.100,00	979.840,00	6,13	6,30	6,51	82.164,00
16-12-21	FIA RVA EMB II	Compra	VALE3	80,18	42.200,00	3.383.469,48	78,46	79,69	80,46	93.074,00
16-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	AMER3	31,62	800,00	25.292,16	28,61	30,93	31,93	44.440,00
16-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	AMER3	31,84	1.300,00	41.392,00	28,61	30,93	31,93	44.440,00
16-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	AMER3	31,45	3.300,00	103.785,34	28,61	30,93	31,93	44.440,00
16-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	BIDI11	32,26	2.500,00	80.657,08	31,90	32,93	36,15	33.387,00
16-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	CESP6	21,33	1.900,00	40.524,62	21,10	21,31	21,84	12.337,00
16-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	CESP6	21,20	600,00	12.719,71	21,10	21,31	21,84	12.337,00
16-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	CESP6	21,41	1.900,00	40.686,52	21,10	21,31	21,84	12.337,00
16-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	CESP6	21,22	1.300,00	27.581,66	21,10	21,31	21,84	12.337,00
16-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	CESP6	21,21	1.500,00	31.821,26	21,10	21,31	21,84	12.337,00
16-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	GNDI3	70,56	1.500,00	105.834,74	65,24	67,76	71,96	43.735,00
16-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	12,15	15.100,00	183.433,82	11,48	11,82	12,70	57.309,00
16-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	9,69	24.000,00	232.630,81	9,63	9,69	9,76	28.212,00
16-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	21,79	10.500,00	228.747,21	21,57	21,96	22,50	39.814,00
16-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	PETR3	31,69	600,00	19.011,88	31,12	31,59	32,04	30.107,00
16-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	PETR3	31,67	1.400,00	44.332,32	31,12	31,59	32,04	30.107,00
16-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	POWE3	10,59	200,00	2.118,00	10,31	10,50	10,88	3.158,00
16-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	POWE3	10,59	1.300,00	13.767,00	10,31	10,50	10,88	3.158,00
16-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	19,93	2.100,00	41.845,41	19,35	19,98	20,58	36.862,00
16-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	15,91	1.000,00	15.905,15	15,61	15,99	16,23	4.156,00
16-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	16,00	400,00	6.399,92	15,61	15,99	16,23	4.156,00
16-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	SEER3	10,66	200,00	2.132,38	10,61	10,75	11,16	3.100,00
16-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	SYNE3	16,47	7.000,00	115.286,17	16,05	16,40	16,66	27.542,00
16-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	23,58	100,00	2.357,50	23,31	23,69	24,50	11.598,00
16-12-21	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	6,08	2.892,00	17.588,59	6,04	6,11	6,11	10.374,00
17-12-21	FIA RVA EMB II	Compra	AMER3	31,24	66.500,00	2.077.677,56	29,91	31,00	32,06	28.473,00
17-12-21	FIA RVA EMB II	Venda	LREN3	26,38	52.800,00	1.392.938,35	25,41	26,22	26,71	32.231,00
17-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	AMER3	31,37	2.300,00	72.139,73	29,91	31,00	32,06	28.473,00
17-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	BIDI11	30,49	2.700,00	82.333,64	29,70	30,66	31,95	36.449,00
17-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	CESP6	21,49	900,00	19.342,24	21,05	21,52	21,78	12.581,00
17-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	CESP6	21,56	1.500,00	32.338,52	21,05	21,52	21,78	12.581,00
17-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	CESP6	21,43	5.500,00	117.857,87	21,05	21,52	21,78	12.581,00
17-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	CESP6	21,70	900,00	19.527,72	21,05	21,52	21,78	12.581,00
17-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	11,39	2.400,00	27.341,23	11,07	11,36	11,48	23.886,00
17-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	9,56	32.900,00	314.565,45	9,52	9,56	9,68	30.398,00
17-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	21,49	15.400,00	330.911,85	21,32	21,48	21,85	43.219,00
17-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	27,96	3.100,00	86.676,00	25,90	27,52	28,86	34.608,00
17-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	OMGE3	27,58	1.000,00	27.580,00	25,87	27,13	27,66	9.524,00
17-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	OMGE3	27,35	2.600,00	71.114,98	25,87	27,13	27,66	9.524,00
17-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	PETR3	30,96	2.700,00	83.583,08	30,57	30,92	31,49	24.307,00
17-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	20,07	2.100,00	42.152,41	19,33	20,10	20,47	33.329,00
17-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	16,33	900,00	14.698,24	15,45	16,04	16,59	4.889,00
17-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	57,33	900,00	51.600,60	55,70	57,29	59,26	52.523,00
17-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	57,57	500,00	28.784,17	55,70	57,29	59,26	52.523,00
17-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	SEER3	10,44	1.400,00	14.620,20	10,20	10,41	10,58	4.512,00
17-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	12,70	200,00	2.540,81	12,48	12,94	13,45	19.713,00
17-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	12,94	1.500,00	19.408,86	12,48	12,94	13,45	19.713,00
17-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	60,98	2.800,00	170.741,85	60,32	61,23	61,95	38.791,00
17-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	SYNE3	16,64	14.200,00	236.285,43	16,11	16,61	16,90	26.089,00
17-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	22,16	2.500,00	55.391,07	22,00	22,12	22,37	30.553,00
17-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	21,69	3.000,00	65.070,00	21,69	22,03	22,91	12.535,00
17-12-21	FIA RVA EMB IV	Venda	BIDI11	30,66	5.984,00	183.473,72	29,70	30,66	31,95	36.449,00
17-12-21	FIA RVA EMB IV	Venda	ELET3	32,90	4.934,00	162.334,83	32,58	33,30	33,82	20.540,00



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



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
17-12-21	FIA RVA EMB IV	Venda	ELET6	32,58	759,00	24.726,04	32,15	32,99	33,40	15.160,00
17-12-21	FIA RVA EMB IV	Venda	UGPA3	15,05	12.168,00	183.137,83	14,95	15,13	15,32	18.276,00
20-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	ALSO3	21,14	2.300,00	48.631,79	20,90	21,11	21,68	5.790,00
20-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	BRML3	8,01	30.000,00	240.420,76	7,80	8,02	8,34	30.043,00
20-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	CESP6	21,13	1.700,00	35.926,06	21,03	21,15	21,60	4.524,00
20-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	9,40	20.800,00	195.586,67	9,34	9,43	9,54	32.853,00
20-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	9,46	24.100,00	227.986,00	9,34	9,43	9,54	32.853,00
20-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	21,06	9.000,00	189.568,19	20,91	21,10	21,49	40.664,00
20-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	21,19	10.400,00	220.376,00	20,91	21,10	21,49	40.664,00
20-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	27,32	1.000,00	27.316,96	26,92	27,35	28,08	31.227,00
20-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	OMGE3	27,66	1.400,00	38.725,03	27,00	27,47	28,00	6.242,00
20-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	PETR3	30,07	3.200,00	96.224,87	29,44	29,98	30,40	37.128,00
20-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	PRIO3	19,01	3.600,00	68.425,24	18,75	19,07	19,55	31.973,00
20-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	55,29	1.500,00	82.929,53	54,00	55,25	56,39	39.648,00
20-12-21	FIA RVA EMB IV	Venda	BIDI11	29,08	2.722,00	79.169,07	28,75	29,43	30,85	24.800,00
20-12-21	FIA RVA EMB IV	Venda	BIDI4	9,83	124,00	1.218,93	9,73	9,96	10,36	16.424,00
21-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	ALSO3	20,91	11.500,00	240.407,99	20,50	20,88	21,15	7.001,00
21-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	BDOC4	19,28	2.800,00	53.988,41	19,06	19,25	19,54	40.346,00
21-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	BIDI11	28,09	400,00	11.236,00	27,76	28,10	29,75	26.460,00
21-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	BIDI11	28,09	10.700,00	300.539,54	27,76	28,10	29,75	26.460,00
21-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	BRML3	7,71	30.700,00	236.580,38	7,64	7,71	7,92	22.327,00
21-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	CESP6	21,10	2.000,00	42.208,96	20,91	21,13	21,33	5.421,00
21-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	CESP6	20,97	100,00	2.097,00	20,91	21,13	21,33	5.421,00
21-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	8,92	7.500,00	66.920,39	8,89	8,95	9,10	28.405,00
21-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	9,02	14.700,00	132.594,00	8,89	8,95	9,10	28.405,00
21-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	21,17	5.500,00	116.435,50	21,03	21,17	21,31	37.257,00
21-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	21,16	6.500,00	137.540,00	21,03	21,17	21,31	37.257,00
21-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	LEN3	24,76	1.500,00	37.137,14	24,55	24,78	25,67	32.149,00
21-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	LEN3	24,70	1.200,00	29.640,00	24,55	24,78	25,67	32.149,00
21-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	OMGE3	28,09	1.500,00	42.135,24	27,67	28,09	28,24	6.542,00
21-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	OMGE3	27,93	100,00	2.793,08	27,67	28,09	28,24	6.542,00
21-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	PETR3	30,55	3.700,00	113.041,03	30,28	30,53	30,83	19.470,00
21-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	PRIO3	19,51	5.500,00	107.303,34	19,08	19,59	20,90	25.930,00
21-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	12,37	700,00	8.662,11	12,06	12,43	12,75	13.649,00
21-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	12,20	4.700,00	57.337,32	12,06	12,43	12,75	13.649,00
21-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	21,31	2.500,00	53.271,29	21,12	21,33	21,69	10.394,00
21-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	ALSO3	20,83	7.000,00	145.837,71	20,51	20,81	21,13	5.986,00
22-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	BIDI11	28,77	2.100,00	60.427,22	27,80	28,74	29,54	30.322,00
22-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	BRML3	7,74	30.800,00	238.333,44	7,60	7,73	7,87	18.275,00
22-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	CESP6	21,21	1.300,00	27.575,51	20,91	21,21	21,38	4.715,00
22-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	11,14	3.600,00	40.111,10	10,99	11,10	11,55	22.188,00
22-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	HBSA3	3,29	3.700,00	12.180,83	3,16	3,27	3,37	5.059,00
22-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	8,95	6.800,00	60.865,96	8,85	8,92	8,98	21.591,00
22-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	21,22	2.300,00	48.812,31	20,97	21,15	21,31	30.388,00
22-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	LEN3	24,27	1.900,00	46.120,49	23,85	24,36	24,74	34.362,00
22-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	OMGE3	27,63	700,00	19.342,72	27,15	27,77	28,24	4.501,00
22-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	PRIO3	19,89	800,00	15.915,37	19,56	19,89	20,27	25.767,00
22-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	SULA11	25,90	1.500,00	38.850,00	25,40	25,81	26,00	13.034,00
22-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	SULA11	25,79	4.800,00	123.776,07	25,40	25,81	26,00	13.034,00
22-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	VALE3	79,84	100,00	7.983,74	78,58	79,60	80,15	51.684,00
22-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	21,21	1.400,00	29.694,26	21,04	21,21	21,40	11.335,00
22-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	20,78	500,00	10.389,14	20,38	20,65	21,16	8.692,00
22-12-21	FIA RVA EMB IV	Venda	BIDI11	28,74	2.750,00	79.043,94	27,80	28,74	29,54	30.322,00
22-12-21	FIA RVA EMB IV	Venda	BIDI4	9,53	107,00	1.019,40	9,41	9,62	9,89	17.575,00
22-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	GMAT3	5,98	14.844,00	88.767,12	5,90	5,97	6,05	9.485,00
23-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	ANIM3	8,19	1.200,00	9.829,54	8,11	8,20	8,36	4.648,00
23-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	BRML3	7,76	27.700,00	214.879,04	7,68	7,75	7,84	27.827,00
23-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	CESP6	21,04	1.000,00	21.038,00	20,87	21,02	21,28	3.135,00
23-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	CESP6	20,96	600,00	12.574,55	20,87	21,02	21,28	3.135,00
23-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	CPFE3	26,78	500,00	13.387,96	26,71	26,82	27,14	3.244,00
23-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	22,62	500,00	11.310,09	22,48	22,63	22,88	8.400,00
23-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	22,69	800,00	18.152,00	22,48	22,63	22,88	8.400,00
23-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	22,62	1.100,00	24.882,39	22,48	22,63	22,88	8.400,00
23-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	OMGE3	27,65	800,00	22.121,31	27,34	27,60	28,19	4.869,00
23-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	OMGE3	27,48	400,00	10.990,40	27,34	27,60	28,19	4.869,00
23-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	54,56	1.700,00	92.755,48	53,41	54,41	55,86	17.809,00
23-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	20,41	500,00	10.206,28	20,25	20,41	20,75	7.854,00
27-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	20,62	200,00	4.123,24	20,37	20,62	21,32	5.943,00
27-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	AMER3	31,96	2.500,00	79.896,15	30,66	31,96	32,55	15.757,00
27-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	ANIM3	8,27	1.700,00	14.053,89	8,17	8,28	8,42	3.872,00
27-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	ANIM3	8,27	1.000,00	8.266,02	8,17	8,28	8,42	3.872,00
27-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	BRAP4	24,50	5.000,00	122.489,66	23,95	24,43	24,65	22.223,00
27-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	BRML3	7,89	200,00	1.577,93	7,75	7,93	8,24	26.771,00
27-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	CESP6	21,14	600,00	12.686,95	20,70	21,02	21,26	5.428,00
27-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	CESP6	21,13	400,00	8.451,63	20,70	21,02	21,26	5.428,00
27-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	CPFE3	26,85	200,00	5.369,10	26,67	26,84	27,04	5.264,00
27-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	CPFE3	26,85	500,00	13.426,64	26,67	26,84	27,04	5.264,00
27-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	22,66	1.500,00	33.990,00	22,37	22,70	22,85	12.410,00
27-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	22,59	400,00	9.036,78	22,37	22,70	22,85	12.410,00
27-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	22,59	600,00	13.555,50	22,37	22,70	22,85	12.410,00
27-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	MEGA3	11,90	700,00	8.330,42	11,49	11,87	13,26	1.956,00
27-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	PETR3	31,12	8.600,00	267.626,54	30,24	30,98	31,23	23.181,00
27-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	PETR3	31,14	2.500,00	77.859,96	30,24	30,98	31,23	23.181,00
27-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	PETRA	28,68	9.300,00	266.720,86	28,15	28,60	28,78	46.060,00
27-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	PETRA	28,63	2.800,00	80.154,01	28,15	28,60	28,78	46.060,00
27-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	VALE3	79,17	1.500,00	118.747,74	78,26	78,96	81.718,00	41.718,00
27-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	20,20	700,00	14.142,95	20,05	20,25	20,82	8.156,00
27-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	20,26	400,00	8.102,01	20,05	20,25	20,82	8.156,00
27-12-21	FIA RVA EMB IV	Compra	VITT3	13,70	1.241,00	17.001,70	13,26	13,62	13,90	94,00
28-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	21,01	300,00	6.302,50	20,55	21,02	21,27	5.332,00



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



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
28-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	ANIM3	8,22	500,00	4.110,96	8,08	8,17	8,43	3.131,00
28-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	13,08	300,00	3.923,76	12,89	13,10	13,73	26.513,00
28-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	13,07	20.000,00	261.414,48	12,89	13,10	13,73	26.513,00
28-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	BRML3	8,11	500,00	4.053,33	7,86	8,10	8,26	28.126,00
28-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	BRML3	8,08	8.200,00	66.219,15	7,86	8,10	8,26	28.126,00
28-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	CESP6	21,31	1.100,00	23.445,76	21,04	21,28	21,47	4.323,00
28-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	CRFB3	15,22	1.800,00	27.404,89	15,07	15,25	15,52	14.380,00
28-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	CRFB3	15,38	11.600,00	178.379,00	15,07	15,25	15,52	14.380,00
28-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	CRFB3	15,24	4.000,00	60.972,45	15,07	15,25	15,52	14.380,00
28-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	LREN3	24,31	3.800,00	92.377,93	24,17	24,40	24,85	21.680,00
28-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	MEGA3	12,11	1.800,00	21.791,61	11,28	11,63	12,78	4.559,00
28-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	MEGA3	12,25	2.200,00	26.950,35	11,28	11,63	12,78	4.559,00
28-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	25,00	100,00	2.500,00	24,94	25,20	25,44	16.623,00
28-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	20,18	200,00	4.035,92	20,01	20,52	20,89	7.610,00
29-12-21	FIA RVA EMB II	Venda	ENAT3	13,25	83.800,00	1.110.692,00	13,14	13,26	13,49	3.649,00
29-12-21	FIA RVA EMB II	Compra	VALE3	77,43	13.400,00	1.037.593,00	76,35	77,34	77,98	45.876,00
29-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	21,61	1.000,00	21.610,57	21,37	21,83	22,41	13.109,00
29-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	ANIM3	8,10	3.400,00	27.550,94	8,00	8,10	8,37	12.477,00
29-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	BRAP4	24,49	2.865,00	70.166,64	24,21	24,48	24,66	14.735,00
29-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	BRML3	8,19	7.700,00	63.067,54	8,09	8,28	8,57	48.628,00
29-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	CESP6	21,16	1.100,00	23.279,74	20,99	21,15	21,54	6.116,00
29-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	10,10	9.200,00	92.928,17	9,97	10,10	10,36	23.073,00
29-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	MEGA3	12,24	200,00	2.447,54	11,93	12,30	12,70	5.925,00
29-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	SULA11	25,77	3.600,00	92.779,34	25,60	25,84	26,35	9.969,00
29-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	VALE3	77,39	900,00	69.649,51	76,35	77,34	77,98	45.876,00
29-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	20,49	1.400,00	28.690,18	20,26	20,61	21,18	6.844,00
29-12-21	FIA RVA EMB IV	Venda	BRML3	8,26	53.645,00	443.065,18	8,09	8,28	8,57	48.628,00
30-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	21,61	500,00	10.804,47	21,19	21,62	21,85	6.807,00
30-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	AMER3	31,98	1.600,00	51.170,40	31,02	31,71	32,78	18.592,00
30-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	BRML3	8,33	9.800,00	81.655,51	8,11	8,31	8,46	27.058,00
30-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	BRML3	8,32	1.300,00	10.814,33	8,11	8,31	8,46	27.058,00
30-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	BRPR3	7,28	2.400,00	17.469,26	7,15	7,28	7,32	3.001,00
30-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	BRPR3	7,30	3.400,00	24.820,00	7,15	7,28	7,32	3.001,00
30-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	CESP6	21,45	2.400,00	51.482,37	20,96	21,43	21,64	11.863,00
30-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	CSED3	7,85	1.900,00	14.923,97	7,49	7,77	8,02	7.101,00
30-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	10,30	10.500,00	108.181,45	10,06	10,30	10,39	19.261,00
30-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	8,93	36.900,00	329.676,00	8,90	8,94	9,06	28.143,00
30-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	21,03	23.700,00	498.516,07	20,95	21,05	21,44	49.843,00
30-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	MEGA3	12,70	2.700,00	34.279,39	12,07	12,67	12,84	9.342,00
30-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	7,29	5.100,00	37.173,58	6,77	7,21	7,41	83.336,00
30-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	7,36	3.600,00	26.496,00	6,77	7,21	7,41	83.336,00
30-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	PETR3	30,78	8.900,00	273.975,44	30,55	30,71	31,13	22.886,00
30-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	PETRA	28,54	9.700,00	276.791,16	28,39	28,51	28,70	53.532,00
30-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	18,57	3.200,00	59.414,57	17,38	18,46	18,70	7.212,00
30-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	52,19	700,00	36.533,35	51,61	52,47	53,13	47.696,00
30-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	SEER3	10,60	800,00	8.479,69	10,36	10,58	10,84	2.464,00
30-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	SULA11	27,22	4.900,00	133.371,70	25,75	27,17	27,40	19.724,00
30-12-21	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	59,72	3.500,00	209.031,56	59,03	59,84	60,40	20.633,00
30-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	TEND3	16,89	800,00	13.515,73	16,40	16,75	17,05	5.089,00
30-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	21,39	3.000,00	64.183,76	20,76	21,25	21,75	20.121,00
30-12-21	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	20,57	500,00	10.284,96	20,17	20,55	20,80	8.525,00
30-12-21	FIA RVA EMB IV	Venda	BRML3	8,38	593,00	4.969,34	8,11	8,31	8,46	27.058,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ABEV3	15,42	3.046,00	46.970,60	15,39	15,44	15,59	18.882,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ALPA4	37,02	100,00	3.701,83	36,21	37,00	37,38	10.970,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	AMER3	31,58	7.970,00	251.693,56	31,02	31,71	32,78	18.592,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ASAI3	12,96	538,00	6.972,00	12,82	12,97	13,08	11.670,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	AZUL4	24,36	201,00	4.895,82	23,90	24,28	24,57	12.020,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	B3SA3	11,14	4.871,00	54.264,34	11,05	11,15	11,29	23.851,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BBAS3	28,85	915,00	26.396,05	28,77	28,92	29,19	25.910,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BBDC3	16,19	1.009,00	16.335,84	16,06	16,20	16,37	7.358,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BBDC4	19,21	3.433,00	65.949,82	18,98	19,17	19,40	53.281,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BBSE3	20,76	337,00	6.996,89	20,58	20,79	21,05	11.043,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BEEF3	10,60	406,00	4.303,65	10,53	10,62	10,74	11.745,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BIDI11	28,57	4.565,00	130.424,12	27,50	28,48	29,28	22.982,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BIDI4	9,54	9.637,00	91.936,62	9,17	9,50	9,74	18.034,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BPAC11	21,00	1.028,00	21.590,52	20,68	20,94	21,05	15.804,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BPAN4	10,67	227,00	2.420,96	10,57	10,84	11,16	8.698,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BRAP4	24,95	136,00	3.393,18	24,44	24,94	25,09	17.929,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BRFS3	22,52	655,00	14.752,00	22,22	22,50	22,79	11.197,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BRKM5	57,63	145,00	8.356,32	57,20	57,82	58,95	11.683,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BRML3	8,31	1.076,00	8.942,68	8,11	8,31	8,46	27.058,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CASH3	3,24	377,00	1.221,48	3,01	3,21	3,32	23.890,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CCRO3	11,60	809,00	9.381,25	11,44	11,58	11,69	15.975,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CIEL3	2,28	825,00	1.881,00	2,15	2,25	2,32	12.146,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CMIG4	13,11	825,00	10.814,95	12,95	13,09	13,18	16.987,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CMIN3	6,74	56.682,00	382.035,60	6,58	6,75	6,97	38.603,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	COGN3	2,46	1.798,00	4.422,88	2,37	2,44	2,50	9.155,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CPFE3	26,95	189,00	5.094,32	26,24	26,64	26,83	7.656,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CPL66	6,44	1.145,00	7.373,94	6,35	6,41	6,47	11.292,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CRFB3	15,26	344,00	5.248,34	14,89	15,13	15,30	7.887,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CSAN3	21,69	986,00	21.385,53	21,48	21,66	21,84	14.721,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CSNA3	24,99	483,00	12.070,12	24,90	25,14	25,47	17.199,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CVCB3	13,42	141,00	1.891,86	13,08	13,36	13,53	12.906,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CYRE3	15,78	277,00	4.370,64	15,40	15,74	15,96	19.286,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	DXCO3	14,96	426,00	6.370,86	14,76	14,97	15,11	7.899,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ECOR3	7,31	232,00	1.695,60	7,20	7,30	7,39	13.004,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	EGIE3	38,42	278,00	10.680,59	38,41	38,54	38,96	5.147,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ELET3	33,44	244,00	8.159,72	32,96	33,45	33,83	14.665,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ELET6	33,06	164,00	5.421,04	32,47	33,01	33,38	8.233,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ENBR3	20,95	262,00	5.487,96	20,51	20,80	20,98	11.634,00



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL
Mês de Referência: 01 DE DEZEMBRO DE 2021 A 31 DE DEZEMBRO DE 2021



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ENEV3	14,15	634,00	8.972,18	14,06	14,17	14,35	15.015,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ENGI11	44,34	171,00	7.581,94	43,63	44,10	44,38	8.301,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	EQTL3	22,61	808,00	18.269,28	22,35	22,57	22,66	10.197,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	EZTC3	20,29	76,00	1.542,20	19,94	20,41	20,62	6.754,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	FLRY3	17,99	135,00	2.427,99	17,58	17,96	18,15	7.997,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	GETT11	3,85	4.630,00	17.825,25	3,66	3,81	3,85	7.449,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	GGBR4	27,26	737,00	20.090,58	27,17	27,36	27,71	15.757,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	GNDI3	60,35	341,00	20.579,41	57,98	59,92	60,39	9.696,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	GOAU4	11,38	426,00	4.849,50	11,27	11,48	11,27	10.658,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	GOLL4	17,03	93,00	1.583,37	16,82	17,07	17,32	11.891,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	HAPV3	10,38	1.049,00	10.887,82	10,06	10,30	10,39	19.261,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	HYPE3	28,27	518,00	14.645,84	27,90	28,22	28,41	6.429,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	IGT11	18,07	1.934,00	34.950,90	17,82	18,13	18,48	8.082,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	IRBR3	4,02	870,00	3.497,40	3,95	4,01	4,04	8.818,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ITSA4	8,93	3.579,00	31.960,55	8,90	8,94	9,06	28.143,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ITUB4	20,95	3.498,00	73.283,46	20,95	21,05	21,44	49.843,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	JBSS3	37,95	3.868,00	146.787,40	37,73	37,97	38,25	24.891,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	JHSF3	5,58	142,00	792,36	5,46	5,54	5,58	11.335,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	KLBN11	25,66	635,00	16.292,35	25,63	25,76	26,07	13.612,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	LAME4	5,89	750,00	4.417,48	5,86	6,00	6,18	16.308,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	LCAM3	23,58	257,00	6.060,79	23,04	23,48	23,72	15.620,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	LEN3	24,44	754,00	18.427,76	23,91	24,39	24,76	24.891,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	LWSA3	13,16	319,00	4.197,95	12,59	13,14	13,43	16.131,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	MGLU3	7,22	1.474,00	10.642,38	6,77	7,21	7,41	83.336,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	MRF63	22,07	386,00	8.520,54	22,07	22,29	23,10	21.944,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	MRFV3	12,00	294,00	3.528,00	11,66	11,97	12,15	16.815,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	MULT3	18,71	233,00	4.359,24	18,29	18,59	18,82	13.800,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	NTCO3	25,43	804,00	20.444,52	24,52	25,29	25,67	18.302,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	PCAR3	21,73	148,00	3.215,59	21,33	21,66	22,05	9.140,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	PETR3	30,70	39.153,00	1.202.011,29	30,55	30,71	31,13	22.886,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	PETRA	28,45	3.446,00	98.036,95	28,39	28,51	28,70	53.532,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PETZ3	16,37	747,00	12.228,91	16,20	16,41	16,70	15.924,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	POSI3	10,90	3.950,00	43.055,42	10,90	11,07	11,42	11.738,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	PRI03	20,68	653,00	13.501,42	19,96	20,51	20,85	21.362,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	QUAL3	16,90	608,00	10.276,70	16,00	16,69	16,93	10.558,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	RADL3	24,31	723,00	17.576,03	23,78	24,21	24,32	17.413,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	RAIL3	17,76	887,00	15.752,36	17,44	17,70	17,82	26.259,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RDOR3	44,83	11.960,00	536.167,38	44,50	44,93	45,80	11.048,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	RENT3	52,99	336,00	17.805,91	51,61	52,47	53,13	47.696,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RRRP3	33,55	10.094,00	338.653,34	33,11	33,62	34,30	19.632,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	SANB11	29,98	268,00	8.035,52	29,84	30,04	30,75	8.977,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	SBSB3	40,19	207,00	8.318,31	39,61	40,07	40,34	8.669,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SOMA3	12,73	3.255,00	41.433,63	12,34	12,68	12,80	12.410,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	SULA11	27,49	241,00	6.624,73	25,75	27,17	27,70	19.724,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	SUZB3	60,14	620,00	37.284,85	59,03	59,84	60,40	20.633,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	TAEE11	36,37	214,00	7.784,22	36,19	36,34	36,44	7.681,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	TIMS3	13,14	664,00	8.727,80	12,80	13,05	13,15	7.147,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	TOTS3	28,65	455,00	13.037,86	27,58	28,29	28,92	19.193,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	UGPA3	14,55	766,00	11.146,63	14,38	14,62	14,86	16.773,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	USIM5	15,16	422,00	6.396,38	14,88	15,15	15,30	23.589,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VALE3	77,96	16.536,00	1.289.150,88	77,61	78,25	78,98	56.646,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	VBBR3	21,41	2.500,00	53.515,60	20,76	21,25	21,75	20.121,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	VIIA3	5,25	1.153,00	6.052,65	5,02	5,21	5,32	45.154,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	VIVT3	48,19	776,00	37.394,64	48,04	48,30	48,99	7.409,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	WEGE3	32,99	1.049,00	34.603,58	32,73	33,05	33,52	14.909,00
30-12-21	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	YDUQ3	20,56	211,00	4.337,92	20,17	20,55	20,80	8.525,00



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.