



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO

Setembro/2023

1. INTRODUÇÃO

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

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

2. RISCO DE MERCADO

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

2.1 Relatório Detalhado de Risco

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2023



Relatório de Risco de Mercado

Data: 29/09/2023

FUNDO: EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS
 CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais		Limite Fundo:	0,00% Dutation DC:	1.731,93
PL:	4.496.734.757,53	VAR / PL:	3,0949%	
VAR:	139.167.344,62	ETL / PL:	3,8811%	
ETL:	174.521.464,66	VAR / CDI:	0,0345%	
Status:		Benchmark:	ENQUADRADO	Dutation DU:
				1.189,96

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	185.812.310,74	Cenário Baixa - 10000 (+):	290.764.354,56	CENARIO BRADESCO 1 (+):	375.921.436,98	CENARIO BRADESCO 2 (+):	36.713.901,14
Cenário Alta - 09999 (-):	(203.324.252,26)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(194.105.170,02)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(56.031.174,09)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(390.927.575,72)
Cenário Alta - 09999:	(17.511.941,51)	Cenário Baixa - 10000:	96.659.184,54	CENARIO BRADESCO 1:	319.890.262,88	CENARIO BRADESCO 2:	(354.213.674,58)

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
17HO164854	7.906.618,55	152.423,25	140.056,65	0,10%	0,00	0,00	0,00	0,00
AEGP23	14.508.025,73	157.166,23	140.257,08	0,10%	-284.550,42	72.083,34	114.091,61	-151.197,02
CCRDD1	6.311.038,73	57.612,81	44.616,13	0,03%	976.882,47	-2.093.319,59	1.022.935,50	-1.031.308,78
CMDDT3	1.398.110,81	11.074,41	9.136,17	0,01%	-420.142,93	49.694,67	129.208,05	-173.466,27
CSMGIC3	10.715.247,84	100.934,92	86.857,64	0,06%	-7.297,52	6.105,00	9.181,48	-12.594,22
ELT42	13.774.750,46	727.459,69	650.069,70	0,47%	1.190.135,58	-1.190.135,58	349.948,63	-351.804,96
ENJG21	1.868.672,01	31.430,46	28.784,22	0,02%	21.107,10	-21.107,10	12.377,20	-12.478,52
ENMI21	1.171.877,02	20.532,74	18.865,68	0,01%	2.019.320,10	-1.442.371,50	845.806,65	-852.730,03
ENTV12	31.420.744,74	1.612.903,14	1.445.865,81	1,04%	-4.185,43	3.439,92	5.348,08	-7.597,32
ERDV17_VENCIMENTO	12.704.992,57	121.461,90	106.982,73	0,08%	-781.374,82	614.866,16	594.317,01	-734.126,27
ERDV36	4.328.855,78	39.138,56	30.219,68	0,02%	-70.571,71	56.659,48	46.535,98	-60.863,92
GASPI7	60.647.297,23	1.289.416,14	1.105.359,89	0,79%	-178,29	144,46	235,16	-341,23
GRRB24_VENCIMENTO	14.895.139,24	850.439,05	757.586,74	0,54%	-495,58	405,12	636,72	-911,64
IGSN15	2.578.872,99	120.570,16	109.427,75	0,08%	60.938,98	-60.938,98	29.778,85	-30.022,60
IFSN18000GM	14.455.499,97	221.874,87	197.423,81	0,14%	-323.176,31	257.126,78	233.392,20	-298.227,98
IFSN18000DC5	4.785.235,70	59.925,39	55.445,72	0,04%	877.883,42	-815.177,46	459.634,68	-463.397,03
NEOE16	6.863.700,79	385.397,82	343.951,90	0,25%	1.546.945,37	-1.918.257,33	907.128,77	-914.554,10
NTNB20240815 - 760199_VENCIMENTO	122.572.244,29	199.065,31	83.255,26	0,06%	142.839,41	-83.322,99	34.900,43	-35.186,11
NTNB20260815 - 760199_VENCIMENTO	42.193.055,22	738.664,26	704.113,22	0,51%	2.427.059,93	-2.427.059,93	1.423.227,94	-1.434.877,83
NTNB20300815 - 760199_VENCIMENTO	26.298.488,03	820.847,96	806.590,92	0,58%	3.377.628,00	-3.377.628,00	1.980.641,06	-1.996.853,67
NTNB20350515 - 760199_VENCIMENTO	240.153.529,09	9.866.481,44	9.723.049,12	6,99%	238.384,64	-238.384,64	139.788,75	-140.933,00
NTNB20400815 - 760199_VENCIMENTO	29.354.064,38	1.469.041,58	1.442.704,26	1,04%	2.480.974,93	-2.480.974,93	1.454.843,70	-1.466.752,38
NTNB20450515 - 760199_VENCIMENTO	227.673.312,58	12.598.769,82	12.315.435,87	8,85%	993.189,59	-993.189,59	728.007,97	-733.967,11
NTNB20500815 - 760199_VENCIMENTO	710.905.213,69	44.000.014,26	42.854.777,89	30,79%	0,00	0,00	0,00	0,00
NTNB20550515 - 760199_VENCIMENTO	226.765.054,08	14.839.962,17	14.444.057,08	10,38%	-64,70	52,68	91,58	-194,74
OMIG31	12.871.616,06	201.403,47	190.279,69	0,14%	-885,17	721,53	1.261,14	-1.853,44
PETRA5	8.973.409,83	137.327,40	113.172,29	0,08%	26.496,77	-26.496,77	15.537,71	-15.664,89
SBSPC2	17.165.051,13	135.623,03	111.804,87	0,08%	0,00	0,00	0,00	0,00
TAE33	8.549.577,39	87.427,64	70.636,22	0,05%	-58,98	51,31	107,43	-160,69
020913	1.958.069,06	175.738,20	126.480,20	0,09%	3.221.222,00	-3.221.222,00	472.231,15	-476.096,61
ABEV3	6.977.731,95	480.820,48	437.201,48	0,31%	3.415.261,01	-3.984.471,17	1.668.924,21	-1.682.585,26
AEGPA1	1.880.594,63	2.221,13	2.130,82	0,00%	1.769.477,00	-1.769.477,00	259.405,33	-261.528,70
AIEC11	2.380.277,15	204.471,43	181.594,61	0,13%	71.550,96	-71.550,96	41.957,48	-42.300,93
ALPA4	84.428,40	14.282,10	10.150,36	0,01%	0,00	0,00	0,00	0,00
ALSO3	5.769.498,00	573.046,84	483.540,83	0,35%	828.861,58	-828.861,58	485.946,23	-489.923,96
AMIS13	2.511.542,07	1.186,15	1.145,27	0,00%	159.374,66	-82.022,54	40.051,68	-40.405,77
ANEM11	10.449.724,74	514.493,32	461.558,72	0,33%	-755.040,61	481.494,01	157.492,61	-649.570,21
ANET11	2.140.964,47	67.424,70	60.984,56	0,04%	-6.769,34	5.522,86	8.414,12	-11.953,16
ANHB10	667.463,99	45,87	44,32	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
APRB28	1.258.829,46	137,75	133,10	0,00%	-491.047,70	220.403,11	285.043,22	-363.036,63
ARZZ3	203.129,92	44.180,10	41.001,92	0,03%	-284.068,38	397.223,65	270.648,58	-351.743,62
ASAB11	6.380.685,56	277.076,31	250.146,64	0,18%	0,00	0,00	0,00	0,00
ASAJ3	3.135.297,92	444.316,11	288.172,37	0,21%	-672.373,34	541.449,30	500.806,11	-632.723,02
AURE3	6.187.781,48	236.995,41	-37.573,17	-0,03%	-134.383,97	121.731,32	174.572,92	-213.409,80
AZUL4	238.065,68	39.231,18	19.929,73	0,01%	-612.395,30	529.829,22	474.867,42	-601.580,13
B3SA3	9.708.239,70	1.108.801,52	952.491,28	0,68%	-302.577,11	254.487,14	232.423,52	-233.883,13
BBAS3	13.610.611,98	783.338,81	631.942,81	0,26%	0,00	0,00	0,00	0,00
BBD04	953.538,54	84.565,25	64.761,25	0,05%	-72.920,86	34.475,46	32.087,13	-43.117,77
BBD04	9.923.899,70	706.715,13	485.303,58	0,35%	160.976,77	-160.976,77	94.396,78	-95.169,46
BBSE3	4.965.947,94	216.635,44	-100.244,56	-0,07%	0,00	0,00	0,00	0,00
BBTOPIND	324.108.709,96	10.367.405,48	10.162.579,05	7,30%	-944,42	776,45	1.195,99	-1.688,97
BCBF14	173.249,25	14,21	13,66	0,00%	-1.640,69	1.329,04	2.060,55	-2.957,93
BCBF15	3.148.261,97	198,64	191,03	0,00%	-1.718,47	1.393,49	2.288,82	-3.336,67
BEEF3	105.987,09	27.437,46	20.856,69	0,01%	344.977,25	-344.977,25	101.147,33	-101.975,28
BHIA3	50.850,35	193.501,47	-138.780,88	-0,10%	-4.799,09	4.002,05	6.054,85	-3.946,70
BKBR18	1.096.649,95	7,05	6,29	0,00%	983.376,34	-821.146,95	481.520,57	-485.462,08
BMLC11	3.221.022,00	127.701,23	48.067,48	0,03%	-426.347,52	345.927,86	318.544,21	-401.666,32
BPAC11	11.384.203,35	1.487.022,16	1.278.784,71	0,92%	-28.591,30	3.575,57	8.720,91	-11.728,61
BPML11	1.769.477,00	228.401,97	-202.731,85	-0,15%	223.820,56	-268.584,67	131.248,37	-132.322,71
BRAP4	286.203,84	23.631,96	-5.008,60	0,00%	94.613,56	-94.613,56	39.629,56	-39.953,95
BRELETRO	2.660.771,08	36.867,21	17.381,91	0,01%	175.693,65	-175.693,65	51.513,38	-51.935,04
BRFS3	3.314.776,43	507.924,30	221.334,71	0,16%	-691.386,03	578.415,85	533.683,16	-668.754,59
BRKM5	273.408,48	29.609,08	14.261,89	0,01%	60.593,47	-84.830,86	35.532,01	-35.822,86
BRKPD28	8.787.602,87	472.403,70	427.563,74	0,31%	-29.515,89	30.100,03	127.124,46	-193.484,11
BRKPA0	3.481.335,23	1.978,41	1.912,16	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
BTGL11	2.986.231,50	81.886,77	61.362,89	0,04%	-250.182,68	280.471,27	207.692,33	-269.561,72
BTOW15	5.144.792,13	345.576,33	310.774,41	0,22%	498.248,08	-498.248,08	365.215,85	-368.205,33
CAEC21	8.463.509,80	402.942,17	362.803,67	0,26%	181,98	-147,60	-267,05	401,92
CAIXA	76.354,49	0,00	0,00	0,00%	486.576,70	-486.576,70	324.237,02	-326.891,07
CART13	10.561.743,06	531.029,79	481.250,33	0,35%	930.753,33	-930.753,33	620.220,17	-625.297,01
CBAN22	8.723.699,34	48.210,46	43.965,82	0,03%	-0,01	0,01	0,03	-0,05
CBAN32	9.592.235,69	527.651,05	476.688,68	0,34%	-0,44	0,45	1,33	-2,00
CBAN72	4.508.050,76	250.823,32	226.696,65	0,16%	-5.412,82	4.592,31	6.966,32	-9.351,05
CCPRA3	40.453,06	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CCRD3	643.907,06	26.250,63	-3.189,38	0,00%	59.338,53	-59.338,53	34.796,11	-35.080,94
CDB32RSTI1	6.176.934,85	0,00	0,00	0,00%	-388.713,37	250.320,71	243.842,36	-215.004,87
CEAB22	561.615,70	272,80	263,33	0,00%	-6.111,82	5.237,22	7.919,73	-10.439,40
CEBA3	1.976.078,25	460,79	445,59	0,00%	251.208,13	-251.208,13	147.308,45	-148.514,24
CELG12	3.264.126,21	434,36	418,88	0,00%	-109.069,48	123.206,62	92.699,28	-119.882,46
CEOC11	689.954,50	121.441,04	54.227,43	0,04%	-249.133,08	35.082,34	78.222,42	-105.085,42
CGBP13	2.257.281,56	1.439,66	1.383,03	0,00%	146.442,39	-109.831,79	53.671,14	-54.110,46
CIEL3	3.284.587,80	339.596,88	72.410,65	0,05%	28.626,29	-28.626,29	8.393,88	-8.462,59
CJEN13	8.898.930,45	328.051,15	297.667,61	0,21%	410.241,60	-410.241,60	300.707,09	-303.168,54
CMIG4	695.282,22	51.624,29	-15.431,49	-0,01%	86.522,09	-78.411,98	39.637,93	-39.962,39
CMIN3	270.324,45	38.939,35	-33.017,61	-0,02%	-601.973,58	785.092,71	7.739.289,47	-7.791.277,48
CNES11	351.387,30	71.576,05	60.508,47	0,04%	-659.395,43	695.166,07	3.731.613,35	-3.739.091,08

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2023



Relatório de Risco de Mercado

Data: 29/09/2023

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

Dados Gerais		Limite Fundo:		0,00% Dutation DC:		1.731,93	
PL:	4.496.734.757,53	VAR / PL:	3,0949%	Status:	ENQUADRADO	Dutation DU:	1.189,96
VAR:	139.167.344,62	ETL / PL:	3,8811%	Benchmark:			
ETL:	174.521.464,66	VAR / CDI:	0,0345%				

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	185.812.310,74	Cenário Baixa - 10000 (+):	290.764.354,56	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	375.921.436,98	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	36.713.901,14
Cenário Alta - 09999 (-):	(203.324.252,26)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(194.105.170,02)	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	(56.031.174,09)	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(390.927.575,72)
Cenário Alta - 09999:	(17.511.941,51)	Cenário Baixa - 10000:	96.659.184,54	CENÁRIO BRADESCO 1:	319.890.262,88	CENÁRIO BRADESCO 2:	(354.213.674,58)

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
CNRD11	9.935.670,65	504.922,51	457.776,23	0,33%	92.535,37	-92.953,89	-232.157,38	223.405,06
COGN3	242.373,88	45.236,05	40.925,44	0,03%	-287.409,73	9.823,60	674.897,60	-9.939.079,72
COMPROMISSADA_PRE	1.051.093.315,26	16.098,59	-6.164,76	0,00%	-1.811.488,23	1.976.207,03	12.812.016,47	-12.864.713,06
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	528.988,55	0,00	0,00	0,00%	-28.178,61	28.235,19	124.021,93	-123.718,32
CONX12	6.650.880,21	303.163,12	273.425,90	0,20%	311.878,19	-307.820,62	-1.054.928,79	1.043.435,01
CPFE3	2.491.240,42	169.500,36	111.863,11	0,08%	8.277,95	-8.313,31	-24.069,66	23.552,87
CPGT16	147.156,20	32,16	-30,37	0,00%	-91,48	78,63	165,29	-246,85
CPLE3	2.211.712,26	172.839,15	129.357,15	0,09%	-1.277,24	1.311,75	3.546,20	-5.348,93
CPLE6	4.230.696,96	234.545,61	172.524,98	0,12%	-2.713.854,20	2.155.135,37	3.456.852,31	-5.048.017,63
CPMX23C099250	12,27	16,06	14,56	0,00%	-5.732.274,95	4.648.515,00	6.795.706,99	-9.616.060,32
CPMZ3C099500	219,77	130,85	-119,92	0,00%	21.023,42	-17.587,91	-17.587,91	34.898,74
CPT12	1.992.845,30	1.647,92	1.570,42	0,00%	-59.871,17	52.615,51	79.237,39	-100.775,95
CREDZM24	211.246,25	87.030,40	68.913,16	0,05%	-14.289,05	13.411,91	21.511,55	-23.632,24
CRFB3	237.354,10	60.072,95	52.766,24	0,04%	-284.639,23	248.993,38	513.691,69	-768.370,54
CRMG15	8.185.145,90	330.100,26	297.992,83	0,21%	565.018,42	-448.702,43	-700.684,65	1.015.470,68
CSAN23	1.121.004,95	1.892,42	1.792,99	0,00%	-188.407,83	155.376,69	285.279,59	-424.775,64
CSAN3	1.004.832,50	139.577,38	102.887,76	0,07%	2.301.555,65	-1.849.125,01	-2.793.791,20	4.018.834,89
CSMGB8	2.633.320,11	134.422,38	120.741,00	0,09%	1.903.918,79	-1.569.002,89	-2.279.619,49	3.173.044,36
CSNA3	366.105,98	28.092,31	426,94	0,00%	-5.699,68	4.828,20	7.086,85	-9.522,11
CVCB3	57.257,03	10.731,84	-5.541,59	0,00%	-2,81	2,86	12,09	-18,40
CXSE3	2.001.208,00	119.658,33	-62.486,29	-0,04%	-1.851,21	1.459,06	2.443,69	-3.896,59
CYRE3	270.381,53	66.326,32	63.594,75	0,05%	-3.639,27	2.931,75	4.329,11	-6.175,71
DAPK25	68.443,63	339.207,12	324.539,84	0,23%	-89.450,60	89.609,90	-110.658,85	111.495,18
DAPK27	40.446,67	479.675,06	462.536,98	0,33%	-699.897,79	711.751,17	-912.677,29	917.205,78
DAPK35	-9.657,67	52.036,92	-51.319,14	-0,04%	29.279,25	-36.135,10	17.169,35	-17.309,89
DAPQ24	57.890,77	144.790,93	108.229,60	0,08%	482.976,00	-482.976,00	482.976,00	-283.217,13
DAPQ26	153.855,59	1.440.003,10	1.379.402,88	0,99%	366.978,65	-366.978,65	298.883,73	-301.330,25
DAPQ28	2.606,86	19.414,60	18.960,58	0,01%	-1.611,88	1.298,51	2.074,26	-3.008,22
DAPQ30	-31.829,99	194.636,02	-191.388,94	-0,14%	-5.687,08	4.715,07	7.088,92	-9.850,27
DAPQ32	-563,88	4.966,12	-4.890,14	0,00%	6.329.759,58	-6.329.759,58	3.093.142,52	-3.118.461,56
DASAA2	2.717.550,79	11,89	10,73	0,00%	-422.237,13	760.554,95	484.467,19	-627.444,32
DHF24	12,52	127,83	-36,49	0,00%	1.200.368,12	-1.200.368,12	586.579,89	-591.381,36
DHF25	153.321,52	704.703,82	679.451,15	0,49%	158.725,35	-158.729,04	93.076,55	-93.838,43
DHF26	422.849,27	1.782.105,03	1.720.764,52	1,24%	258.930,00	-258.930,00	108.454,68	-109.342,44
DHF27	-1.566,29	6.793,02	-6.514,39	0,00%	2.644.772,71	-2.645.497,52	1.047.901,84	-1.056.479,48
DHF28	3.923,10	19.020,48	17.711,35	0,01%	975.917,89	-1.252.823,16	841.499,43	-848.381,56
DHF33	866,33	4.690,07	4.161,41	0,00%	-65.282,63	12.493,57	24.182,37	-32.121,34
DIJ24	7.432,46	32.774,99	29.205,20	0,02%	72.950,40	-43.781,12	23.765,62	-23.960,15
DIJ25	-34.504,80	158.768,26	-153.376,21	-0,11%	-42.713,74	7.947,50	15.784,68	-20.957,76
DIH24	7.906,69	31.736,56	29.809,04	0,02%	-1.388.572,86	1.445.168,65	1.137.201,01	-1.466.381,40
DIH25	-155.982,92	678.009,65	-655.370,62	-0,47%	-68,36	59,83	123,98	-185,48
DIH26	-142.225,80	612.198,21	-589.711,11	-0,42%	5.328.711,84	-5.328.711,84	3.905.945,78	-3.937.918,05
DIH27	415,07	1.829,51	1.744,26	0,00%	-186.494,91	16.764,06	54.844,23	-73.682,59
DIH28	-0,05	1,53	-0,59	0,00%	-355.454,08	31.951,82	104.531,57	-140.436,95
DIH29	94,08	411,44	393,75	0,00%	-2,98	2,41	10,05	-15,27
DIH35	267,35	1.102,97	1.065,82	0,00%	-49.654,32	23.164,74	21.739,61	-29.215,29
DOLV23	6.479,23	0,00	0,00	0,00%	-286.774,83	-23.764,50	70.280,34	-93.900,03
DOLX23	25.557,75	295.639,34	152.947,31	0,11%	0,00	0,00	0,00	0,00
DXCO3	117.117,00	15.639,60	8.310,83	0,01%	17.288,05	-25.932,08	12.672,14	-12.775,87
ECOR3	1.931.904,00	328.541,33	256.317,99	0,18%	492.462,87	-492.462,87	360.975,28	-363.930,06
EGIE3	2.038.770,30	122.467,48	-12.842,38	-0,01%	632.784,78	-632.784,78	185.532,50	-187.051,18
ELET13	2.146.995,16	425,83	411,45	0,00%	963.670,65	-963.670,65	282.548,24	-284.861,04
ELET24	2.664.897,50	1.717,84	1.653,65	0,00%	-1.822.050,97	2.156.808,49	1.450.321,66	-1.906.494,25
ELET3	21.099.198,61	1.632.574,35	212.739,98	0,15%	-773.625,47	524.998,03	571.339,32	-686.660,26
ELEB3	4.001.227,05	333.586,84	69.037,91	0,05%	338.646,45	-338.646,45	195.582,28	-200.207,78
EMBR3	634.901,40	71.682,71	33.635,72	0,02%	3.306.601,36	-3.306.601,36	1.077.217,24	-1.086.034,85
ENAT3	739.800,00	126.218,42	-91.106,68	-0,07%	-1.215,13	985,54	1.666,51	-2.437,11
ENEV3	1.148.034,36	714.171,88	559.042,56	0,40%	1.543.787,09	-1.372.492,06	1.257.430,95	-1.267.723,70
ENGH1	5.740.105,25	433.808,39	172.228,57	0,12%	818.337,53	-681.947,94	399.894,27	-403.167,62
ENJ3	162.112,00	43.400,71	35.815,44	0,03%	39.449,80	-23.012,39	9.638,90	-9.717,80
EQLT13	1.512.594,02	7,81	6,94	0,00%	-315,54	256,53	417,78	-606,68
EQLT3	26.643.559,18	2.140.314,42	769.660,97	0,55%	-210.209,19	497.648,63	296.098,98	-382.920,83
ERDV17	6.665.886,10	63.727,01	56.130,27	0,04%	-398.975,10	944.532,48	561.993,12	-726.780,18
ERDV18	1.414.468,33	0,53	-0,31	0,00%	-3.215,70	2.616,53	4.125,88	-5.919,54
ERDV38	5.831.016,43	83.840,35	79.011,28	0,06%	2.252.015,06	-2.252.015,06	971.015,90	-978.964,19
ETEN13	1.285.499,00	0,00	0,00	0,00%	-694.940,41	606.774,88	550.485,31	-684.951,54
EZTC3	86.440,26	25.335,72	23.120,13	0,02%	3.583.510,42	-3.583.510,42	525.342,63	-529.642,84
FLRY3	2.462.314,35	130.454,56	14.699,94	0,01%	-514.936,45	339.976,77	344.243,50	-439.752,71
FVPQ11	1.265.569,55	128.899,82	114.084,01	0,08%	0,00	0,00	0,00	0,00
GALG11	1.927.341,30	47.651,75	14.382,08	0,01%	-722.909,37	686.181,76	595.297,44	-748.959,49
GBSP11	7.367.979,24	445.711,40	388.591,81	0,28%	182.129,77	-186.071,89	111.899,97	-112.815,93
GBR4	1.354.585,81	137.326,66	75.873,10	0,05%	-149.744,20	118.539,37	110.363,31	-139.313,07
GGPS3	7.348.003,02	945.600,74	841.258,58	0,60%	304.690,67	-1.301,04	-1.301,04	2.031.758,38
GGSH12	2.518.439,25	290,69	280,28	0,00%	-252.683,82	750,60	750,60	-1.978.861,30
GMAT13	8.577.291,60	1.034.811,15	789.867,97	0,57%	-156.128,22	133,44	133,44	-1.872.563,41
GOAUA	2.727.791,75	303.601,43	184.333,24	0,13%	113.928,25	-38,92	-38,92	1.819.230,41
GOLL4	65.749,67	17.156,20	10.010,70	0,01%	108.420,05	-15,34	-15,34	2.435.929,49
GRRB14	1.076.100,19	81,07	78,25	0,00%	-73.419,84	7,67	7,67	-2.362.206,49
GRRB24	7.847.846,16	448.073,34	399.151,97	0,29%	-97.394,70	38,48	38,48	-10.371.457,84
GUAR15	2.752.991,07	886,59	857,12	0,00%	92.081,27	-48,70	-48,70	12.657.892,95
HAPV3	6.623.573,70	1.066.668,00	830.293,69	0,60%	-14.603,59	10,16	10,16	-2.543.076,47
HARG11	10.430.658,35	494.662,63	446.814,49	0,32%	-40,68	224.740,44	2.074.897,20	-44,68
HBRH11	3.583.510,42	77.131,61	-28.104,29	-0,22%	167,55	-310.132,60	-2.184.137,19	167,55
HBSA21	7.561.822,83	433.781,65	390.273,68	0,28%	-4.751,34	509.387,98	1.442.441,97	-4.751,34
HSLG11	931.443,87	0,00	0,00	0,00%	52.973,98	-1.083.167,35	-2.951.453,22	52.973,98
HVRD15	10.441.394,77	619.353,18	560.668,74	0,40%	176.782,19	-1.246.431,59	-3.386.086,69	176.782,19

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO - SETEMBRO 2023



Relatório de Risco de Mercado

Data: 29/09/2023

FUNDO: EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS
 CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais		Limite Fundo:		0,00% Dutation DC:		1.731,93	
PL:	4.496.734.757,53	VAR / PL:	3,0949%	Status:	ENQUADRADO	Dutation DU:	1.189,96
VAR:	139.167.344,62	ETL / PL:	3,8811%	Benchmark:			
ETL:	174.521.464,66	VAR / CDI:	0,0345%				

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	185.812.310,74	Cenário Baixa - 10000 (+):	290.764.354,56	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	375.921.436,98	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	36.713.901,14
Cenário Alta - 09999 (-):	(203.324.252,26)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(194.105.170,02)	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	(56.031.174,09)	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(390.927.575,72)
Cenário Alta - 09999:	(17.511.941,51)	Cenário Baixa - 10000:	96.659.184,54	CENÁRIO BRADESCO 1:	319.890.262,88	CENÁRIO BRADESCO 2:	(354.213.674,58)

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
HYPE3	763.301,28	80.203,59	68.456,27	0,05%	-422.374,30	1.782.847,84	4.836.404,99	-422.374,40
HZTC14	2.416.435,28	114.918,70	104.281,37	0,07%	-2.075.044,90	3.987.103,06	10.787.977,51	-2.086.521,60
IDIF24C381500	1.301,04	1.495,48	426,89	0,00%	2.430.794,67	-3.990.456,06	-10.793.112,71	2.471.842,16
IDIF24C381600	-750,60	847,41	-241,90	0,00%	2.190.899,81	-3.159.437,94	-8.542.588,54	2.260.525,95
IDIF24C381800	-133,44	164,86	-47,06	0,00%	-2.433.197,90	3.160.828,59	8.545.389,12	-2.666.624,05
IDIF24C381900	38,92	52,38	14,95	0,00%	845.996,04	-893.870,16	-2.416.508,74	1.157.351,04
IDIF24C382000	15,34	22,12	6,32	0,00%	-851.756,95	894.102,51	2.417.139,27	-1.244.406,24
IDIF24C382100	-7,67	10,99	-3,14	0,00%	55.645,10	-5.776.948,58	-13.058.939,27	55.645,10
IDIF24C382500	-38,48	41,27	-11,78	0,00%	-96.819,25	5.995.699,89	13.279.454,42	-96.819,25
IDIF24C382600	48,70	49,21	14,05	0,00%	-214.818,13	1.952.199,27	3.863.116,09	-214.819,00
IDIF24C382700	-10,16	9,71	-2,77	0,00%	248.008,78	-1.970.396,19	-3.881.767,65	248.011,50
IDIF24P380200	44,68	63,17	-18,03	0,00%	-50,60	248,22	14.559,92	-60,49
IDIF24P380300	-167,55	216,88	61,91	0,00%	62.583,49	-64.143,30	-270.977,27	226.864,67
IDIF24P381000	4.751,34	10.998,10	-3.139,47	0,00%	62.923,31	-64.178,70	-271.067,02	409.599,67
IDIF24P381100	-52.973,98	75.314,63	21.499,00	0,02%	-62.945,11	64.195,74	271.137,11	-412.166,34
IDIF24P381200	-176.792,19	106.497,10	30.400,22	0,02%	-157.345,64	115.164,36	110.714,04	-140.495,10
IDIF24P381300	422.374,40	161.482,36	-46.096,09	-0,03%	3.594,85	-2.746,41	-4.628,98	6.944,82
IDIF24P381600	2.666.521,60	382.996,20	-109.328,52	-0,08%	1.543.009,50	-1.543.009,50	1.131.025,96	-1.140.284,02
IDIF24P381700	-2.471.842,16	385.739,28	110.111,54	0,08%	676.720,61	-676.272,01	543.673,12	-547.341,81
IDIF24P381800	-2.260.525,95	307.021,64	87.641,13	0,06%	0,00	0,00	0,00	0,00
IDIF24P381900	2.566.624,05	307.770,10	-87.854,79	-0,06%	-430.949,79	341.374,37	312.112,43	-395.773,42
IDIF24P382400	-1.157.801,04	87.106,36	24.865,02	0,02%	-585.042,75	40.148,18	191.119,48	-253.770,67
IDIF24P382500	1.244.406,24	87.127,78	-24.871,14	-0,02%	117.460,20	-99.389,81	26.491,79	-26.708,64
IDJ24P390700	-55.645,10	113.677,68	-101.296,10	-0,07%	-178.695,25	125.913,11	134.584,21	-162.321,23
IDJ24P390800	96.819,25	177.158,54	157.862,74	0,11%	-622.314,58	553.775,86	502.460,13	-625.503,94
IDN24P400800	214.819,00	203.575,59	191.212,37	0,14%	0,00	0,00	0,00	0,00
IDN24P400900	-248.011,50	218.351,16	-205.089,61	-0,15%	1.201.220,35	-1.201.220,35	926.836,33	-934.422,99
IDV23P370500	60,49	56,24	-21,54	0,00%	7.809.520,33	-7.419.044,32	5.724.378,40	-5.771.235,53
IDV23P370600	-227.018,97	34.278,92	13.126,69	0,01%	-136,71	112,45	211,38	-313,04
IDV23P370700	-831.616,52	34.323,25	13.143,67	0,01%	359.863,75	-359.863,75	150.731,50	-151.965,32
IDV23P370800	1.436.234,17	34.333,15	-13.147,46	-0,01%	-206.692,11	141.200,35	139.623,02	-178.613,03
IGTA37	2.073.843,83	760,52	-727,25	0,00%	483.170,38	-386.544,42	283.331,11	-285.650,33
IGTH11	7.715.047,50	447.922,05	365.706,48	0,26%	-626.146,88	322.458,98	373.093,31	-478.039,92
INDV23	25.984,00	175.731,79	105.958,83	0,08%	-969,80	793,74	1.356,99	-1.988,12
INSS5N1	1.442.800,05	85.583,90	43.733,31	0,03%	-4.804,72	3.920,00	5.972,14	-8.484,06
INPL14	7.914.719,04	342.821,07	310.917,00	0,22%	-828.115,97	560.698,12	583.779,82	-714.377,14
IRBR12	11.442.299,78	234.443,05	220.752,50	0,16%	-34.594,09	369.007,74	180.873,36	-233.126,25
IRBR3	180.708,00	37.140,44	14.671,89	0,01%	0,00	0,00	0,00	0,00
IRJS14	1.589.184,80	103.827,17	90.732,16	0,07%	0,00	0,00	0,00	0,00
ITPO14	7.964.281,27	465.023,38	419.312,46	0,30%	0,00	0,00	0,00	0,00
ITSA10	27.421,50	2.008,03	1.768,75	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ITSA4	6.322.212,35	459.530,70	399.712,33	0,29%	0,00	0,00	0,00	0,00
ITUB4	39.047.601,66	1.953.119,83	733.884,76	0,53%	0,00	0,00	0,00	0,00
IVAS3	1.346.411,67	26,24	24,98	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
JBS5S	1.028.162,15	114.461,05	108.374,33	0,08%	0,00	0,00	0,00	0,00
JSM1B5	3.132.084,80	179.178,18	151.189,28	0,12%	0,00	0,00	0,00	0,00
KLBN11	1.932.681,51	103.843,93	-11.665,54	-0,01%	0,00	0,00	0,00	0,00
LAMEA6	8.865.068,03	483.656,27	434.959,21	0,31%	0,00	0,00	0,00	0,00
LCAMA9	1.925.368,73	225,06	216,44	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LCAMC3	3.147.562,02	1.404,23	1.357,23	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LCAMD1	12.199.920,42	714.030,18	642.145,33	0,46%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF001800FAU	4.042.332,02	282.981,97	249.278,47	0,18%	1.819,97	-1.497,93	-2.808,53	4.291,99
LF002100Q31	2.410.136,25	0,00	0,00	0,00%	2.778,67	-2.284,94	-4.276,44	6.535,37
LF002100S60	1.262.571,96	0,00	0,00	0,00%	1.911,44	-1.564,30	-2.903,15	4.437,16
LF002100HDP	1.503.643,98	0,00	0,00	0,00%	-11.349,10	9.243,52	13.854,40	-19.862,26
LF002100HDQ	2.739.247,39	0,00	0,00	0,00%	-41.268,17	31.385,23	133.331,64	-181.646,60
LF002100ISJ	2.808.281,50	0,00	0,00	0,00%	-240.604,70	-32.290,28	52.016,08	-69.695,39
LF00220018H	1.269.149,02	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002200IO9	2.395.076,10	0,00	0,00	0,00%	-60.741,13	68.021,90	-147,20	224,10
LF00230695Q	5.118.546,13	0,00	0,00	0,00%	-3.004,52	3.835,30	-5,74	8,74
LF002306J15	10.259.248,90	0,00	0,00	0,00%	-6.211,90	8.974,74	17,81	-27,12
LF002306SWQ	10.269.686,73	0,00	0,00	0,00%	-157.030,51	266.160,38	4.365,88	-6.645,46
LF002306U55	6.164.638,73	0,00	0,00	0,00%	-12.208,89	25.540,60	845,10	-1.285,89
LF002306ZBP	5.077.747,82	0,00	0,00	0,00%	-53.521,14	120.871,35	8.008,53	-12.161,72
LF002306ZK1	5.093.850,07	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFSC1900089	3.556.292,85	0,00	0,00	0,00%	-2.200,89	1.826,07	2.739,50	-3.799,01
LFSC190054B	875.009,82	0,00	0,00	0,00%	-439.696,62	268.372,17	283.190,14	-362.183,72
LFSC190059S	1.325.346,16	0,00	0,00	0,00%	1.299.140,48	-1.299.188,96	952.305,51	-960.100,64
LFSC19005L1	876.759,66	0,00	0,00	0,00%	-108,86	91,66	173,58	-257,78
LFSC22002X	4.578.337,88	3.384,64	3.269,79	0,00%	-569.186,79	459.369,00	711.865,91	-1.031.598,82
LFNS210029N	4.315.867,20	0,00	0,00	0,00%	-2.288.785,72	1.873.360,90	2.805.746,75	-4.035.624,46
LFT20240301 - 210100	67.014.263,91	1.932,39	252,82	0,00%	-2.077.389,68	1.855.098,29	2.597.025,05	-3.612.241,14
LFT20240901 - 210100	1.164.995,49	72,54	-70,70	0,00%	100.392,01	-100.392,01	36.793,67	-37.094,85
LFT20250901 - 210100	1.137.166,01	322,50	-120,20	0,00%	2.250.232,80	-2.250.232,80	659.768,26	-665.168,82
LFT20260301 - 210100	24.988.248,49	5.799,97	-1.621,19	0,00%	399.457,89	-399.457,89	195.201,76	-196.799,59
LFT20260901 - 210100	1.841.236,02	520,31	-53,74	0,00%	811.530,34	-811.532,50	238.527,73	-240.480,21
LFT20290301 - 210100	3.962.805,68	5.708,98	3.987,92	0,00%	158.659,61	-137.301,59	44.729,81	-45.095,94
LIGHB4	2.322.832,85	0,00	0,00	0,00%	-5.317,62	4.449,05	6.685,01	-9.162,40
LIGHD3	917.313,52	666,48	641,34	0,00%	-550.290,44	375.224,99	371.637,22	-475.353,14
LORTA7	6.108.278,11	364.333,20	327.559,58	0,24%	470.822,42	-353.116,82	172.556,42	-173.968,88
LREN3	6.495.944,80	1.022.032,66	938.481,22	0,67%	652.280,57	-652.280,57	318.747,77	-321.356,90
LREN81	1.368.389,47	19,23	18,13	0,00%	-537.354,03	400.963,53	365.761,80	-471.417,34
LTN20250401 - 100000	17.852.307,87	160.171,93	154.532,10	0,11%	305.713,40	-241.495,49	144.795,27	-145.980,50
LTN20250701 - 100000	60.877.413,18	681.695,86	637.909,18	0,46%	-210.070,30	410.064,65	256.491,90	-331.780,67
LTN20260701 - 100000	34.897.569,16	676.903,38	650.789,34	0,47%	710.208,00	-710.208,00	208.232,99	-209.937,49
LWSA3	250.980,03	30.502,21	4.539,86	0,00%	914.734,08	-914.734,08	134.100,02	-135.197,70

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SEEMBRO 2023



Relatório de Risco de Mercado

Data: 29/09/2023

FUNDO: EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS
 CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais		Limite Fundo:		0,00% Dutation DC:		1.731,93	
PL:	4.496.734.757,53	VAR / PL:	3,0949%	Status:	ENQUADRADO	Dutation DU:	1.189,96
VAR:	139.167.344,62	ETL / PL:	3,8811%	Benchmark:			
ETL:	174.521.464,66	VAR / CDI:	0,0345%				

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	185.812.310,74	Cenário Baixa - 10000 (+):	290.764.354,56	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	375.921.436,98	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	36.713.901,14
Cenário Alta - 09999 (-):	(203.324.252,26)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(194.105.170,02)	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	(56.031.174,09)	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(390.927.575,72)
Cenário Alta - 09999:	(17.511.941,51)	Cenário Baixa - 10000:	96.659.184,54	CENÁRIO BRADESCO 1:	319.890.262,88	CENÁRIO BRADESCO 2:	(354.213.674,58)

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
MALL11	4.500.465,60	210.094,36	151.740,50	0,11%	708.547,84	-708.547,84	415.492,45	-418.893,48
MATD3	1.331.526,30	200.455,77	145.669,86	0,10%	-123.043,37	103.815,04	86.445,76	-112.202,39
MAXR11	1.627.065,00	59.492,66	3.711,17	0,00%	-161.374,97	163.552,54	102.354,19	-137.600,47
MGLU3	305.114,64	67.359,72	51.766,04	0,04%	-1.531.110,70	1.551.771,33	971.127,00	-1.305.540,50
MOVZV7	1.158.879,64	1.619,24	1.553,24	0,00%	-239.967,23	236.013,99	157.178,93	-209.991,84
MOVZ7	8.287.976,33	476.477,05	428.811,94	0,31%	-797.690,33	863.223,56	624.936,96	-625.500,82
MIRFG3	1.177.056,05	96.523,84	44.804,42	0,03%	-1.187.923,06	1.315.289,42	930.512,08	-1.228.338,53
MRVE3	2.174.268,58	575.050,69	512.904,20	0,37%	-195.865,49	225.255,92	161.034,37	-211.337,71
MTRJ19	11.729.062,68	483.926,12	435.892,32	0,31%	-744.073,18	848.130,10	640.682,21	-831.449,60
MULT3	987.689,43	65.046,21	56.614,03	0,04%	-1.421.666,19	1.613.045,63	1.256.545,21	-1.603.834,73
NEWL11	1.420.416,00	175.981,48	156.109,21	0,11%	-17.635.245,11	21.742.904,54	17.482.554,82	-21.453.249,53
NEWU11	914.734,08	21.310,91	4.811,45	0,00%	-2.655.754,14	3.601.960,76	2.060.226,61	-3.360.269,61
NTCO3	2.834.191,36	493.545,10	314.794,24	0,23%	-20.256.933,43	35.925.796,69	25.457.683,85	-29.071.970,92
NTEN11	3.044.583,86	124.708,79	112.519,39	0,08%	-774.893,36	1.258.356,62	945.138,03	-1.046.956,66
NTNB20240815 - 760199_NEGOCIACAO	12.918.876,27	20.980,95	8.774,88	0,01%	-74.285.432,60	120.632.813,33	90.805.989,96	-100.367.071,75
NTNB20250815 - 760199_NEGOCIACAO	12.199.372,51	86.408,80	83.295,83	0,06%	-24.598.034,29	40.891.797,96	30.674.565,26	-33.196.150,77
NTNB20260815 - 760199_NEGOCIACAO	28.332.636,58	496.013,05	472.812,03	0,34%	-11.268,49	9.737,68	14.781,04	-19.170,02
NTNB20270515 - 760199_NEGOCIACAO	5.996.796,82	119.567,05	114.637,16	0,08%	-7.580,95	6.315,66	9.526,69	-13.152,86
NTNB20280815 - 760199_NEGOCIACAO	17.933.226,48	458.387,01	447.366,39	0,32%	-678.979,62	-63.049,91	166.571,22	-222.370,69
NTNB20500815 - 760199_NEGOCIACAO	7.415.662,92	458.977,19	447.030,89	0,32%	1.078.029,40	-1.078.029,40	451.540,31	-455.236,42
NTSD35	1.856.536,18	3.506,34	3.304,78	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
OMGE13	3.064.530,29	2.283,94	2.194,98	0,00%	-1.457,82	1.185,15	1.943,66	-2.826,14
ONCO3	3.080.084,00	348.887,44	229.114,32	0,16%	-5.503,34	4.582,15	6.902,68	-9.544,83
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-311.693,99	241.166,12	207.635,90	-269.901,11
OVSAT0	1.855.916,89	369,91	356,97	0,00%	3.148.842,50	-3.148.842,50	923.533,82	-931.093,44
PALFA1	2.510.335,82	1.656,49	1.601,61	0,00%	7.001,75	-7.001,75	4.105,83	-4.139,44
PASN12	8.278.386,67	293.795,32	264.700,28	0,19%	3.382.292,29	-4.034.750,75	1.971.648,20	-1.987.280,77
PATC11	6.299.685,00	463.730,43	-340.413,62	-0,24%	6.951.745,72	-8.342.175,14	4.076.503,69	-4.109.872,07
PCAR3	28.007,00	36.580,83	22.148,96	0,02%	-91.841,48	138.258,71	75.670,32	-101.676,22
PETR3	13.449.169,17	1.015.402,30	-190.348,67	-0,14%	19.487,23	-19.488,88	11.428,28	-11.521,83
PETRA4	27.806.982,88	1.919.253,46	-196.972,37	-0,14%	9.712.781,57	-9.712.781,57	2.373.156,30	-2.392.581,86
PETZ3	77.955,52	12.275,10	181,11	0,00%	-7,08	7,25	21,18	-32,00
PRIO3	16.187.969,28	1.881.056,58	1.464.238,37	1,05%	2.733.463,80	-2.733.463,80	801.451,59	-808.011,90
PRLG14	1.164.163,44	0,80	-0,40	0,00%	-200.763,79	-18.593,96	48.704,02	-56.122,25
QAQR11	5.466.927,60	209.079,67	153.950,02	0,11%	1.174.479,74	-1.174.479,74	860.893,65	-867.940,53
QUA12	4.013.894,10	54.155,44	51.165,52	0,04%	-1.192.675,86	898.475,37	892.197,84	-1.099.069,39
RADL3	5.872.398,68	234.242,07	-40.329,04	-0,03%	9.773.982,86	-7.187.587,43	3.184.146,42	-3.210.210,37
RAHD11	15.714.308,96	779.434,12	697.873,71	0,50%	75.065,98	-75.065,98	31.441,92	-31.699,29
RAIL3	21.719.961,90	1.486.738,98	531.284,38	0,38%	0,00	0,00	0,00	0,00
RAIZ4	214.474,22	30.174,66	7.114,66	0,01%	3.441.471,20	-3.441.471,20	504.519,68	-508.649,44
RBCAPMZ	620.732,79	5.932,45	327,49	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
RBR11	3.441.471,20	247.086,60	112.306,87	0,08%	-3.444,61	2.810,35	4.533,39	-6.549,39
RRCB11	6.160.308,00	321.731,55	238.870,13	0,17%	1.003.430,74	-1.003.430,74	490.345,15	-494.356,88
RDCO10	3.891.937,26	910,23	879,31	0,00%	-8.806,24	4.975,78	7.524,22	-9.915,41
RDOA3	3.344.769,12	610.449,32	491.486,91	0,35%	-8.302,92	7.115,37	10.759,63	-14.175,04
RDOA9	1.110.381,97	1.798,04	1.703,47	0,00%	-481.084,94	378.244,78	358.486,40	-445.718,86
RDOCB9	1.587.846,21	2.571,20	2.435,96	0,00%	2.175.569,68	-2.175.569,68	531.564,19	-535.915,33
RDVE11	7.247.799,46	347.634,88	314.950,30	0,23%	0,00	0,00	0,00	0,00
RECV3	3.625.949,46	780.340,15	733.174,12	0,53%	7.212.462,71	-5.404.262,83	3.112.110,65	-3.137.584,95
RENT1	45.248,00	18.581,41	9.847,57	0,01%	-188.397,34	132.344,04	132.071,83	-167.302,04
RENT3	21.228.585,60	2.183.444,66	1.875.114,98	1,35%	-331,13	272,13	484,58	-714,20
RIS412	2.634.019,92	142.232,52	128.777,94	0,09%	-1.175.750,52	818.680,46	877.614,00	-1.061.700,47
RLOG11	1.011.350,46	71,28	68,35	0,00%	17.651,82	-17.651,82	5.175,51	-5.217,88
RMSA12	10.708.646,78	679.224,29	595.206,89	0,43%	-22.997,48	19.406,73	28.353,99	-38.117,12
RNGO11	35.303,64	1.891,81	1.469,72	0,00%	-224.096,00	54.754,61	54.754,61	-55.202,81
RODB11	2.779.773,80	7.216,18	6.875,66	0,00%	-282,20	229,82	388,90	-565,80
RRRP3	373.496,66	44.550,04	18.333,85	0,01%	-373.929,19	267.297,43	244.568,01	-316.521,18
RSAN24	785.539,03	67,78	65,30	0,00%	89.669,31	-89.669,31	65.727,60	-66.265,62
RSAN44	7.920.237,77	337.767,67	305.734,47	0,22%	1.239.885,48	-1.239.885,48	727.068,85	-733.020,30
SANB11	448.346,55	24.092,41	3.512,44	0,00%	-350.090,24	44.037,70	106.883,39	-143.747,33
SBSB3	4.959.541,92	282.417,12	-24.512,92	-0,02%	-5.084,21	4.175,45	6.367,10	-8.991,48
SBSBPC7	2.453.956,05	1.494,23	1.442,16	0,00%	92.748,00	-92.748,00	22.661,43	-22.846,92
SCAR3	154.580,00	16.816,20	6.984,64	0,01%	60.384,87	-60.384,87	29.508,07	-29.749,61
SLCE3	201.282,90	26.548,22	20.356,89	0,01%	-17.073,25	14.162,35	21.442,15	-29.839,41
SMFT16	6.019.838,98	5.109,39	4.917,34	0,00%	1.255.600,00	-1.255.600,00	460.177,40	-463.944,20
SMFT3	3.199.000,00	524.829,08	442.126,18	0,32%	84.706,66	-84.708,10	41.393,67	-41.732,50
SMTQ3	282.357,92	47.123,53	-27.235,38	-0,02%	-569,04	465,52	816,57	-1.200,73
SNGO18	1.835.800,52	125,23	120,25	0,00%	-1.116,04	919,12	1.400,38	-1.968,66
SNGOA1	520.345,13	328,27	316,65	0,00%	49.665,53	-49.665,53	24.269,89	-24.468,55
SOMA3	165.551,75	40.857,85	30.704,69	0,02%	322.746,20	-322.746,20	135.184,55	-136.291,11
STBP3	922.132,00	61.552,32	24.884,27	0,02%	3.212.127,56	-2.569.702,05	1.883.591,60	-1.889.009,81
SUZB3	12.848.510,24	1.094.098,44	-316.896,70	-0,23%	94.780,80	-94.780,80	55.579,46	-56.034,41
TAE11	379.123,20	11.444,35	-7.710,03	0,00%	-73.681,23	51.098,54	38.888,30	-52.211,18
TBSP11	2.700.697,10	1.205,52	1.163,58	0,00%	-4.162,62	3.441,56	5.304,63	-7.491,95
TCH16	13.487.457,24	716.916,97	637.441,18	0,46%	-1.117.822,64	825.283,63	835.753,50	-1.023.422,22
TEP11	5.778.367,56	205.600,87	122.596,20	0,09%	2.889.183,78	-2.889.183,78	847.108,68	-854.042,73
TIMS3	1.818.768,83	76.731,83	-12.359,38	-0,01%	582.006,03	-418.316,83	266.631,51	-268.814,03
TOTS3	3.010.122,00	208.377,34	86.895,36	0,06%	602.024,40	-602.024,40	441.283,89	-444.896,03
TRXF11	8.089.380,60	304.629,52	244.604,02	0,18%	4.044.690,30	-4.044.690,30	1.185.903,20	-1.195.610,45
UGEL11	1.131.405,77	291,60	282,03	0,00%	-1.062,18	862,29	1.349,52	-1.937,53
UGPA3	11.931.150,00	668.992,60	356.893,38	0,26%	2.982.787,50	-2.386.230,00	1.749.106,59	-1.763.423,97
UNEG11	9.775.543,53	538.390,97	477.636,49	0,34%	-851.597,28	714.565,00	682.888,08	-835.697,23
USIM5	171.863,92	7.658,01	2.631,18	0,00%	66.948,93	-37.766,06	25.165,93	-25.371,93
UTPS21	6.256.394,19	333.476,70	300.615,54	0,22%	-463.363,65	387.555,01	361.173,43	-450.184,68
VALES3	48.284.963,88	5.326.966,41	-2.946.004,97	-2,12%	12.071.240,97	-12.071.240,97	7.078.875,71	-7.136.517,66
VAMO22	1.071.353,76	151,76	1					

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2023



Relatório de Risco de Mercado

Data: 29/09/2023

FUNDO: EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS
 CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais			
PL:	4.496.734.757,53	VAR / PL:	3,0949%
VAR:	139.167.344,62	ETL / PL:	3,8811%
ETL:	174.521.464,66	VAR / CDI:	0,0345%
Limite Fundo:		Status:	ENQUADRADO
Benchmark:		Dutacion DC:	0,00%
		Dutacion DU:	1,731,93
			1.189,96

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	185.812.310,74	Cenário Baixa - 10000 (+):	290.764.354,56	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	375.921.436,98
Cenário Alta - 09999 (-):	(203.324.252,26)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(194.105.170,02)	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	(56.031.174,09)
Cenário Alta - 09999:	(17.511.941,51)	Cenário Baixa - 10000:	96.659.184,54	CENÁRIO BRADESCO 1:	319.890.262,88
				CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	36.713.901,14
				CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(390.927.575,72)
				CENÁRIO BRADESCO 2:	(354.213.674,58)

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
VAMO3	206.202,75	32.197,37	22.692,37	0,02%	72.170,96	-82.481,10	30.229,32	-30.476,77
VAMO33	11.030.950,22	644.357,11	577.966,22	0,42%	-688.363,68	522.867,80	488.780,05	-625.705,91
VAMO34	7.066.063,59	393.300,55	353.966,85	0,25%	-463.781,31	309.206,39	310.390,46	-396.798,17
VBBR3	10.456.667,76	919.563,67	-309.654,38	-0,22%	2.614.166,94	-2.614.166,94	1.532.947,49	-1.545.495,60
VCCS11	926.051,14	1.061,64	1.014,54	0,00%	-3.458,36	2.917,54	4.383,00	-5.936,76
VECS11	3.582.822,65	205,23	196,63	0,00%	-945,83	773,61	1.359,62	-2.002,15
VERDEC52	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
VERO12	4.630.442,94	233.631,18	209.639,87	0,15%	-183.193,47	217.396,87	159.909,10	-206.959,09
VIMI13	6.958.553,59	346.645,31	312.979,79	0,22%	-466.262,04	398.322,72	363.813,19	-454.894,96
VIVT3	916.884,12	52.540,45	-24.765,38	-0,02%	137.530,50	-137.534,74	134.415,21	-135.515,47
VIXL14	1.173.989,02	130,83	126,19	0,00%	-535,01	432,87	716,56	-1.046,01
VRDN12	4.841.716,92	241.054,10	218.608,29	0,16%	-300.988,14	246.933,45	226.142,58	-286.141,59
VVED15	1.608.950,27	567,93	548,66	0,00%	-1.974,38	1.614,46	2.485,80	-3.538,90
VVEO16	1.111.437,14	449,47	434,13	0,00%	-1.535,76	1.256,81	1.917,19	-2.714,04
WDOV23	-2.591,69	0,00	0,00	0,00%	35.780,24	-35.843,96	44.263,54	-44.598,07
WDOX23	2.044,62	23.851,15	12.235,78	0,01%	-55.991,82	55.940,09	-73.014,18	73.376,46
WEGE3	6.360.270,93	711.210,04	267.606,51	0,19%	1.590.067,73	-1.590.067,73	932.415,72	-940.048,04
WINV23	-2.436,00	16.474,86	-9.933,64	-0,01%	-63.442,56	63.400,50	-50.969,36	51.313,30
XPIN11	3.687.938,00	158.078,80	57.755,70	0,04%	1.843.969,00	-1.843.969,00	540.651,71	-545.077,24
XPLG13	113,40	3,90	2,41	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
XPPR11	1.979.803,62	73.982,16	-9.447,50	-0,01%	989.901,81	-989.901,81	290.239,21	-292.614,98
YDIQ3	2.408.681,14	588.752,36	538.140,48	0,39%	939.385,65	-602.170,29	353.112,66	-356.003,07
Total Var:	4.684.592.358,83	181.812.558,04	139.167.344,62	99,93%	-17.511.941,51	96.659.184,54	319.890.262,87	-354.213.674,59



Relatório de Risco de Mercado

Data: 29/09/2023

FUNDO: EMBRAERPREV RENDA FIXA
 CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais			
PL:	3.304.598.271,19	VAR / PL:	3,5955%
VAR:	118.817.098,90	ETL / PL:	4,5089%
ETL:	149.001.435,53	VAR / CDI:	0,0401%
Limite Fundo:		Status:	ENQUADRADO
Benchmark:		Dutacion DC:	0,00%
		Dutacion DU:	2,254,86
			1.549,61

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (+):	256.323.563,19	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	226.964.350,11
Cenário Alta - 09999 (-):	(179.260.577,01)	Cenário Baixa - 10000 (-):	-	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	-
Cenário Alta - 09999:	(179.260.577,01)	Cenário Baixa - 10000:	256.323.563,19	CENÁRIO BRADESCO 1:	226.964.350,11
				CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	-
				CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(254.987.542,01)
				CENÁRIO BRADESCO 2:	(254.987.542,01)

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
CAIXA	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
FI RF EMB II	2.749.849.298,45	97.433.888,77	96.975.389,35	81,62%	-147.030.703,14	231.191.902,34	173.072.029,88	-195.315.500,46
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	142.322.603,32	3.148.233,36	2.873.009,93	2,42%	-4.445.736,99	2.376.726,87	2.346.135,68	-3.077.143,66
FIM EMB VI A CRED PRIV	259.591.904,85	5.151.531,02	4.961.615,42	4,18%	-7.207.999,94	7.541.942,11	36.864.499,10	-38.120.175,95
FIM EMB VII A CRED PRIV	336.327.021,76	15.608.224,63	14.007.084,19	11,79%	-20.578.136,94	15.212.991,87	14.681.685,45	-18.474.721,94
Total Var:	3.488.090.828,37	121.341.871,78	118.817.098,90	100,01%	-179.260.577,01	256.323.563,19	226.964.350,11	-254.987.542,01

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2023



Relatório de Risco de Mercado

Data: 29/09/2023

FUNDO: EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL
CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais			
PL:	571.297.478,70	VAR / PL:	4,6632%
VAR:	26.640.566,72	ETL / PL:	5,8478%
ETL:	33.408.345,44	VAR / CDI:	0,052%
Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	4,40
Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1,96
Benchmark:			

Cenários de STRESS			
Cenário Alta - 09999 (+):	137.376.983,17	Cenário Baixa - 10000 (+):	0,50
Cenário Alta - 09999 (-):	(0,49)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(134.615.874,97)
Cenário Alta - 09999:	137.376.982,67	Cenário Baixa - 10000:	(134.615.874,46)
CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	71.929.966,86	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	-
CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	-	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(72.522.089,67)
CENÁRIO BRADESCO 1:	71.929.966,86	CENÁRIO BRADESCO 2:	(72.522.089,67)

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

Produto	MIM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
CAIXA	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	15.000.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
FIA RVA EMB II	221.733.188,19	8.998.628,45	8.823.322,50	33,12%	53.269.601,91	-53.592.539,20	29.551.209,92	-29.793.344,20
FIA RVA EMB III	103.046.209,01	6.058.941,37	5.826.418,67	21,87%	28.645.344,77	-27.724.404,58	13.685.616,30	-13.800.770,97
FIA RVA EMB IV	98.537.024,05	5.617.638,50	5.440.842,43	20,42%	27.753.257,19	-25.282.946,71	13.212.263,60	-13.320.982,12
FIC FIA EMB VIII ETF	41.176.063,91	1.907.945,73	1.888.695,91	7,09%	-0,49	0,50	2,13	-3,24
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA E	106.705.843,83	4.742.239,19	4.651.287,20	17,50%	27.708.779,31	-28.015.984,49	15.480.874,91	-15.606.989,15
Total Var:	586.198.328,99	27.325.393,23	26.640.566,72	100,00%	137.376.982,67	-134.615.874,47	71.929.966,86	-72.522.089,67



Relatório de Risco de Mercado

Data: 29/09/2023

FUNDO: FI RF EMB II
CNPJ: 11005764000196

Dados Gerais			
PL:	2.630.483.181,53	VAR / PL:	3,7040%
VAR:	97.433.290,42	ETL / PL:	4,6450%
ETL:	122.185.276,99	VAR / CDI:	0,0413%
Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	2.505,66
Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1.722,16
Benchmark:			

Cenários de STRESS			
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (+):	231.190.482,56
Cenário Alta - 09999 (-):	(147.029.800,20)	Cenário Baixa - 10000 (-):	-
Cenário Alta - 09999:	(147.029.800,20)	Cenário Baixa - 10000:	231.190.482,56
CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	173.070.967,03	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	-
CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	-	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(195.314.301,00)
CENÁRIO BRADESCO 1:	173.070.967,03	CENÁRIO BRADESCO 2:	(195.314.301,00)

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

Produto	MIM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
CSMIGC3	10.715.247,84	100.934,92	62.911,02	0,63%	0,00	0,00	0,00	0,00
ELET42	13.774.750,48	727.459,89	616.073,89	0,63%	0,00	0,00	0,00	0,00
ENTV12	13.675.119,24	696.843,84	591.851,81	0,61%	-19.191,58	19.571,39	82.657,81	-125.805,63
GASP17	50.250.617,71	1.068.373,37	947.943,47	0,97%	0,00	0,00	0,00	0,00
IGSN15	2.578.872,99	120.570,16	102.954,69	0,11%	-249.133,08	35.082,34	78.222,42	-105.085,42
NEOE16	6.863.700,79	385.397,82	326.573,00	0,34%	0,00	0,00	0,00	0,00
NTNB20240815 - 760199_VENCIMENTO	122.572.244,29	199.065,31	69.873,18	0,07%	-422.237,13	760.554,95	484.467,19	-627.444,32
NTNB20260815 - 760199_VENCIMENTO	42.193.055,22	738.664,26	713.767,14	0,73%	-599.923,47	624.375,29	491.319,97	-633.540,12
NTNB20300815 - 760199_VENCIMENTO	26.298.488,03	820.847,96	812.556,46	0,83%	-1.509.699,38	1.787.069,89	1.201.695,09	-1.579.666,66
NTNB20350515 - 760199_VENCIMENTO	240.153.529,09	9.866.481,44	9.804.836,68	10,06%	-157.345,64	115.164,36	110.714,04	-140.495,10
NTNB20400815 - 760199_VENCIMENTO	29.354.064,38	1.469.041,58	1.468.195,43	1,51%	-210.070,30	410.084,65	256.491,90	-331.780,67
NTNB20450515 - 760199_VENCIMENTO	227.673.312,58	12.598.769,82	12.591.293,44	12,92%	-1.531.110,70	1.551.771,33	971.127,00	-1.305.540,50
NTNB20500815 - 760199_VENCIMENTO	710.905.213,69	44.000.014,26	43.956.489,58	45,11%	-1.187.923,06	1.315.299,42	930.512,08	-1.229.338,53
NTNB20550515 - 760199_VENCIMENTO	226.765.054,08	14.839.962,17	14.823.970,26	15,21%	-1.421.666,19	1.613.045,63	1.256.545,21	-1.603.834,76
PETRA5	8.973.409,93	137.327,40	109.264,57	0,11%	-17.635.245,11	21.742.904,54	17.482.554,82	-21.453.249,53
SBSPC2	9.717.750,29	76.781,06	60.475,40	0,06%	-2.655.754,14	3.601.960,76	2.850.226,61	-3.360.269,61
BBTOPIND	324.108.709,96	10.367.405,48	10.354.682,66	10,63%	-20.256.933,43	35.925.796,69	25.457.683,85	-29.071.970,92
CAIXA	5.000,00	0,00	0,00	0,00%	-74.285.432,60	120.632.813,33	90.605.999,96	-100.367.071,75
COMPROMISSADA_PRE	683.433.153,48	10.467,49	-2.412,26	0,00%	-24.698.094,29	40.891.797,96	30.674.568,26	-33.196.150,77
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-78.882,80	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-91.841,48	138.258,71	75.670,32	-101.676,22
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-198.198,62	24.931,32	60.510,52	-81.380,51
Total Var:	2.749.832.411,29	98.224.406,21	97.433.290,42	99,99%	-147.029.800,20	231.190.482,56	173.070.967,03	-195.314.301,01

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2023



Data: 29/09/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FI RF EMB V CREDITO PRIVADO
CNPJ: 20726178000121

Dados Gerais	
PL:	139.375.336,96
VAR:	3.148.233,36
ETL:	3.948.011,64
VAR / PL:	2,2588%
ETL / PL:	2,8326%
VAR / CDI:	0,0252%
Limite Fundo:	0,00%
Status:	ENQUADRADO
Benchmark:	
Dutacion DC:	780,24
Dutacion DU:	535,05

Cenários de STRESS			
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (+):	2.472.067,06
Cenário Alta - 09999 (-):	(4.445.736,99)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(95.340,19)
Cenário Alta - 09999:	(4.445.736,99)	Cenário Baixa - 10000:	2.376.726,87
CENARIO BRADESCO 1 (+):	2.346.135,68	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(3.077.143,66)
CENARIO BRADESCO 1:	2.346.135,68	CENARIO BRADESCO 2:	(3.077.143,66)

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
17H0164854	7.906.618,55	152.423,25	152.045,70	4,83%	-284.550,42	72.083,34	114.091,61	-151.197,02
AEGP23	14.508.025,73	157.166,23	154.306,24	4,90%	-420.142,93	49.694,67	129.208,05	-173.466,27
CCRDD1	6.311.038,73	57.612,81	55.166,42	1,75%	0,00	0,00	0,00	0,00
CMDT33	1.398.110,81	11.074,41	10.838,25	0,34%	-72.920,86	34.475,46	32.087,13	-43.117,77
ENJG21	1.868.672,01	31.430,46	31.338,52	1,00%	-28.591,30	3.575,57	8.720,91	-11.728,61
ENMI21	1.171.877,02	20.532,74	20.464,04	0,65%	-25,31	25,81	109,02	-165,93
ENTV12	17.845.625,50	916.059,30	911.894,25	28,97%	0,00	0,00	0,00	0,00
ERDV17_VENCIMENTO	12.704.992,57	121.461,90	118.313,86	3,76%	0,00	0,00	0,00	0,00
ERDV96	4.328.955,78	39.139,56	37.432,81	1,19%	-65.282,63	12.493,57	24.182,37	-32.121,34
GASP17	10.396.679,53	221.042,77	197.118,45	6,26%	-42.713,74	7.947,50	15.784,68	-20.957,76
GRRB24_VENCIMENTO	14.895.139,24	850.439,05	846.257,20	26,88%	-788.649,39	820.793,35	645.881,04	-832.841,28
LFSN16000GM	14.455.499,97	221.874,87	219.094,78	6,96%	-355.454,08	31.951,82	104.531,57	-140.436,95
LFSN18000DC5	4.785.235,70	58.926,39	56.221,84	1,79%	-49.654,32	23.164,74	21.739,51	-29.212,29
OMGE31	12.871.618,06	201.403,47	195.930,75	6,22%	-312.351,60	369.738,60	248.626,57	-326.827,59
SBSPC2	7.447.300,84	58.841,98	57.575,31	1,83%	-398.975,10	944.532,48	561.993,12	-726.780,18
TAE33	8.549.577,39	87.427,64	84.241,87	2,68%	-481.268,17	31.385,23	135.331,64	-181.646,60
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	-240.604,70	-32.290,28	52.016,08	-69.695,39
COMPROMISSADA_PRE	901.397,77	13,81	-6,94	0,00%	-678.979,62	-63.049,91	166.571,22	-222.370,69
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-24.661,90	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-151.891,61	19.106,38	46.372,87	-62.366,82
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-73.661,23	51.096,54	38.868,30	-52.211,18
Total Var:	142.322.603,29	3.206.868,63	3.148.233,36	100,01%	-4.445.736,99	2.376.726,87	2.346.135,68	-3.077.143,66

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2023



Data: 29/09/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO
CNPJ: 4183766000109

Dados Gerais		Limites Fundo:		ENQUADRADO		0,00% Dutation DC:		782,21	
PL:	247.451.631,23	VAR / PL:	2,0818%	Status:		Dutation DC:			
VAR:	5.151.530,60	ETL:	2,6107%	Benchmark:		Dutation DU:			536,62
ETL:	6.460.227,21	VAR / CDI:	0,2323%						

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	422.745,97	Cenário Baixa - 10000 (+):	8.160.926,53	CENARIO BRADESCO 1 (+):	40.053.433,69	CENARIO BRADESCO 2 (+):	1.312.687,09
Cenário Alta - 09999 (-):	(7.630.745,34)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(618.985,03)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(3.188.937,57)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(39.432.859,96)
Cenário Alta - 09999:	(7.207.999,36)	Cenário Baixa - 10000:	7.541.941,49	CENARIO BRADESCO 1:	36.864.496,12	CENARIO BRADESCO 2:	(38.120.172,87)

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
020913	1.958.069,06	175.738,20	112.162,03	2,18%	0,00	0,00	0,00	0,00
AECPA1	1.880.594,63	2.221,13	2.130,92	0,04%	-7.297,52	6.105,00	9.181,48	-12.594,22
AMBP13	2.611.542,07	1.186,15	1.149,33	0,02%	-4.185,43	3.439,92	5.348,08	-7.597,32
APRB28	1.288.829,46	137,75	133,69	0,00%	-495,58	405,12	636,72	-911,64
BCBF15	3.148.261,97	198,64	193,02	0,00%	-885,17	721,63	1.261,14	-1.853,44
BKBR18	1.096.648,95	7,05	6,43	0,00%	-58,98	51,31	107,43	-160,69
BRELETRO	2.660.771,08	36.867,21	17.403,28	0,34%	0,00	0,00	0,00	0,00
BRKPA0	3.481.335,23	1.975,41	1.917,46	0,04%	-6.769,34	5.522,86	8.414,12	-11.953,16
CAIXA	10.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CART13	943.450,37	47.435,38	46.410,54	0,90%	-60.061,19	48.366,12	44.735,58	-56.519,34
CBAN22	4.206.631,71	23.247,44	20.965,69	0,41%	-64.800,93	58.699,73	84.180,34	-102.907,77
CCPRA3	40.453,06	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CEAB22	561.615,70	272,80	263,95	0,01%	-944,42	776,45	1.195,99	-1.688,97
CELG12	3.264.126,21	434,36	422,84	0,01%	-1.718,47	1.393,49	2.288,82	-3.336,67
COMPROMISSADA_PRE	75.245.103,25	1.152,46	-158,24	-0,01%	-2.112,97	2.154,78	9.100,52	-13.851,04
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-75.821,38	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CSAN23	1.121.004,95	1.892,42	1.789,71	0,03%	-6.111,82	5.237,22	7.919,73	-10.439,40
CSMG88	2.633.320,11	134.422,38	131.550,78	2,55%	-109.069,48	123.206,52	92.699,28	-119.882,46
DAPK25	68.443,63	339.207,12	323.633,23	6,28%	-601.973,58	785.092,71	7.739.289,47	-7.791.277,48
DAPK27	40.446,67	479.675,06	465.426,35	9,03%	-659.395,43	695.166,07	3.731.613,35	-3.730.091,08
DAPK35	-9.657,67	52.036,92	-49.370,45	-0,97%	92.636,37	-92.953,89	-232.167,38	223.406,06
DAPO24	57.890,77	144.790,93	98.994,22	1,92%	-287.409,73	574.897,60	9.863.587,96	-9.939.079,72
DAPO26	153.655,59	1.440.003,10	1.404.029,55	27,25%	-1.811.488,23	1.976.207,03	12.812.016,47	-12.864.713,06
DAPO28	2.606,86	19.414,60	18.881,31	0,37%	-28.178,61	28.235,19	124.021,93	-12.718,32
DAPQ30	-31.829,99	194.636,02	-189.228,18	-3,67%	311.878,19	-307.820,62	-1.054.928,79	1.043.435,01
DAPQ32	-563,88	4.966,12	-4.812,43	-0,09%	8.277,36	-8.313,31	-24.069,66	23.552,87
DASAA2	2.717.550,79	11,89	10,97	0,00%	-91,46	78,63	165,29	-246,85
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DHF25	3.008,87	13.829,51	13.453,36	0,26%	-53.258,23	42.293,61	67.839,25	-99.065,19
DHF26	37.955,61	159.964,55	154.861,70	3,01%	-514.538,00	417.258,01	609.993,34	-863.152,68
DHF29	2.616,40	12.680,32	11.772,88	0,23%	-39.914,11	35.077,01	52.824,92	-67.183,97
DH26	17.429,63	75.024,29	72.196,04	1,40%	-233.323,38	192.279,77	279.355,13	-388.853,48
ELET24	2.664.897,50	1.717,84	1.654,70	0,03%	-5.887,08	4.716,07	7.088,92	-8.850,27
GBSP11	2.565.000,39	155.164,65	146.081,68	2,84%	-269.285,93	182.766,55	198.899,26	-239.045,71
GGSH12	2.518.439,25	290,69	282,85	0,01%	-1.215,13	985,54	1.666,51	-2.437,11
GUAR15	2.752.991,07	886,59	861,04	0,02%	-3.215,70	2.618,53	4.125,88	-5.919,54
HZTC14	2.416.435,28	114.918,70	112.483,77	2,18%	-149.744,20	118.539,37	110.363,31	-139.313,07
IDIF24P380200	-40,12	56,72	8,54	0,00%	40,12	-201.803,64	-1.863.135,08	40,12
IDIF24P380300	150,45	194,74	-29,32	0,00%	-150,45	278.480,75	1.961.226,14	-150,45
IGTA37	2.073.843,83	760,52	-736,06	-0,01%	3.504,85	-2.746,41	-4.628,98	6.944,52
INSSSN1	1.442.800,05	85.583,90	91.952,90	1,01%	0,00	0,00	0,00	0,00
IRJ514	1.589.184,80	103.827,17	97.741,15	1,90%	-178.695,25	125.913,11	134.584,21	-162.321,23
JSMIL85	3.132.084,80	179.178,18	175.142,78	3,40%	-206.692,11	141.200,35	139.623,02	-178.613,03
LCAMA9	1.935.350,73	225,06	219,95	0,00%	-969,80	783,74	1.355,99	-1.908,12
LCAMD1	4.861.010,23	284.502,51	277.986,67	5,40%	-329.959,65	223.487,64	222.643,62	-284.640,76
LF01800FAU	4.042.332,02	282.981,97	273.931,55	5,32%	-34.594,09	369.007,74	180.873,36	-233.126,25
LF0021003Q1	2.410.136,25	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002200IO9	2.395.076,10	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF00230695Q	5.118.546,13	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306Z8P	5.077.747,82	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306ZK1	5.093.850,07	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFSC190054B	875.009,82	0,00	0,00	0,00%	1.819,97	-1.497,93	-2.808,53	4.291,99
LFSC190095S	1.325.346,16	0,00	0,00	0,00%	2.778,67	-2.284,94	-4.276,44	6.535,37
LFSC19005L1	876.759,66	0,00	0,00	0,00%	1.911,44	-1.564,30	-2.903,15	4.437,16
LFSC22002K	4.578.337,88	3.384,64	3.277,29	0,06%	-11.349,10	9.243,52	13.854,40	-19.582,26
LFSC210029N	4.315.897,20	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20240301 - 210100	10.845.437,68	312,73	81,31	0,00%	-9.830,21	11.008,51	-23,82	36,27
LFT20240901 - 210100	1.164.995,49	72,54	7,94	0,00%	-3.004,52	3.835,30	-5,74	8,74
LIGHB4	2.322.832,85	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LIGHD3	917.313,52	666,48	641,63	0,01%	-2.200,89	1.826,07	2.739,50	-3.799,01
LREN81	1.368.389,47	19,23	18,47	0,00%	-109,86	91,66	173,58	-257,78
MOVIZ7	1.158.879,64	1.619,24	1.553,21	0,03%	-5.317,62	4.449,05	6.685,01	-9.162,40
MTRJ19	2.960.611,44	121.738,45	119.293,32	2,32%	-135.179,00	100.868,04	92.012,55	-118.591,69
NTEN11	3.044.583,86	124.708,79	122.349,13	2,38%	-123.043,37	103.815,04	86.445,76	-112.202,39
NTNB20240815 - 760199_NEGOCIACAO	104.150,16	169,15	72,19	0,00%	-1.300,99	1.318,55	825,17	-1.109,32
NTNB20250515 - 760199_NEGOCIACAO	596.921,89	4.220,95	4.102,16	0,08%	-11.722,06	11.528,94	7.677,97	-10.257,80
NTNB20260815 - 760199_NEGOCIACAO	2.388.126,93	41.808,40	40.590,10	0,79%	-67.236,45	74.445,95	52.666,98	-69.580,56
NTNB20270515 - 760199_NEGOCIACAO	703.990,46	14.035,50	13.563,31	0,26%	-22.993,52	26.443,79	18.904,54	-24.809,63
NTNB20280815 - 760199_NEGOCIACAO	5.686.351,99	145.347,51	140.695,40	2,73%	-235.934,23	268.928,09	203.150,63	-263.639,96
NTNB20500815 - 760199_NEGOCIACAO	648.550,50	40.140,70	36.812,36	0,71%	-67.763,73	110.051,90	82.658,79	-63.563,70
NTSD35	1.856.536,18	3.506,34	3.296,21	0,06%	-11.268,49	9.737,68	14.781,04	-19.170,02
OMGE13	2.105.916,39	1.569,50	1.509,21	0,03%	-5.209,56	4.340,06	6.546,65	-9.038,52
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
OVSAT10	1.855.916,89	369,91	359,93	0,01%	-1.457,82	1.185,15	1.943,66	-2.826,14
PASN12	3.762.555,86	133.531,00	130.960,73	2,54%	-141.666,01	109.610,85	94.371,25	-122.671,01
RAHD11	3.337.517,80	165.541,82	159.729,17	3,10%	-253.309,07	190.824,65	189.491,39	-233.428,25
RBCAPMZ	620.732,79	5.932,45	605,11	0,01%	0,00	0,00	0,00	0,00
RDCO10	3.891.937,26	910,23	884,88	0,02%	-3.444,61	2.810,35	4.533,39	-6.549,39
RDCOR9	1.110.381,97	1.796,04	1.700,32	0,03%	-5.806,24	4.975,78	7.524,22	-9.915,41
RDCR39	1.557.846,21	2.571,20	2.431,46	0,05%	-8.302,92	7.115,37	10.759,63	-14.179,04
RIS412	2.634.019,92	142.332,52	138.993,78	2,70%	-188.397,34	132.344,04	132.071,83	-167.302,04
RLOG11	1.011.350,46	71,28	69,26	0,00%	-331,13	272,13	484,58	-714,20
RODB11	2.779.773,80	7.216,18	6.866,12	0,13%	-22.997,48	19.406,73	28.353,39	-38.117,12
RSAN24	785.539,03	67,78	65,98	0,00%	-282,20	229,82	386,90	-565,80
RSAN44	843.950,15	35.991,23	35.354,35	0,69%	-39.844,46	28.482,19	26.060,23	-33.727,28
SMFT16	2.629.315,25	2.231,65	2.150,09	0,04%	-7.457,17	6.185,76	9.365,40	-13.033,12
SNGO18	1.835.800,52	125,23	121,69	0,00%	-569,04	465,52	816,57	-1.200,73

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2023



Data: 29/09/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO
CNPJ: 41837660000109

Dados Gerais							
PL:	247.451.631,23	VAR / PL:	2,0818%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	782,21
VAR:	5.151.530,60	ETL / PL:	2,6107%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	536,62
ETL:	6.460.227,21	VAR / CDI:	0,0232%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	422.745,97	Cenário Baixa - 10000 (+):	8.160.926,53	CENARIO BRADESCO 1 (+):	40.053.433,69	CENARIO BRADESCO 2 (+):	1.312.687,09
Cenário Alta - 09999 (-):	(7.630.745,34)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(618.985,03)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(3.188.937,57)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(39.432.859,96)
Cenário Alta - 09999:	(7.207.999,36)	Cenário Baixa - 10000:	7.541.941,49	CENARIO BRADESCO 1:	36.864.496,12	CENARIO BRADESCO 2:	(38.120.172,87)

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
SNGOA1	520.345,13	328,27	317,29	0,01%	-1.116,04	919,12	1.400,38	-1.968,66
TBSP11	2.700.697,10	1.205,52	1.166,62	0,02%	-4.182,62	3.441,56	5.304,63	-7.491,95
UGEL11	1.131.405,77	291,60	283,40	0,01%	-1.062,18	862,29	1.349,52	-1.937,53
LNEG11	4.425.249,35	243.721,93	232.184,31	4,51%	-385.505,96	323.473,40	309.133,71	-378.308,24
VAMO33	2.705.045,90	158.011,37	154.275,39	2,99%	-168.802,81	128.219,36	119.860,25	-153.437,66
VCCS11	926.051,14	1.061,64	1.013,93	0,02%	-3.458,36	2.917,64	4.383,00	-5.936,76
VECS11	3.582.822,65	205,23	199,26	0,00%	-945,83	773,61	1.359,62	-2.002,15
VERDECS2	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
VIXL14	1.173.989,02	130,83	127,37	0,00%	-535,01	432,87	716,56	-1.046,01
VVEO15	1.608.950,27	567,93	550,65	0,01%	-1.974,38	1.614,46	2.485,80	-3.538,90
VVEO16	1.111.437,14	449,47	435,21	0,01%	-1.535,76	1.256,81	1.917,19	-2.714,04
Total Var:	259.591.883,86	5.981.606,90	5.151.530,60	100,00%	-7.207.999,37	7.541.941,49	36.864.496,11	-38.120.172,87

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2023



Data: 29/09/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV
CNPJ: 41687175000104

Dados Gerais		Limite Fundo:		0,00% Duration DC:		1,961,61	
PL:	287.288.121,47	VAR / PL:	5,4252%	Status:	ENQUADRADO	Duration DU:	1,347,91
VAR:	15.586.006,29	ETL / PL:	6,8034%	Benchmark:			
ETL:	19.545.484,45	VAR / CDI:	0,0605%				

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (-):	15.233.697,54	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	14.660.788,86	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	-
Cenário Alta - 09999 (-):	(20.546.850,73)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(42.358,46)	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	-	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(18.448.426,69)
Cenário Alta - 09999:	(20.546.850,73)	Cenário Baixa - 10000:	15.191.339,08	CENÁRIO BRADESCO 1:	14.660.788,86	CENÁRIO BRADESCO 2:	(18.448.426,69)

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
ANEM11	10.449.724,74	514.493,32	511.932,72	3,28%	-781.374,82	614.866,16	594.317,01	-734.126,27
ANET11	2.140.964,47	67.424,70	66.557,49	0,43%	-70.571,71	56.659,48	46.535,98	-60.863,92
ASAB11	6.380.685,56	277.076,31	276.707,66	1,78%	-323.176,31	257.126,78	233.392,20	-298.227,98
BRKP28	8.787.602,87	472.403,70	470.266,18	3,02%	-756.040,61	481.494,01	617.492,61	-649.570,21
BTOW15	5.144.792,13	345.576,33	345.390,66	2,22%	-491.047,70	220.403,11	285.043,22	-353.036,63
CABC21	8.463.509,90	402.942,17	397.801,69	2,57%	-284.058,38	397.223,65	270.648,58	-351.743,62
CAIXA	999,99	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CART13	9.618.292,69	483.594,41	483.573,61	3,10%	-612.312,15	493.083,18	456.070,53	-576.203,68
CBAN32	9.592.235,69	527.651,05	527.526,73	3,38%	-612.385,30	529.829,22	474.867,42	-601.580,13
CBANT2	4.508.050,76	250.823,32	250.793,31	1,61%	-302.577,11	254.497,14	232.423,52	-293.883,13
CJEN13	6.838.930,45	328.020,10	328.020,10	2,10%	-426.347,52	345.927,86	318.544,21	-401.666,32
CNRD11	9.935.670,65	504.922,51	504.221,90	3,24%	-691.386,03	578.415,85	533.683,16	-668.754,59
COMPROMISSADA_PRE	15.941.011,55	244,15	-139,70	0,00%	-447,64	456,50	1.927,99	-2.934,40
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-139.102,28	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CONX12	6.650.880,21	303.163,12	299.816,66	1,92%	-250.182,68	280.471,27	207.692,33	-269.561,72
CREDZM24	211.246,25	87.030,40	89.354,28	0,45%	0,00	0,00	0,00	0,00
CRNG15	8.185.145,90	330.100,26	328.330,40	2,11%	-388.713,37	250.320,71	243.842,36	-315.040,87
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ERDV17	6.665.886,10	63.727,01	61.534,10	0,39%	-186.494,91	16.764,06	54.844,23	-73.682,59
ERDV38	5.831.016,43	83.840,35	80.268,72	0,52%	-286.774,83	-23.764,50	372.440,07	-93.900,03
GBSP11	4.802.978,84	290.546,75	285.301,32	1,83%	-504.239,54	342.231,48	372.440,07	-447.614,55
GRRB24	7.847.846,16	448.073,34	442.581,89	2,84%	-210.209,19	497.648,63	296.098,98	-382.920,83
HARG11	10.430.658,35	494.662,63	493.301,59	3,17%	-694.940,41	606.874,88	550.485,31	-684.951,54
HBSA21	7.561.822,83	433.781,65	433.132,32	2,78%	-514.936,45	339.976,77	344.243,50	-439.752,71
HVRD15	10.441.394,77	619.353,18	619.301,73	3,97%	-722.909,37	688.181,76	595.297,44	-748.959,49
IPIL11	7.914.719,04	342.821,07	342.707,88	2,20%	-430.949,79	341.374,37	312.112,43	-395.773,42
IRBR12	11.442.399,78	234.443,05	226.299,15	1,45%	-585.042,75	40.146,16	191.119,48	-253.770,67
ITPO14	7.964.281,27	465.023,38	463.951,92	2,98%	-622.314,58	553.775,86	502.460,13	-625.503,94
LAMEA6	8.865.086,03	483.656,27	482.846,64	3,10%	-626.146,88	322.458,98	373.093,31	-478.039,92
LCAMD1	7.338.910,19	429.527,67	428.743,14	2,75%	-498.156,42	337.410,47	336.136,20	-429.736,38
LORTA7	6.108.278,11	364.333,20	363.702,86	2,33%	-439.696,62	268.372,17	283.190,14	-362.183,72
MOVI37	8.287.976,83	476.477,05	475.551,75	3,05%	-550.290,44	375.224,99	371.637,22	-475.353,14
MTRJ19	8.778.451,24	362.187,66	360.506,12	2,31%	-402.175,03	300.095,49	273.749,25	-352.825,65
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PASN12	4.515.830,81	160.264,31	158.828,30	1,02%	-170.027,97	131.555,27	113.264,65	-147.230,11
QUAT12	4.013.894,10	54.156,44	51.112,32	0,33%	-200.763,79	-18.593,96	48.704,02	-65.122,25
RAHD11	12.376.791,16	613.892,31	610.881,62	3,92%	-939.366,80	707.690,72	702.706,46	-866.641,14
RDVE11	7.247.789,46	347.634,88	347.375,62	2,23%	-481.084,94	378.244,78	356.496,40	-445.716,86
RMSA12	10.708.846,78	679.224,29	667.045,19	4,28%	-1.175.750,52	818.680,46	877.614,00	-1.061.700,47
RSAN44	7.076.287,62	301.776,45	299.882,29	1,92%	-334.084,73	238.815,24	218.507,78	-282.793,90
TCI111	13.487.457,24	716.016,97	711.197,34	4,56%	-1.117.622,64	825.283,63	835.753,50	-1.023.422,22
UNEG11	5.350.294,18	294.669,05	290.957,40	1,87%	-466.091,32	391.091,60	361.173,43	-457.389,00
UTPS21	6.256.394,19	333.476,70	332.635,82	2,13%	-463.363,65	387.555,01	361.173,43	-450.184,68
VAMO33	8.326.904,32	486.345,74	484.933,57	3,11%	-519.560,87	394.648,44	368.919,80	-472.268,25
VAMO34	7.066.063,59	393.300,55	392.645,59	2,52%	-463.781,31	309.206,39	310.390,46	-396.798,17
VERDECS2	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
VERO12	4.630.442,94	233.531,18	231.365,52	1,48%	-183.193,47	217.396,87	159.909,10	-206.959,09
VMT13	6.958.553,59	346.645,31	346.225,58	2,22%	-466.262,04	396.322,72	363.813,19	-454.894,96
VRDN12	4.841.716,92	241.054,10	241.038,19	1,55%	-300.988,14	246.933,45	226.142,88	-286.141,59
Total Var:	335.848.324,32	15.689.939,41	15.586.009,29	100,00%	-20.546.850,73	15.191.339,08	14.660.788,87	-18.448.426,69

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2023



Relatório de Risco de Mercado

Data: 29/09/2023

FUNDO:	FIM EMB I A
CNPJ:	20725946000122

Dados Gerais	
PL:	414.288.095,38
VAR:	2.809.192,75
ETL:	3.522.841,05
VAR / PL:	0,6781%
ETL / PL:	0,8503%
VAR / CD:	0,0076%
Limite Fundo:	0,00% Dutation DC:
Status:	ENQUADRADO Dutation DU:
Benchmark:	
	313,49
	214,35

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	8.188.542,48	Cenário Baixa - 10000 (+):	27.976.797,40	CENARIO BRADESCO 1 (+):	61.097.914,34	CENARIO BRADESCO 2 (+):	28.587.390,32
Cenário Alta - 09999 (-):	(17.334.937,58)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(19.676.969,03)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(50.571.312,40)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(44.052.832,35)
Cenário Alta - 09999:	(9.146.395,10)	Cenário Baixa - 10000:	8.299.828,38	CENARIO BRADESCO 1:	10.526.601,94	CENARIO BRADESCO 2:	(15.465.442,04)

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
ANB10	667.463,99	45,87	45,76	0,00%	-173,29	144,46	235,16	-341,23
BCBF14	173.249,25	14,21	14,10	0,00%	-54,70	52,68	91,58	-134,74
CAIXA	9.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CBAN22	4.517.067,62	24.963,03	23.489,06	0,84%	-69.583,04	63.031,58	90.392,58	-110.502,03
CEEB3	1.976.078,25	460,79	459,84	0,02%	-1.640,69	1.329,04	2.060,55	-2.957,93
CGBP13	2.257.281,56	1.439,66	1.427,64	0,05%	-4.799,09	4.002,05	6.054,65	-8.346,70
COMPROMISSADA_PRE	256.244.841,88	3.924,66	-1.715,62	-0,06%	-7.195,65	7.338,05	30.991,53	-47.169,27
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	1.576,07	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPMX23C099250	12,27	16,06	14,62	0,00%	-0,01	0,01	0,03	-0,05
CPMZ23C099500	219,77	130,85	-119,87	0,00%	-0,44	0,45	1,33	-2,00
CPTE12	1.992.845,30	1.647,92	1.623,34	0,06%	-5.412,82	4.892,31	6.966,32	-9.351,05
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DH25	94.841.409,19	648.784,49	646.044,55	23,00%	-2.498.505,70	1.984.122,07	3.182.545,77	-4.647.449,68
DH26	98.738.794,66	1.548.406,82	1.542.511,56	54,91%	-4.980.567,08	4.038.927,13	5.904.544,86	-8.355.048,20
DH27	-429.904,07	10.189,53	-10.072,63	-0,36%	31.535,12	-26.381,86	-38.278,32	52.348,11
DH24	36.461.679,41	32.605,61	29.900,47	1,06%	-283.168,22	247.706,60	511.036,95	-764.399,63
DH24	13.762.637,98	31.316,21	30.474,46	1,08%	-185.912,36	153.318,73	282.487,81	-419.150,66
DH26	-23.242.157,94	460.649,15	-457.367,39	-16,28%	1.432.605,56	-1.180.597,77	-1.715.301,92	2.387.560,34
DOLV23	-751.140,02	0,00	0,00	0,00%	-89.450,60	89.609,90	-110.658,85	111.495,18
DOLX23	-252.617,94	11.825,57	7.029,38	0,25%	-27.995,91	28.470,05	-36.507,09	36.688,23
ELET13	2.146.995,16	425,83	424,82	0,02%	-1.611,88	1.298,51	2.074,26	-3.008,22
EQT13	1.512.594,02	7,81	7,13	0,00%	-68,36	59,83	123,98	-185,48
ETEN13	1.285.499,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
GRB14	1.076.100,19	81,07	80,85	0,00%	-315,54	256,53	417,78	-606,68
IDIF24C381500	1.301,04	1.495,48	361,43	0,01%	304.690,67	-1.301,04	-1.301,04	2.031.758,38
IDIF24C381600	-750,60	847,41	-204,80	-0,01%	-252.683,82	750,60	750,60	-1.978.861,30
IDIF24C381800	-133,44	164,86	-39,84	0,00%	-156.128,22	133,44	133,44	-1.872.583,41
IDIF24C381900	38,92	52,38	12,66	0,00%	113.928,25	-38,92	-38,92	1.819.230,41
IDIF24C382000	15,34	22,12	5,35	0,00%	108.420,05	-15,34	-15,34	2.435.929,49
IDIF24C382100	-7,67	10,99	-2,65	0,00%	-73.419,84	7,67	7,67	-2.362.206,49
IDIF24C382500	-38,48	41,27	-9,98	0,00%	-97.394,70	38,48	38,48	-10.371.457,84
IDIF24C382600	48,70	49,21	11,89	0,00%	92.081,27	-48,70	-48,70	12.657.892,95
IDIF24C382700	-10,16	9,71	-2,35	0,00%	-14.603,59	10,16	10,16	-2.543.076,47
IDIF24P382000	64,80	119,89	-28,97	0,00%	-84,80	426.544,08	3.358.032,28	-94,80
IDIF24P383000	-518,00	411,62	99,48	0,00%	316,00	-588.613,36	-4.145.363,33	318,00
IDIF24P381000	4.751,34	10.998,10	-2.658,06	-0,09%	-4.751,34	509.387,98	1.442.441,97	-4.751,34
IDIF24P381100	-52.973,98	75.314,63	18.202,28	0,65%	52.973,98	-1.083.157,35	-2.951.458,22	52.973,98
IDIF24P381200	-119.356,13	71.902,50	17.377,62	0,62%	119.356,13	-841.539,80	-2.286.147,70	119.356,13
IDIF24P381300	326.208,80	124.716,28	-30.141,83	-1,07%	-326.208,72	1.376.931,59	3.735.259,21	-326.208,80
IDIF24P381600	2.086.521,60	382.996,20	-92.563,73	-3,30%	-2.075.044,90	3.987.103,06	10.787.977,51	-2.086.521,60
IDIF24P381700	-2.471.842,16	385.739,28	93.226,69	3,32%	2.430.794,67	-3.990.456,06	-10.793.112,71	2.471.842,16
IDIF24P381800	-2.260.525,95	307.021,64	74.201,96	2,64%	2.190.899,81	-3.159.437,94	-8.542.588,54	2.260.525,95
IDIF24P381900	2.566.624,05	307.770,10	-74.382,85	-2,65%	-2.433.197,90	3.160.828,59	8.545.389,12	-2.566.624,05
IDIF24P382400	-1.157.801,04	87.106,36	21.052,14	0,75%	845.998,04	-893.870,16	-2.416.608,74	1.157.801,04
IDIF24P382500	1.244.406,24	87.127,78	-21.057,32	-0,75%	-851.756,95	894.102,51	2.417.139,27	-1.244.406,24
IDU24P390700	-55.645,10	113.877,68	-104.246,35	-3,71%	55.645,10	-5.776.948,59	-13.050.933,27	55.645,10
IDU24P390800	96.819,25	177.158,54	162.460,49	5,78%	-96.819,25	5.995.599,89	13.279.454,42	-96.819,25
IDIN24P400800	214.819,00	203.576,58	198.104,64	7,05%	-214.818,13	1.952.199,27	3.863.116,09	-214.819,00
IDIN24P400900	-248.011,50	218.351,16	-212.482,09	-7,56%	248.008,78	-1.970.396,19	-3.881.767,65	248.011,50
IDIV23P370500	60,49	56,24	-24,59	0,00%	-50,60	248,22	14.559,92	-60,49
IDIV23P370600	-227.018,97	34.278,92	14.984,67	0,53%	62.583,49	-64.143,30	-270.977,27	226.864,67
IDIV23P370700	-831.616,52	34.323,25	15.004,06	0,53%	62.923,31	-64.178,70	-271.067,02	409.599,67
IDIV23P370800	1.436.234,17	34.333,15	-15.008,38	-0,53%	-62.945,11	64.195,74	271.137,11	-412.166,34
IVAS3	1.346.411,67	26,24	25,85	0,00%	-136,71	112,45	211,38	-313,04
LCAMC3	3.147.562,02	1.404,23	1.400,02	0,05%	-4.804,72	3.920,00	5.972,14	-8.484,06
LF0021006S0	1.262.571,96	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0021006HP	1.503.643,98	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0021006DQ	2.739.247,39	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0021006SJ	2.808.281,50	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF00220018H	1.269.149,02	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFSC1900089	3.586.292,85	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20240301 - 210100	55.475.384,03	1.599,66	233,13	0,01%	-50.282,39	56.309,52	-121,85	185,52
LFT20260301 - 210100	20.414.693,01	4.738,41	-1.064,81	-0,04%	-128.289,48	217.445,50	3.566,80	-5.429,15
LFT20290301 - 210100	3.962.805,68	5.708,98	3.415,41	0,12%	-53.521,14	120.871,35	8.008,53	-12.161,72
LTN20260701 - 100000	23.189.256,82	449.134,35	445.633,87	15,86%	-1.380.414,85	1.232.703,36	1.725.709,91	-2.400.315,82
NTNB20260815 - 760199_NEGOCIACAO	4.674.990,52	81.844,00	77.324,32	2,75%	-131.621,88	145.735,18	103.100,74	-136.210,71
NTNB20500815 - 760199_NEGOCIACAO	6.767.112,42	418.836,49	389.001,05	13,85%	-707.123,63	1.148.304,72	862.479,24	-955.394,96
OMGE13	958.613,90	714,44	708,66	0,03%	-2.371,39	1.975,60	2.980,04	-4.114,34
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PALFA1	2.510.335,62	1.666,49	1.652,93	0,06%	-5.503,34	4.582,15	6.902,68	-9.544,83
PRLG14	1.154.163,44	0,80	-0,37	0,00%	-7,08	7,25	21,18	-32,00
SBSPC7	2.453.956,05	1.494,23	1.488,10	0,05%	-5.084,21	4.175,45	6.367,10	-8.991,48
SMFT16	3.390.521,72	2.877,73	2.858,43	0,10%	-9.616,08	7.976,59	12.076,75	-16.806,30
VAMO22	1.071.353,76	151,76	151,39	0,01%	-588,18	478,99	781,96	-1.134,90
WDOV23	300.456,01	0,00	0,00	0,00%	35.780,24	-35.843,96	44.263,54	-44.598,07
WDOX23	-353.665,12	16.555,80	9.841,13	0,35%	-39.194,28	39.858,07	-51.109,93	51.363,52
Total Var:	637.174.347,88	6.423.362,09	2.809.192,75	100,00%	-8.146.395,10	8.299.828,38	10.526.601,94	-15.465.442,04

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2023



Relatório de Risco de Mercado

Data: 29/09/2023

FUNDO: FIM EMB II A
CNPJ: 20725957000102

Dados Gerais							
PL:	194.424.108,01	VAR / PL:	0,5065%	Limite Fundo:	0,00%	Duration DC:	753,07
VAR:	984.799,47	ETL / PL:	0,6352%	Status:	ENQUADRADO	Duration DU:	516,44
ETL:	1.234.978,27	VAR / CDI:	0,0056%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	3.692.261,28	Cenário Baixa - 10000 (+):	5.702.038,47	CENARIO BRADESCO 1 (+):	7.414.715,46	CENARIO BRADESCO 2 (+):	6.317.784,34
Cenário Alta - 09999 (-):	(5.884.746,75)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(3.346.952,22)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(5.489.333,94)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(8.947.819,12)
Cenário Alta - 09999:	(2.192.485,47)	Cenário Baixa - 10000:	2.355.086,24	CENARIO BRADESCO 1:	1.925.381,51	CENARIO BRADESCO 2:	(2.630.034,78)

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
CAIXA	9.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CD323RSITI	6.178.334,95	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	578.230,65	8,86	-2,69	0,00%	-16,24	16,56	69,93	-106,44
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-23.723,39	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPGT16	147.156,20	32,18	-30,78	0,00%	181,98	-147,60	-267,05	401,92
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DHF24	12,52	127,83	-13,88	0,00%	-1.277,24	1.311,75	3.546,20	-5.348,93
DHF25	9.157,43	42.089,82	40.511,03	4,11%	-162.090,27	128.719,69	206.467,29	-301.502,76
DHF26	17.495,17	73.733,66	70.124,98	7,12%	-237.169,86	192.329,86	281.168,80	-397.859,44
DHF27	783,15	3.396,51	3.171,49	0,32%	-10.511,71	8.793,96	12.759,44	-17.449,37
DHF29	1.307,70	6.340,16	5.642,73	0,57%	-19.957,06	17.538,50	26.412,46	-33.591,98
DHF33	866,33	4.690,07	3.881,09	0,39%	-14.289,05	13.411,91	21.511,55	-23.632,24
DHJ24	38,41	169,38	159,14	0,02%	-1.471,00	1.286,79	2.654,74	-3.970,91
DHJ25	-34.504,80	153.750,26	-152.656,89	-15,50%	555.018,42	-448.702,43	-700.604,65	1.015.470,68
DHN24	104,72	420,35	401,08	0,04%	-2.495,47	2.057,97	3.791,78	-5.626,18
DHN25	-155.982,92	678.009,65	-650.198,41	-6,02%	2.301.555,65	-1.849.125,01	-2.793.791,20	4.018.834,89
DHN26	-52.637,49	226.573,36	-213.622,79	-21,69%	704.636,61	-580.684,90	-843.682,70	1.174.337,50
DHN27	415,07	1.829,51	1.690,62	0,17%	-5.699,68	4.828,20	7.086,85	-9.522,11
DHV23	-0,05	1,53	-0,47	0,00%	-2,81	2,86	12,09	-18,40
DHV24	94,08	411,44	395,50	0,04%	-1.851,21	1.459,06	2.443,69	-3.596,59
DHV25	267,35	1.102,97	1.054,72	0,11%	-3.639,27	2.931,75	4.329,11	-6.175,71
ERDV18	1.414.468,33	0,53	-0,26	0,00%	-2,38	2,41	10,05	-15,27
IDIF24P381200	-57.426,06	34.594,60	3.755,53	0,38%	57.426,06	-404.891,79	-1.099.938,99	57.426,06
IDIF24P381300	96.165,60	36.766,07	-3.991,26	-0,41%	-96.165,58	405.916,25	1.101.145,78	-96.165,60
INDV23	2.436,00	16.474,86	7.652,27	0,78%	63.442,56	-63.400,50	50.969,36	-51.313,30
LF002306J15	10.259.248,90	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306SWQ	10.269.686,73	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306U55	6.164.638,73	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20250901 - 210100	110.943,03	31,46	-12,76	0,00%	-606,04	875,58	1,74	-2,65
LFT20260301 - 210100	4.573.556,48	1.061,56	-288,47	-0,03%	-28.741,03	48.714,88	799,08	-1.216,31
LFT20260901 - 210100	1.841.236,02	520,31	-22,73	0,00%	-12.208,89	25.540,60	845,10	-1.285,89
LTN20250401 - 100000	17.852.307,87	160.171,93	153.255,53	15,56%	-569.186,79	459.369,00	711.865,91	-1.031.598,82
LTN20250701 - 100000	60.877.413,18	661.695,86	631.094,87	64,08%	-2.288.785,72	1.873.360,90	2.805.746,75	-4.035.624,46
LTN20260701 - 100000	11.708.312,35	226.769,03	213.204,89	21,66%	-696.974,83	622.394,93	871.315,14	-1.211.925,32
NTNB20240815 - 760199_NEGOCIACAO	12.814.636,10	20.811,80	8.938,40	0,91%	-160.073,98	162.234,00	101.529,01	-136.491,15
NTNB20250515 - 760199_NEGOCIACAO	11.603.450,61	82.187,86	81.451,71	8,27%	-228.245,17	224.484,99	149.500,96	-199.734,04
NTNB20260815 - 760199_NEGOCIACAO	21.269.519,14	372.360,65	370.240,16	37,60%	-598.832,01	663.042,44	468.071,14	-619.709,55
NTNB20270515 - 760199_NEGOCIACAO	5.292.006,36	105.530,54	104.990,97	10,66%	-172.871,98	198.812,13	142.129,83	-186.526,08
NTNB20280815 - 760199_NEGOCIACAO	12.246.974,50	313.039,50	311.676,73	31,66%	-508.138,95	579.201,01	437.531,67	-567.809,64
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
WINV23	-2.436,00	16.474,86	-7.652,27	-0,78%	-63.442,56	63.400,50	-50.969,36	51.313,30
Total Var:	195.012.852,82	3.246.196,96	984.799,47	100,00%	-2.192.485,47	2.355.086,24	1.925.381,52	-2.630.034,78

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2023



Relatório de Risco de Mercado

Data: 29/09/2023

FUNDO: FIM EMB III A IMOBILIÁRIO
CNPJ: 32711990000162

Dados Gerais					
PL:	68.302.867,36	VAR / PL:	2,3929%	Limite Fundo:	0,00%
VAR:	1.634.432,46	ETL / PL:	3,0008%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	2.049.644,24	VAR / CDI:	0,0267%	Benchmark:	Dutacion DU:
					Dutacion DC: 3,00

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	35.680.353,75	Cenário Baixa - 10000 (+):	10,77	CENARIO BRADESCO 1 (+):	8.565.927,02
Cenário Alta - 09999 (-):	(10,56)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(35.680.355,91)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-
Cenário Alta - 09999:	35.680.343,19	Cenário Baixa - 10000:	(35.680.345,14)	CENARIO BRADESCO 1:	8.565.927,02
				CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	(8.636.067,11)
				CENARIO BRADESCO 2:	(8.636.067,11)

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
AIEC11	2.380.277,15	204.471,43	180.086,85	11,02%	1.190.138,58	-1.190.138,58	348.948,83	-351.804,96
BMLC11	3.221.222,00	127.701,23	-3.764,67	-0,23%	3.221.222,00	-3.221.222,00	472.231,15	-476.096,61
BPML11	1.769.477,00	228.401,97	-113.948,76	-6,97%	1.769.477,00	-1.769.477,00	259.405,33	-261.528,70
BTLG11	2.986.231,50	81.886,77	34.630,46	2,12%	0,00	0,00	0,00	0,00
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CEOC11	689.954,50	121.441,04	79.453,38	4,86%	344.977,25	-344.977,25	101.147,33	-101.975,28
CNES11	351.387,30	71.576,05	41.471,85	2,54%	175.693,65	-175.693,65	51.513,38	-51.935,04
COMPROMISSADA_PRE	375.920,64	5,76	-2,43	0,00%	-10,56	10,77	45,47	-69,20
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-443.075,42	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
FVPR11	1.265.589,55	128.899,82	94.613,91	5,79%	632.794,78	-632.794,78	185.532,50	-187.051,18
GALG11	1.927.341,30	47.651,75	36.303,70	2,22%	963.670,65	-963.670,65	282.548,24	-284.861,04
HBRH11	3.583.510,42	77.131,61	-7.636,57	-0,46%	3.583.510,42	-3.583.510,42	525.342,63	-529.642,84
HSLG11	931.443,87	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
MALL11	4.500.465,60	210.094,36	164.531,56	10,07%	2.250.232,80	-2.250.232,80	659.768,26	-665.168,82
MAXR11	1.627.065,00	59.492,66	16.141,89	0,99%	813.530,34	-813.532,50	238.527,73	-240.480,21
NEWL11	1.420.416,00	175.981,48	132.864,49	8,13%	710.208,00	-710.208,00	208.232,99	-209.937,49
NEWU11	914.734,08	21.310,91	11.707,91	0,72%	914.734,08	-914.734,08	134.100,02	-135.197,70
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PATC11	6.299.685,00	463.730,43	-149.536,79	-9,15%	3.149.842,50	-3.149.842,50	923.533,82	-931.093,44
QAGR11	5.466.927,60	209.079,67	131.299,52	8,03%	2.733.463,80	-2.733.463,80	801.451,69	-808.011,90
RBRL11	3.441.471,20	247.086,60	181.540,13	11,11%	3.441.471,20	-3.441.471,20	504.519,68	-508.649,44
RGRB11	6.160.308,00	321.731,55	286.892,66	17,55%	0,00	0,00	0,00	0,00
RNGO11	35.303,64	1.891,81	1.496,02	0,09%	17.651,82	-17.651,82	5.175,51	-5.217,88
TEPP11	5.778.367,56	205.600,87	169.917,09	10,40%	2.889.183,78	-2.889.183,78	847.108,68	-854.042,73
TRXF11	8.089.380,60	304.629,52	257.590,02	15,76%	4.044.690,30	-4.044.690,30	1.185.903,20	-1.195.610,45
XPIN11	3.687.938,00	158.078,80	102.180,65	6,25%	1.843.969,00	-1.843.969,00	540.651,71	-545.077,24
XPLG13	113,40	3,90	3,26	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
XPPR11	1.979.803,62	73.982,16	-13.503,68	-0,83%	989.901,81	-989.901,81	290.239,21	-292.614,98
Total Var:	68.442.239,11	3.541.862,16	1.634.432,46	100,01%	35.680.343,19	-35.680.345,15	8.565.927,03	-8.636.067,11

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2023



Relatório de Risco de Mercado

Data: 29/09/2023

FUNDO:	FIA RVA EMB II
CNPJ:	13294268000125

Dados Gerais			
PL:	206.831.464,47	VAR / PL:	4,3507%
VAR:	8.998.628,44	ETL / PL:	5,4560%
ETL:	11.284.643,10	VAR / CDI:	0,0485%
Limite Fundo:		Status:	ENQUADRADO
Benchmark:		Dutacion DC:	0,00%
		Dutacion DU:	3,00

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	53.269.711,11	Cenário Baixa - 10000 (+):	111,38	CENARIO BRADESCO 1 (+):	29.551.209,91
Cenário Alta - 09999 (-):	(109,22)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(53.592.650,56)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-
Cenário Alta - 09999:	53.269.601,89	Cenário Baixa - 10000:	(53.592.539,17)	CENARIO BRADESCO 1:	29.551.209,91
				CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	(29.793.344,19)
				CENARIO BRADESCO 2:	(29.793.344,19)

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
ABEV3	4.086.452,55	231.588,65	151.602,30	1,80%	572.103,36	-1.225.935,77	599.073,94	-603.977,69
B3SA3	6.195.745,41	707.631,05	543.182,22	6,04%	1.548.936,35	-1.548.936,35	908.296,28	-915.731,17
BBSA3	6.675.970,00	387.072,41	197.297,31	2,19%	1.668.992,50	-1.668.992,50	978.697,20	-986.708,37
BBDC4	6.230.224,00	443.675,74	400.893,30	4,46%	1.557.556,00	-1.557.556,00	913.350,84	-920.827,11
BBSB3	1.563.621,00	68.211,69	-9.798,25	-0,11%	312.724,20	-312.724,20	229.226,84	-231.103,18
BPAC11	6.502.951,00	849.425,47	695.524,37	7,73%	1.950.885,30	-2.276.032,85	953.332,62	-961.136,16
BRFS3	2.456.859,95	376.465,47	-36.382,99	-0,40%	614.190,88	-614.214,99	360.175,67	-363.123,90
CAIXA	10.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	3.889.403,97	59,57	-40,65	0,00%	-109,22	111,38	470,40	-715,96
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	16.244.340,82	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPFE3	2.174.567,00	147.954,89	105.146,23	1,17%	434.913,40	-434.913,40	316.791,52	-321.401,00
CPLE5	2.700.544,00	149.715,46	38.764,52	0,43%	594.119,68	-594.119,68	395.899,75	-399.140,40
CXSE3	2.051.208,00	119.658,33	11.207,52	0,12%	410.241,60	-410.241,60	300.707,09	-303.165,54
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ECOR3	1.931.904,00	328.541,33	148.244,62	1,65%	482.976,00	-482.976,00	283.217,13	-285.535,41
EGIE3	1.508.052,00	90.587,61	53.724,39	0,60%	271.449,36	-271.449,36	221.080,42	-222.890,09
ELET3	5.265.014,58	407.386,46	323.059,55	3,59%	1.579.504,37	-1.579.504,37	771.851,14	-778.169,16
ELET6	2.953.620,00	246.246,65	186.924,76	2,08%	886.086,00	-886.086,00	433.000,69	-436.545,04
ENEV3	1.584.684,00	158.328,39	80.547,20	0,90%	586.333,08	-808.188,84	232.314,67	-234.216,30
ENG11	551.650,00	41.690,94	32.764,55	0,36%	93.780,50	-121.363,00	80.871,89	-81.533,87
EQTL3	6.094.606,00	489.588,24	409.455,55	4,55%	1.218.921,20	-1.218.921,20	893.469,24	-900.782,77
GMAT3	1.874.160,00	226.108,86	175.729,54	1,95%	337.321,40	-299.893,00	274.751,86	-277.000,85
GOAU4	2.358.225,00	262.466,89	200.779,49	2,23%	707.467,50	-588.556,25	345.715,79	-348.545,86
HAPV3	2.162.413,60	348.237,60	117.369,73	1,30%	735.220,62	-735.220,62	317.009,83	-319.604,73
INDV23	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ITSA4	3.961.565,10	287.946,80	230.162,77	2,56%	752.697,37	-752.697,37	580.765,44	-585.519,32
ITUB4	16.161.025,77	808.357,46	725.640,75	8,06%	3.232.205,15	-3.070.594,90	2.369.206,38	-2.388.599,61
KLBN11	1.088.117,00	58.465,06	-3.692,46	-0,04%	272.029,25	-217.627,97	159.517,95	-160.823,69
LREN3	2.309.490,00	363.361,19	199.956,04	2,22%	461.880,77	-461.898,00	338.571,23	-341.342,62
MRFG3	1.072.352,00	90.670,78	26.704,56	0,30%	428.940,80	-321.705,60	157.206,80	-158.493,63
MRVE3	1.972.818,98	521.771,29	333.516,48	3,71%	591.845,69	-591.845,69	289.215,26	-291.582,65
MULT3	658.476,00	43.365,22	22.440,73	0,25%	203.814,00	-161.001,00	96.532,58	-97.322,75
ONCO3	2.214.482,00	250.840,06	61.410,65	0,68%	775.072,20	-775.072,20	324.644,63	-327.301,92
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PETR3	8.532.828,00	644.222,19	188.738,68	2,10%	2.133.207,00	-2.559.848,40	1.260.912,69	-1.261.151,98
PETRA	19.071.363,76	1.316.316,16	336.377,47	3,74%	4.767.840,94	-5.721.464,18	2.795.861,93	-2.818.747,56
PRI03	5.903.520,00	685.994,33	427.334,34	4,75%	3.542.112,00	-3.542.112,00	865.456,03	-872.540,26
RADL3	4.120.793,52	164.372,90	104.157,87	1,16%	824.158,70	-824.158,70	604.108,33	-609.053,26
RAIL3	3.674.020,00	251.487,95	197.839,98	2,20%	1.653.309,00	-1.212.426,60	538.611,33	-543.020,16
RDOR3	1.854.930,00	338.540,78	266.157,95	2,96%	556.479,00	-556.479,00	271.932,74	-274.158,65
RENT1	15.504,00	6.366,83	2.219,33	0,02%	0,00	0,00	0,00	0,00
RENT3	7.109.184,00	731.207,92	486.207,43	5,40%	2.415.362,26	-1.809.819,06	1.042.206,37	-1.050.737,40
SBSB3	2.929.440,00	166.814,60	-9.635,64	-0,11%	732.360,00	-732.360,00	429.455,90	-432.971,23
STBP3	922.132,00	61.552,32	48.248,84	0,54%	322.746,20	-322.746,20	136.184,65	-136.291,11
SUZB3	4.868.916,00	414.906,31	-148.680,28	-1,66%	1.217.229,00	-973.763,20	713.763,09	-719.626,79
TIMS3	1.215.024,00	51.260,51	-7.125,95	-0,08%	388.807,68	-279.455,52	173.122,52	-179.580,55
TOTS3	2.313.441,00	160.149,22	111.234,88	1,24%	462.698,20	-462.698,20	339.150,45	-341.926,58
UGPA3	1.366.875,00	76.642,17	57.798,22	0,64%	341.718,75	-273.375,00	200.383,88	-202.024,13
VALE3	33.269.296,10	3.670.385,32	1.102.905,26	12,26%	8.317.324,03	-8.317.324,03	4.877.278,81	-4.917.201,96
VBRB3	2.277.968,00	200.325,44	-9.831,72	-0,11%	569.492,00	-569.492,00	333.950,11	-336.683,67
WEGE3	3.663.270,00	409.629,47	154.606,59	1,72%	915.817,50	-915.817,50	537.035,38	-541.431,31
YDUQ3	2.120.129,00	518.221,75	257.940,41	2,87%	826.850,31	-530.032,25	310.810,91	-313.355,07
Total Var:	221.733.188,11	18.423.517,73	8.998.628,44	100,03%	53.269.601,89	-53.592.539,17	29.551.209,91	-29.793.344,19

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2023



Relatório de Risco de Mercado

Data: 29/09/2023

FUNDO:	FIA RVA EMB III
CNPJ:	38452593000108

Dados Gerais			
PL:	103.046.210,09	VAR / PL:	5,8798%
VAR:	6.058.941,37	ETL / PL:	7,3735%
ETL:	7.598.156,91	VAR / CDI:	0,0656%
Limite Fundo:		Status:	ENQUADRADO
Benchmark:		Dutacion DC:	0,00%
		Dutacion DU:	3,00

Cenários de STRESS			
Cenário Alta - 09999 (+):	29.334.150,53	Cenário Baixa - 10000 (+):	700.471,60
Cenário Alta - 09999 (-):	(688.805,77)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(28.424.876,18)
Cenário Alta - 09999:	28.645.344,76	Cenário Baixa - 10000:	(27.724.404,58)
CENARIO BRADESCO 1 (+):	14.583.690,75	CENARIO BRADESCO 2 (+):	902.530,49
CENARIO BRADESCO 1 (-):	(898.074,45)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(14.703.301,46)
CENARIO BRADESCO 1:	13.685.616,30	CENARIO BRADESCO 2:	(13.800.770,97)

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
ALSO3	2.569.702,86	256.232,37	240.317,17	3,97%	899.396,00	-542.425,72	378.718,44	-379.802,09
ASAJ3	2.311.616,00	327.588,72	222.272,90	3,67%	647.252,48	-601.020,16	338.882,91	-341.656,85
AURE3	3.557.346,89	136.248,33	29.729,43	0,49%	889.336,72	-1.102.803,45	521.507,05	-525.775,87
BBAS3	3.469.900,28	201.184,65	103.303,70	1,70%	867.475,07	-867.475,07	508.687,38	-512.851,26
BBSE3	2.350.113,00	102.521,77	-39.224,91	-0,65%	470.022,60	-470.022,60	344.526,67	-347.346,70
BPAC11	3.086.990,92	403.227,51	379.904,98	6,27%	926.097,28	-1.080.446,82	452.552,87	-456.257,26
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CIEL3	3.091.608,00	319.644,51	167.561,82	2,77%	927.482,40	-772.902,00	453.229,73	-456.939,66
COMPROMISSADA_PRE	3.786.961,38	58,00	-31,67	0,00%	-106,34	108,45	458,01	-697,10
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-256.666,03	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DOLX23	24.535,44	283.813,76	217.469,16	3,59%	-671.901,88	683.281,13	-876.170,20	880.517,55
ELET3	8.999.499,95	696.346,49	441.225,08	7,28%	2.699.849,99	-2.699.849,99	1.319.326,69	-1.330.126,09
ENAT3	739.800,00	126.218,42	-58.504,01	-0,97%	258.930,00	-258.930,00	108.454,68	-109.342,44
ENEV3	4.607.667,72	460.359,67	361.516,52	5,97%	1.704.837,06	-2.349.910,54	675.484,09	-681.013,29
ENJ3	162.112,00	43.400,71	29.632,48	0,49%	72.950,40	-43.781,12	23.765,62	-23.960,15
EQTL3	8.898.092,70	714.796,25	537.349,17	8,87%	1.779.618,54	-1.779.618,54	1.304.460,39	-1.315.138,10
FLRY3	2.199.780,00	116.545,37	50.503,62	0,83%	439.956,00	-439.956,00	322.487,75	-325.127,48
HAPV3	730.055,70	117.569,02	78.839,39	1,30%	248.218,94	-248.218,94	107.026,17	-107.902,23
IGT11	6.472.041,75	375.755,33	344.132,45	5,68%	1.294.408,35	-1.294.408,35	948.801,32	-956.567,77
ITUB4	9.523.581,63	476.359,50	362.399,81	5,98%	1.904.716,33	-1.809.480,51	1.396.157,07	-1.407.585,37
LRENS	3.546.671,80	558.011,89	438.038,56	7,23%	709.307,89	-709.334,36	519.942,09	-524.198,09
LWSA3	114.630,21	13.931,29	3.386,32	0,06%	46.862,06	-46.862,06	16.904,79	-16.942,35
NTCO3	2.220.632,96	386.700,26	269.395,57	4,45%	555.153,24	-555.153,24	325.544,79	-328.209,55
ONCO3	865.592,00	98.047,38	40.882,86	0,67%	302.957,20	-302.957,20	126.895,79	-127.934,50
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PETRA	796.720,00	54.990,06	87,07	0,00%	199.180,00	-239.018,30	116.799,15	-117.755,22
PRI03	2.996.448,00	348.189,95	282.747,23	4,67%	1.797.868,80	-1.797.868,80	439.279,28	-442.875,01
RAIL3	4.449.900,00	304.597,21	218.488,09	3,61%	2.002.455,00	-1.468.467,00	652.355,34	-657.695,22
RECV3	3.336.977,46	718.150,52	552.693,18	9,12%	2.002.186,48	-2.002.186,48	489.200,90	-493.205,27
RENT1	12.416,00	5.098,72	1.852,93	0,03%	0,00	0,00	0,00	0,00
RENT3	6.339.295,68	652.021,83	563.992,88	9,31%	2.153.790,86	-1.613.824,90	929.340,75	-936.947,90
SBSFP3	988.686,00	56.299,93	-10.438,89	-0,17%	247.171,50	-247.171,50	144.941,37	-146.127,79
SCAR3	164.500,00	16.816,20	7.966,39	0,13%	92.746,00	-92.746,00	22.661,43	-22.846,92
SMFT3	3.139.000,00	524.829,08	446.765,66	7,37%	1.255.800,00	-1.255.800,00	460.177,40	-463.944,20
SUZB3	6.117.735,96	520.947,97	-187.993,32	-3,10%	1.529.433,99	-1.223.547,19	896.860,09	-904.201,38
YBBR3	1.639.569,36	144.184,41	-42.748,98	-0,71%	409.892,34	-409.892,34	240.360,87	-242.328,35
WDOX23	613,39	7.095,34	5.436,73	0,09%	-16.797,55	17.082,03	-21.904,26	22.012,94
Total Var:	103.046.209,01	9.566.782,40	6.058.941,37	100,00%	28.645.344,77	-27.724.404,58	13.685.616,31	-13.800.770,97

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2023



Relatório de Risco de Mercado

Data: 29/09/2023

FUNDO:	FIA RVA EMB IV
CNPJ:	38452613000132

Dados Gerais					
PL:	98.537.027,27	VAR / PL:	5,7010%	Limite Fundo:	0,00%
VAR:	5.617.638,50	ETL / PL:	7,1493%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	7.044.745,31	VAR / CDI:	0,0636%	Benchmark:	
				Dutacion DC:	3,00
				Dutacion DU:	1,00

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	27.753.514,31	Cenário Baixa - 10000 (+):	262,21	CENARIO BRADESCO 1 (+):	13.212.263,60
Cenário Alta - 09999 (-):	(257,12)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(25.283.208,92)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-
Cenário Alta - 09999:	27.753.257,19	Cenário Baixa - 10000:	(25.282.946,71)	CENARIO BRADESCO 1:	13.212.263,60
				CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	(13.320.982,12)
				CENARIO BRADESCO 2:	(13.320.982,12)

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

Produto	MiM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
ALSO3	2.595.929,85	257.837,33	243.301,45	4,33%	908.575,45	-648.982,46	380.563,32	-383.678,43
AURES	2.630.434,59	100.747,08	30.874,22	0,55%	657.808,65	-815.453,88	385.621,71	-388.776,23
CAKA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	9.156.468,42	140,24	-82,03	0,00%	-257,12	262,21	1.107,43	-1.685,51
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-749.823,49	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPLE3	2.211.712,26	172.839,15	106.855,36	1,90%	486.576,70	-486.576,70	324.237,02	-326.891,07
CPLE6	774.977,28	42.963,97	20.594,30	0,37%	170.495,00	-170.495,00	113.611,67	-114.541,64
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ELET3	3.167.744,30	245.107,80	164.228,98	2,92%	950.323,29	-950.323,29	464.391,31	-468.192,61
ELET6	500.380,35	41.717,28	28.865,42	0,51%	150.114,11	-150.114,11	73.355,76	-73.956,22
ENGH1	4.506.980,50	340.615,00	277.115,13	4,93%	766.186,69	-991.535,71	660.723,34	-666.131,72
EQTL3	9.888.009,32	794.317,64	652.671,25	11,62%	1.977.601,86	-1.977.601,86	1.449.582,17	-1.461.447,78
GGPS3	7.348.003,02	945.600,74	731.326,28	13,02%	3.306.601,36	-3.306.601,36	1.077.217,24	-1.086.034,85
GMAT3	6.703.131,60	808.702,29	735.678,75	13,10%	1.206.465,69	-1.072.599,06	982.679,09	-990.722,85
MAPV3	2.711.129,20	436.603,40	246.966,46	4,40%	921.783,93	-821.783,93	397.461,64	-400.704,90
IGTI11	1.021.835,25	59.325,95	52.399,32	0,93%	204.367,05	-204.367,05	149.801,05	-151.027,25
ITUB4	6.805.792,41	340.418,55	277.159,62	4,93%	1.361.158,48	-1.293.100,56	997.729,17	-1.005.896,12
MATD3	1.331.526,30	200.455,77	124.034,86	2,21%	399.457,89	-399.457,89	195.201,76	-196.799,59
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PRI03	5.403.390,72	627.878,86	493.789,31	8,79%	3.242.034,43	-3.242.034,43	792.137,08	-798.621,15
RAIL3	12.200.667,36	835.139,94	633.833,38	11,28%	5.490.300,31	-4.026.220,23	1.788.617,84	-1.803.258,64
RENT1	12.352,00	5.072,44	1.975,41	0,04%	0,00	0,00	0,00	0,00
RENT3	5.292.535,68	544.358,40	464.633,07	8,27%	1.798.151,65	-1.347.346,19	775.885,73	-782.236,77
UGPA3	9.541.931,25	535.026,50	440.989,25	7,85%	2.385.482,81	-1.908.386,25	1.398.847,12	-1.410.297,44
VBR3	5.480.915,98	481.994,00	-109.571,31	-1,95%	1.370.228,97	-1.370.228,97	803.502,27	-810.079,37
Total Var:	98.537.024,05	7.616.862,31	5.617.638,50	100,00%	27.753.257,19	-25.282.946,71	13.212.263,61	-13.320.982,12



Relatório de Risco de Mercado

Data: 29/09/2023

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

Dados Gerais					
PL:	106.706.713,76	VAR / PL:	4,4442%	Limite Fundo:	0,00%
VAR:	4.742.239,19	ETL / PL:	5,5732%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	5.946.959,27	VAR / CDI:	0,0496%	Benchmark:	
				Dutacion DC:	10,71
				Dutacion DU:	6,29

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	27.715.056,97	Cenário Baixa - 10000 (+):	8.847,15	CENARIO BRADESCO 1 (+):	15.480.876,43
Cenário Alta - 09999 (-):	(6.277,66)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(28.024.831,63)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(1,52)
Cenário Alta - 09999:	27.708.779,31	Cenário Baixa - 10000:	(28.015.984,48)	CENARIO BRADESCO 1:	15.480.874,90
				CENARIO BRADESCO 2 (+):	2,32
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	(15.606.991,47)
				CENARIO BRADESCO 2:	(15.606.989,15)

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
TAE11	379.123,20	11.444,35	3.132,84	0,07%	94.789,80	-94.789,80	55.579,46	-56.034,41
TIMS3	603.744,83	25.471,32	-2.881,58	-0,06%	193.198,35	-138.861,31	88.508,99	-89.233,49
TOTS3	696.681,00	48.228,12	32.294,80	0,68%	139.336,20	-139.336,20	102.133,44	-102.969,45
UGPA3	1.022.343,75	57.323,93	43.723,23	0,92%	255.585,94	-204.468,75	149.875,59	-151.102,41
USIM5	171.663,92	7.658,01	5.083,61	0,11%	66.948,93	-37.766,06	25.165,93	-25.371,93
VALE3	15.015.667,78	1.656.581,09	460.784,60	9,72%	3.753.916,95	-3.753.916,95	2.201.296,90	-2.219.315,70
VAMO3	206.202,75	32.197,37	4.640,70	0,10%	72.170,96	-82.481,10	30.229,32	-30.476,77
VBBR3	1.058.214,52	93.059,82	-8.950,60	-0,19%	264.553,63	-264.553,63	155.134,25	-156.404,11
VIVT3	916.884,12	52.540,45	3.121,19	0,07%	137.530,50	-137.534,74	134.415,21	-135.515,47
WEGE3	2.697.000,93	301.590,57	124.667,76	2,63%	674.250,23	-674.250,23	395.360,34	-398.616,74
YDUQ3	288.552,14	70.530,61	35.947,29	0,76%	112.535,34	-72.138,04	42.301,74	-42.645,01
Total Var:	106.705.843,82	9.848.495,76	4.742.239,19	99,99%	27.708.779,31	-28.015.984,48	15.480.874,91	-15.606.989,15

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

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2023



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

30/09/2023

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	18/05/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	1.318.404,71	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	487.748,82	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	292.649,29	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	20/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	975.059,47	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	25/08/17	25/08/17	15/08/24	PETR	9.041.365,78	AAA	Aaa.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	18/12/17	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	3.310.929,74	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	21/12/17	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	966.413,09	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/01/18	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	3.436.168,99	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB II	19/02/18	19/02/18	15/02/25	SABESP	9.651.322,88	brAAA	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/02/18	19/02/18	15/02/25	SABESP	5.989.700,16	brAAA	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	13/03/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	13.078.157,19	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB II	23/05/18	23/05/18	15/05/28	COMGAS	25.926.699,59	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	643.849,52	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	643.849,52	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	643.849,52	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	642.574,44	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	643.849,52	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	04/07/18	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	12.259.225,24	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/07/18	26/07/18	15/07/25	AEGEA SA	14.131.926,62	brA	Aa1.br	AA(bra)
FI RF EMB II	26/07/18	26/07/18	15/07/25	CSMG	10.564.491,87	-	Aa3.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/02/13	15/02/25	CEMIG	1.361.782,08	brA+	A1.br	AA-(bra)
FIM EMB I A	12/02/19	09/01/19	15/01/25	ITAUUBB	2.721.955,93	-	AAA.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	560.394,12	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	3.548.264,69	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	2.020.651,87	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	6.109.104,17	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	706.819,15	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	5.718.809,50	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	8.481.829,83	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	873.885,50	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	612.931,06	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	30/09/20	28/09/20	22/09/25	HAPVIDA	170.231,64	-	-	AAA(bra)
FIM EMB II A	08/01/21	22/05/19	15/04/24	ECORODOV	1.405.237,91	-	-	AA(bra)
FIM EMB II A	05/02/21	07/08/19	15/07/24	COPEL GT	146.270,00	-	-	AA+(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	6.356.592,66	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	6.369.460,94	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	4.305.703,00	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/07/19	15/06/29	NEOENERG	608.390,89	brAA+	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/07/19	15/06/29	NEOENERG	6.047.709,10	brAA+	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	1.782.972,97	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	3.417.303,93	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	3.656.173,97	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	31/07/20	15/07/34	IGUA SAN	2.629.106,86	brAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	23/05/18	15/05/28	COMGAS	22.581.319,00	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	491.635,42	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	865.278,34	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	983.270,84	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	491.635,42	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	601.761,75	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	507.112,38	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	1.471.312,51	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	26/10/16	27/01/25	BRADESCO	14.076.872,13	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	12/12/17	15/11/24	CCR	6.295.998,13	brAAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	14/12/17	15/11/24	ECORODOV	4.317.271,22	brAA	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	19/02/18	15/02/25	SABESP	1.406.693,32	brAAA	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	23/05/18	15/05/28	COMGAS	10.036.141,78	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	28/06/18	15/06/27	JAGUARA	1.810.205,17	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	28/06/18	15/06/27	ENERGMIR	1.133.373,09	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	31/07/18	01/08/25	BRADESCO	4.550.211,47	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB I A	28/05/21	28/05/21	28/11/23	B.ALFA	1.261.560,85	-	Aa1.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	176.985,65	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	212.420,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	22/12/20	15/12/26	IRB	2.645.395,32	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	104.000,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	896.123,70	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	48.750,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	10/02/21	15/12/31	METRRORIO	1.467.904,70	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	07/04/21	15/03/31	LOCALIZA	5.249.217,60	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	1.600.471,50	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/06/21	06/01/21	15/11/25	QUATA	1.113.948,26	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	708.500,20	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	19.083,39	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	443.860,71	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	515.251,53	-	-	AAA(bra)

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2023



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

30/09/2023

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	520.842,80	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	520.842,80	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	360.190,29	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	732.094,08	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	721.112,67	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	1.802.725,05	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	450.156,60	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	128.812,88	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	322.372,98	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	1.561.456,70	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	14/06/21	19/06/19	19/06/24	BNBBM	609.694,12	brAAA	AAbr	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	14/06/21	12/06/19	12/06/24	BNBBM	924.513,50	brAAA	AAbr	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	15/06/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	52.780,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	16/06/21	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	379.946,35	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	17/06/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	792.209,24	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	17/06/21	18/03/21	15/02/26	CORSAN	766.918,80	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	18/06/21	18/06/21	15/12/30	MG050	546.345,52	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	31.850,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	1.546.387,77	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	165.100,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	84.519,17	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	25/06/21	25/06/21	20/06/26	OURO VER	1.472.617,25	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	3.130.339,61	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	01/07/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	2.738.003,71	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/07/21	01/03/21	18/02/25	RENNER	1.118.486,54	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/07/21	01/03/21	18/02/25	RENNER	236.544,10	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/07/21	07/04/21	15/03/29	CAGECE	1.229.627,52	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	08/07/21	08/07/21	15/06/31	VAMOS	263.923,17	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/07/21	07/04/21	15/03/29	CAGECE	2.802.380,75	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/07/21	08/07/21	15/06/31	VAMOS	5.236.570,76	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	12/07/21	12/07/21	12/07/26	BRADESCO	4.102.556,42	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	2.077.846,41	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	220.417,72	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	1.009.239,69	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	190.060,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	524.804,64	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	167.700,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	245.960,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	122.980,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	1.854.549,07	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	289.909,02	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	4.155.692,83	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	369.826,58	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	369.826,58	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	1.318.512,14	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	888.507,51	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/07/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	2.920.171,29	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	19/07/21	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	608.751,89	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	210.340,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/07/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	2.021.458,23	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/07/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	740.726,53	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	11/06/18	15/05/25	INTERVIA	1.327.200,99	-	Aa2.br	-
FIM EMB I A	21/07/21	17/03/21	05/03/24	ENERG TR	1.279.208,01	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.133.652,72	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	895.398,03	-	-	AA-(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	20/09/19	20/08/26	VAMOS	1.041.643,68	brAA+	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	23/07/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.639.036,55	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/07/21	07/11/19	15/10/24	BKBR	1.061.178,72	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/07/21	23/12/20	15/12/26	RD COLIN	2.152.218,79	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	04/08/21	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	371.397,25	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	06/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	688.764,99	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	11/08/21	11/08/21	15/08/31	CSAN	1.030.251,50	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	11/08/21	19/11/19	15/06/27	AUTOPIST	1.222.373,04	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	17/08/21	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	2.694.872,43	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	18/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	1.277.570,04	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	18/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	991.383,40	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	27/08/21	27/08/21	20/08/31	S LUIZ A	1.009.451,85	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	673.070,13	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	60.274,94	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	301.374,69	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/06/19	15/06/24	PROLAGOS	1.139.408,54	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	12/05/21	15/04/26	ELETROB	2.086.734,72	brAAA	-	-

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2023



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

30/09/2023

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FIM EMB I A	16/09/21	22/10/19	21/10/26	AUTOBAN	657.858,83	brAAA	-	-
FIM EMB I A	17/09/21	04/10/18	01/10/24	EQUATENE	1.497.125,06	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/09/21	20/09/21	15/09/29	MOV_PART	1.042.261,29	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.092.691,04	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.092.691,04	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	1.089.669,14	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	814.215,05	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	814.215,05	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	270.671,49	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	270.671,49	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	772.249,94	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	772.249,94	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	992.347,54	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	385.488,85	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	385.488,85	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	23/09/21	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	4.127.514,44	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	23/09/21	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	4.182.938,37	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	24/09/21	05/04/21	15/03/24	CCPR	40.157,19	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	27/09/21	28/12/20	15/01/26	LOCAMERI	1.869.920,71	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	27/09/21	29/03/21	01/04/24	CNH	2.403.519,07	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	30/09/21	30/09/21	15/09/31	SIMPAR	854.422,45	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	04/10/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	676.441,16	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/10/21	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	5.922.416,12	-	-	AA-(bra)
FIM EMB I A	20/10/21	20/10/21	20/10/25	DAYCOVAL	2.685.993,19	brAA+	AA.br	AA(bra)
FIM EMB I A	20/10/21	20/10/21	20/10/24	DAYCOVAL	1.491.305,31	brAA+	AA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/10/21	22/10/21	15/12/35	CART	2.310.631,94	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	22/10/21	22/10/21	15/12/35	CART	867.895,90	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	25/10/21	22/04/21	15/03/26	VIX LOGI	168.230,14	-	-	A+(bra)
FIM EMB I A	27/10/21	27/10/21	15/10/29	CONT GLO	2.128.226,15	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/10/21	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	1.272.138,47	brAAA	-	-
FIM EMB I A	28/10/21	28/10/21	07/11/23	TOYOTA	2.806.283,54	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	04/11/21	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	3.360.260,83	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/11/21	10/11/21	15/10/28	LIGHT	353.083,57	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	12/11/21	12/11/21	15/10/31	VAMOS	2.193.659,06	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	18/11/21	18/11/21	15/10/31	HIDRO BR	4.170.194,26	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/11/21	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	11.932,97	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/11/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	2.198.431,47	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/11/21	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	2.322.155,97	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	03/12/21	11/06/21	11/06/24	BNBMM	610.239,93	brAAA	AAbr	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/12/21	06/12/21	15/12/35	TESC	2.694.618,92	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/12/21	06/01/21	15/11/25	QUATA	2.547.583,56	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/12/21	20/12/21	15/11/35	ORIZON	2.171.989,58	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/01/22	22/04/21	15/03/26	VIX LOGI	968.078,83	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/01/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.232.700,22	brAA	-	-
FIM EMB I A	19/01/22	19/01/22	19/01/24	BES INV	1.265.752,27	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/01/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	355.170,91	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/01/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	2.112.938,90	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	360.684,01	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	349.412,64	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	3.112.318,52	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	834.081,77	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	743.910,77	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	25/03/22	25/03/22	15/03/44	GBS PART	2.162.218,33	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/03/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	1.065.614,23	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	12/04/22	12/04/22	08/04/27	UNIGEL P	432.189,19	BB-	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	19/04/22	16/04/22	16/04/29	VERT-10	872.748,66	-	-	AAAstf(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/04/22	26/04/22	15/04/24	LIGHT	943.196,19	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	297.671,63	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.259.517,49	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	12/05/22	12/05/22	15/04/27	BRKA	1.983.174,94	-	A+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	12/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.509.811,95	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	19/05/22	19/05/22	13/05/28	CEA MODA	502.057,33	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/05/22	26/05/22	10/05/27	GUAR	2.472.838,01	-	-	A
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	2.532.648,61	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	570.021,71	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.161.187,52	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	03/03/22	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	3.156.647,79	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/03/22	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	2.498.036,67	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/03/22	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	1.029.559,58	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/03/22	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	3.243.388,02	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/03/22	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	2.596.100,30	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/06/22	06/12/21	15/12/35	TESC	838.607,86	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	456.017,37	-	-	AA+(bra)

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2023



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

30/09/2023

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	06/12/21	15/12/35	TESC	526.004,38	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	272.071,72	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	30/09/21	15/09/31	SIMPAR	1.839.256,75	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	08/07/21	15/06/31	VAMOS	898.595,54	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	08/07/21	15/06/31	VAMOS	73.311,99	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	744.836,54	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	842.258,68	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/06/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	1.296.373,83	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	27/06/22	27/06/22	07/07/24	LAGE	2.380.170,61	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	3.178.779,67	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	12/11/21	15/10/31	VAMOS	2.121.268,31	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	12/11/21	15/10/31	VAMOS	1.590.402,82	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	25/07/22	25/07/22	22/07/27	CM HOSPI	1.489.122,26	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/07/22	10/01/22	10/01/28	AMBIPAR	2.392.764,08	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/07/22	03/05/21	26/04/26	GGSH PAR	2.439.743,23	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	27/07/22	25/03/22	15/03/44	GBS PART	1.328.896,23	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/07/22	28/07/22	18/07/25	1V11	1.673.595,78	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	29/07/22	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	1.741.190,34	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/08/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	1.239,10	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	516.503,59	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	07/04/21	15/03/29	CAGECE	1.519.878,12	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	07/04/21	15/03/29	CAGECE	2.532.380,20	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/08/22	30/08/22	15/08/29	TRBR	5.815.401,63	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/09/22	02/09/22	02/09/29	AEGEA SA	1.695.389,23	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	27/09/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	53.281,17	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/09/22	28/09/22	28/09/27	B.BRASIL	4.264.300,93	-	AAA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	06/10/22	06/10/22	13/09/32	NTRASSUD	1.707.414,07	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/10/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	37.172,91	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	03/11/22	06/04/21	15/03/29	ANET	1.906.130,24	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	08/11/22	08/11/22	27/10/27	CM HOSPI	1.023.628,51	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/11/22	08/11/22	15/06/42	BRK AMBI	5.188.272,97	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/11/22	02/05/22	15/04/38	RDVE	1.717.805,20	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/11/22	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	1.586.175,75	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	11/11/22	11/11/22	15/10/40	RAHOLD	2.826.635,79	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	11/11/22	11/11/22	15/10/40	RAHOLD	10.482.245,47	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	3.799.170,82	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	1.710.200,76	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	1.400.298,61	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.392.864,14	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.695.519,20	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.388.525,00	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	01/12/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	1.687.321,97	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	2.112.332,41	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	2.240.851,86	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	1.634.503,71	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/12/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	3.147.659,87	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	15/12/21	15/11/36	ITAPOA T	1.190.239,47	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	02/05/22	15/04/38	RDVE	1.987.929,78	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	3.170.590,14	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/01/23	26/01/23	20/01/26	CELG	3.168.186,39	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/03/23	26/01/23	20/01/26	HAPVIDA	486.548,62	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	26/01/23	20/01/26	AESTUCAN	1.161.978,04	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	26/01/23	20/01/26	ITAPOA T	3.613.767,16	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	26/01/23	20/01/26	BRV_VDR	8.504.133,09	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/03/23	26/01/23	20/01/26	PARANAGU	984.193,58	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	14/04/23	26/01/23	20/01/26	PARANAGU	697.248,86	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	17/04/23	26/01/23	20/01/26	VERO	2.846.326,09	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/04/23	26/01/23	20/01/26	BRKA	1.177.739,53	-	A+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/04/23	26/01/23	20/01/26	BRKA	32.511,06	-	A+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/04/23	26/01/23	20/01/26	HOLDARAG	2.264.034,36	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	26/01/23	20/01/26	PAMPASUL	1.858.291,20	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	26/01/23	20/01/26	LOCAMERI	2.187.676,77	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	26/01/23	20/01/26	MG050	3.314.131,91	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	26/01/23	20/01/26	BRK AMBI	1.290.654,02	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	26/01/23	20/01/26	VAMOS	1.755.298,52	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	26/01/23	20/01/26	HOLDARAG	786.074,59	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	26/01/23	20/01/26	CART	1.487.821,54	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	26/01/23	20/01/26	HOLDARAG	2.417.528,22	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	26/01/23	20/01/26	BRKA	288.552,85	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	26/01/23	20/01/26	BRKA	2.754.269,52	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	26/01/23	20/01/26	CORSAN	1.552.510,06	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	26/01/23	20/01/26	CART	642.468,39	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	26/01/23	20/01/26	METRRORIO	5.403.313,39	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	26/01/23	20/01/26	HIDRO BR	2.646.469,44	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/05/23	26/01/23	20/01/26	HOLDARAG	223.263,79	brAAA	-	-

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2023



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

30/09/2023

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/05/23	26/01/23	20/01/26	BRK AMBI	2.257.807,89	-	AA-br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/05/23	26/01/23	20/01/26	CART	2.119.018,56	brAA+	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	26/01/23	20/01/26	RT BANDE	1.177.387,54	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	16/05/23	26/01/23	20/01/26	SABESP	2.356.033,27	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	26/01/23	20/01/26	CPFL	2.396.296,92	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	16/05/23	26/01/23	20/01/26	CACHOEIR	1.891.101,25	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	26/01/23	20/01/26	COELBA	1.903.539,53	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	26/01/23	20/01/26	LOCAMERI	2.993.093,28	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	26/01/23	20/01/26	SMARTIFI	3.194.539,03	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	18/05/23	26/01/23	20/01/26	UNIGEL P	108.716,73	BB-	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/05/23	26/01/23	20/01/26	UTE GNA	59.688,84	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/06/23	26/01/23	20/01/26	OURO VER	295.355,44	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/06/23	26/01/23	20/01/26	GBS PART	2.719.870,75	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/06/23	26/01/23	20/01/26	ASA BRAN	2.890.225,57	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	23/06/23	26/01/23	20/01/26	IGUA RJ	1.275.425,57	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/06/23	26/01/23	20/01/26	VAMOS	1.035.793,70	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/06/23	26/01/23	20/01/26	1V11	379.757,82	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/07/23	26/01/23	20/01/26	UTE GNA	1.498.853,18	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/07/23	26/01/23	20/01/26	RT BANDE	973.547,04	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/07/23	26/01/23	20/01/26	RT BANDE	973.547,04	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/07/23	26/01/23	20/01/26	UTE GNA	1.498.853,18	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/07/23	26/01/23	20/01/26	1V11	1.151.556,73	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/07/23	26/01/23	20/01/26	1V11	281.491,64	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/07/23	26/01/23	20/01/26	RD COLIN	1.603.593,27	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	26/01/23	20/01/26	ECORODOV	1.434.610,00	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	26/01/23	20/01/26	ECORODOV	1.434.610,00	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	26/01/23	20/01/26	ITAPOA T	2.338.593,69	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	26/01/23	20/01/26	ASA BRAN	2.844.834,52	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	01/08/23	26/01/23	20/01/26	TIMSA	2.578.714,25	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/23	26/01/23	20/01/26	VERO	1.256.523,59	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/23	26/01/23	20/01/26	TESC	1.969.055,87	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/23	26/01/23	20/01/26	RDVE	2.956.168,52	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/08/23	26/01/23	20/01/26	RT BANDE	1.263.706,28	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/08/23	26/01/23	20/01/26	BRADESCO	4.010.290,08	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/08/23	26/01/23	20/01/26	SPERIO4	2.350.400,85	brAA+	-	-
FIM EMB II A	29/08/23	26/01/23	20/01/26	BRADESCO	10.104.751,07	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIM EMB II A	30/08/23	26/01/23	20/01/26	VOLKSWAG	6.050.346,60	brAAA	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	31/08/23	26/01/23	20/01/26	SANEAMEN	498.004,76	-	AA+.br	-
FIM EMB II A	06/09/23	26/01/23	20/01/26	BTG PACT	10.084.885,58	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIM EMB II A	08/09/23	26/01/23	20/01/26	B VOTORA	6.048.601,17	brAAA	AA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/09/23	26/01/23	20/01/26	QUATA	2.478,19	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	19/09/23	26/01/23	20/01/26	ABC	5.024.732,00	brAAA	AA+.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	19/09/23	26/01/23	20/01/26	PANAMERI	4.981.914,23	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/09/23	26/01/23	20/01/26	ELETROB	2.525.136,56	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/09/23	26/01/23	20/01/26	CSMG	2.489.869,72	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/09/23	26/01/23	20/01/26	SMARTIFI	2.477.332,66	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/09/23	26/01/23	20/01/26	RODO BR	2.477.109,90	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/09/23	26/01/23	20/01/26	S LUIZ A	1.442.302,28	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/09/23	26/01/23	20/01/26	B VOTORA	4.981.853,16	brAAA	AA.br	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	-	FIDC VERDECARD SN3	1.057.333,33	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	-	FIDC CREDZ SN4	1.158,45	-	-	AAAsf(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	-	FIDC CREDZ SN6	2.512.900,91	brAA (sf)	-	A+sf(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	FIDC VERDECARD SN5	233.333,33	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	VERDECARD FIDC SN6	1.244.444,44	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	FIDC VERDECARD SN8	1.375.000,00	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	RB CAP CREDIT AL SN3	735.592,42	brAA-(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	BR ELETRO FIDC S1	2.660.771,07	-	-	AAsf(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	INSS CONS PDL I FIDC	1.442.004,92	-	-	AAAsf(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	-	-	-	DRIVER SIX FIDC SN	1.958.069,11	-	AAA.br	-

Observação: Em setembro de 2023, nenhum dos ativos da carteira de crédito da EMBRAER PREV sofreu rebaixamento de sua classificação de risco e ficou abaixo da classificação mínima de crédito estabelecida pela Política de Investimento do Plano Embraer Prev.

4. RISCO OPERACIONAL

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

5. RISCO DE LIQUIDEZ

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

6. RISCO LEGAL

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

6.1. Relatório de Enquadramentos Legais



Relatório Resumo de Enquadramento

Patrimônio Líquido da Fundação **4.570.190.010,86**

Tópico do Enquadramento	Limite	Aplicação Atual	Valor Limite	% Aplicado	Status
% do Segmento RF/PL PLANO	100,00%	3.916.387.415,64	4.570.190.010,86	85,69%	Enquadrado
% do PL em Títulos de Emissão do Tesouro Nacional e/ou do BACEN	100,00%	3.176.840.445,51	4.570.190.010,86	69,51%	Enquadrado
% do PL em Títulos RF1, exceto títulos do Tesouro Nacional	80,00%	739.546.970,13	3.656.152.063,17	16,18%	Enquadrado
% do PL em FIDC	20,00%	Verificar Rel. de Diversificação de FIDC's	914.038.015,79	0,00%	Enquadrado
% do PL em uma mesma pessoa jurídica não-financeira	10,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Não Financ.	457.019.007,90	0,00%	Enquadrado
% do PL em Instituições Financeiras	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Financ.	1.142.547.502,72	0,00%	Enquadrado
% de uma mesma Série de Debêntures	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Debêntures	1.142.547.502,72	0,00%	Enquadrado
% do PL em RV	70,00%	534.679.242,69	3.199.132.953,12	11,70%	Enquadrado
% do capital votante de uma empresa	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação RV	1.142.547.502,72	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Imobiliários	20,00%	76.914.750,72	914.038.015,79	1,68%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Empréstimos	15,00%	25.282.411,75	685.528.528,87	0,55%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Estruturados	20,00%	0,00	914.038.015,79	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos no Exterior	10,00%	0,00	457.019.007,90	0,00%	Enquadrado

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

6.2. Relatório de Túnel de Preços

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE SETEMBRO DE 2023 À 29 DE SETEMBRO DE 2023



FIM EMB I A												
							FONTE ANBIMA					
DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
04/09/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,6495%	5,6673%	5,4831%	5,7870%	-0,0178%	NÃO
06/09/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/03/2024	Compra	0,0002%	0,0000%	-0,0212%	0,0259%	0,0002%	NÃO
06/09/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Venda	5,2510%	5,2400%	4,9713%	5,4862%	0,0110%	NÃO
06/09/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Venda	5,2510%	5,2400%	4,9713%	5,4862%	0,0110%	NÃO
06/09/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Venda	5,2510%	5,2400%	4,9713%	5,4862%	0,0110%	NÃO
06/09/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Venda	5,2500%	5,2400%	4,9713%	5,4862%	0,0100%	NÃO
06/09/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,6995%	5,7043%	5,5433%	5,8474%	-0,0048%	NÃO
06/09/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,7095%	5,7043%	5,5433%	5,8474%	0,0052%	NÃO
13/09/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/03/2026	Venda	0,0434%	0,0447%	0,0274%	0,0665%	-0,0013%	NÃO
13/09/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Venda	5,1510%	5,1677%	4,8913%	5,4067%	-0,0167%	NÃO
13/09/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Venda	5,1510%	5,1677%	4,8913%	5,4067%	-0,0167%	NÃO
13/09/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Venda	5,1510%	5,1677%	4,8913%	5,4067%	-0,0167%	NÃO
13/09/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Venda	5,1510%	5,1677%	4,8913%	5,4067%	-0,0167%	NÃO
13/09/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Venda	5,1510%	5,1677%	4,8913%	5,4067%	-0,0167%	NÃO

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE SETEMBRO DE 2023 À 29 DE SETEMBRO DE 2023



FIM EMB II A												
							FONTE ANBIMA					
DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
06/09/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	LFT	01/03/2026	Venda	0,0436%	0,0440%	0,0267%	0,0641%	-0,0004%	NÃO
08/09/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	LFT	01/03/2024	Venda	0,0007%	0,0000%	-0,0215%	0,0262%	0,0007%	NÃO
08/09/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	LFT	01/03/2026	Venda	0,0444%	0,0443%	0,0272%	0,0642%	0,0001%	NÃO
13/09/2023	FIM EMB II A	BNP	CONCORDI	LTN	01/07/2025	Compra	10,1253%	10,1420%	9,8322%	10,6003%	-0,0167%	NÃO
18/09/2023	FIM EMB II A	BNP	PACTUAL	NTN-B	15/08/2028	Compra	5,3140%	5,3436%	5,0518%	5,5197%	-0,0296%	NÃO
26/09/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	LTN	01/07/2025	Venda	10,4145%	10,5683%	10,0588%	10,8210%	-0,1538%	NÃO
26/09/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	LTN	01/07/2025	Venda	10,4145%	10,5683%	10,0588%	10,8210%	-0,1538%	NÃO
28/09/2023	FIM EMB II A	BNP	TERRA	LTN	01/04/2025	Venda	10,9710%	10,9040%	10,5324%	11,2437%	0,0670%	NÃO
28/09/2023	FIM EMB II A	BNP	LIQUIDEZ	NTN-B	15/08/2026	Compra	5,7390%	5,6600%	5,4860%	5,9776%	0,0790%	NÃO
28/09/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2026	Compra	5,7490%	5,6600%	5,4860%	5,9776%	0,0890%	NÃO

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE SETEMBRO DE 2023 À 29 DE SETEMBRO DE 2023



FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI												
							FONTE ANBIMA					
DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
01/09/2023	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	BNP	TERRA	LFT	01/09/2025	Compra	0,0043%	0,0034%	-0,0165%	0,0589%	0,0009%	NÃO
01/09/2023	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	BNP	CAPITAL	LFT	01/09/2025	Compra	0,0043%	0,0034%	-0,0165%	0,0589%	0,0009%	NÃO

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE SETEMBRO DE 2023 À 29 DE SETEMBRO DE 2023



FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO												
							FONTE ANBIMA					
DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
28/09/2023	FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	ICATU VA	N FUTURA	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,9390%	5,9200%	5,8370%	6,1701%	0,0190%	NÃO

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2023

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE SETEMBRO DE 2023 À 29 DE SETEMBRO DE 2023



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
01-09-23	FIA RVA EMB II	Venda	B3SA3	12,93	99.900,00	1.292.149,92	12,64	12,87	13,10	45.647,00
01-09-23	FIA RVA EMB II	Compra	BPAC11	32,90	7.400,00	243.428,00	32,25	32,55	33,12	17.860,00
01-09-23	FIA RVA EMB II	Compra	CPLE6	8,68	26.900,00	233.560,18	8,59	8,70	8,75	27.161,00
01-09-23	FIA RVA EMB II	Venda	MULT3	25,24	25.300,00	638.645,11	24,84	25,18	25,44	15.011,00
01-09-23	FIA RVA EMB II	Compra	ONCO3	12,51	56.900,00	706.855,12	12,09	12,55	12,77	19.162,00
01-09-23	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	27,72	12.100,00	335.374,15	27,33	27,60	27,95	13.672,00
01-09-23	FIA RVA EMB II	Venda	RDOR3	28,81	19.200,00	553.111,32	28,55	28,81	29,01	12.602,00
01-09-23	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	51,21	4.000,00	204.837,33	50,32	51,08	51,37	14.562,00
01-09-23	FIA RVA EMB II	Compra	VALE3	68,14	15.000,00	1.022.045,05	66,63	68,01	69,00	121.458,00
01-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	22,91	700,00	16.034,98	22,78	22,96	23,35	16.511,00
01-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	ASA3	11,90	4.900,00	58.290,46	11,66	11,86	12,06	26.796,00
01-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	47,45	500,00	23.725,87	47,19	47,47	47,70	17.497,00
01-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	31,22	600,00	18.734,70	30,50	31,12	31,35	23.130,00
01-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	31,27	2.100,00	65.658,45	30,50	31,12	31,35	23.130,00
01-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	32,54	600,00	19.522,04	32,25	32,55	33,12	17.860,00
01-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	3,81	4.900,00	18.652,86	3,75	3,83	3,86	46.852,00
01-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	35,56	1.500,00	53.344,03	35,22	35,50	35,86	15.705,00
01-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENAT3	15,72	1.800,00	28.290,03	15,46	15,89	16,07	11.000,00
01-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENAT3	15,55	600,00	9.332,78	15,46	15,89	16,07	11.000,00
01-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENAT3	15,75	800,00	12.603,55	15,46	15,89	16,07	11.000,00
01-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,09	12.600,00	152.361,30	11,86	12,05	12,15	11.276,00
01-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,07	1.400,00	16.891,61	11,86	12,05	12,15	11.276,00
01-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENJU3	1,58	6.900,00	10.919,00	1,57	1,58	1,62	312,00
01-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	31,94	1.700,00	54.301,61	31,74	31,96	32,12	8.484,00
01-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	14,71	1.900,00	27.952,44	14,58	14,71	14,81	14.638,00
01-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	14,69	7.400,00	108.683,52	14,58	14,71	14,81	14.638,00
01-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGT11	20,92	900,00	18.827,78	20,57	21,03	21,30	22.339,00
01-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	27,77	2.300,00	63.881,88	27,33	27,74	27,92	41.001,00
01-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	16,68	1.500,00	25.017,70	16,05	16,74	17,08	37.843,00
01-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	NINJ3	4,30	9.000,00	38.700,00	4,18	4,34	4,52	534,00
01-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	NINJ3	4,33	3.400,00	14.729,45	4,18	4,34	4,52	534,00
01-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	15,41	1.000,00	15.411,62	15,17	15,41	15,57	15.731,00
01-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	12,57	1.200,00	15.083,09	12,09	12,55	12,77	19.162,00
01-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	46,53	400,00	18.613,53	46,21	46,87	47,50	17.434,00
01-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,61	2.000,00	45.220,00	22,31	22,62	22,82	17.802,00
01-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,55	8.400,00	189.406,73	22,31	22,62	22,82	17.802,00
01-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	23,23	800,00	18.583,29	23,00	23,44	23,56	11.444,00
01-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	63,58	600,00	38.146,65	63,36	63,82	64,53	19.495,00
01-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	21,29	200,00	4.257,99	20,64	21,64	21,88	13.659,00
01-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	21,43	900,00	19.284,01	20,64	21,64	21,88	13.659,00
01-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	7,77	8.713,00	67.729,55	7,53	7,74	7,94	30.896,00
01-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	7,75	15.300,00	118.625,48	7,53	7,74	7,94	30.896,00
01-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	50,99	800,00	40.793,94	50,32	51,08	51,37	14.562,00
01-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBRB3	19,06	13.300,00	253.465,67	18,62	19,02	19,42	26.674,00
01-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBRB3	18,96	700,00	13.272,82	18,62	19,02	19,42	26.674,00
01-09-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ELET3	35,57	4.120,00	146.548,40	35,22	35,50	35,86	15.705,00
01-09-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ELET3	35,58	1.455,00	51.765,57	35,22	35,50	35,86	15.705,00
01-09-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RAIL3	22,70	1.204,00	27.330,80	22,31	22,62	22,82	17.802,00
01-09-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RAIL3	22,67	1.449,00	32.848,83	22,31	22,62	22,82	17.802,00
01-09-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RAIL3	22,62	766,00	17.326,92	22,31	22,62	22,82	17.802,00
01-09-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RAIL3	22,60	855,00	19.323,14	22,31	22,62	22,82	17.802,00
01-09-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RAIL3	22,66	1.610,00	36.484,53	22,31	22,62	22,82	17.802,00
01-09-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RAIL3	22,64	2.845,00	64.402,32	22,31	22,62	22,82	17.802,00
01-09-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRB3	18,96	3.171,00	60.122,16	18,62	19,02	19,42	26.674,00
01-09-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRB3	18,95	1.440,00	27.294,12	18,62	19,02	19,42	26.674,00
01-09-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRB3	18,95	533,00	10.100,35	18,62	19,02	19,42	26.674,00
01-09-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRB3	18,95	15.430,00	292.469,50	18,62	19,02	19,42	26.674,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ABEV3	13,87	3.224,00	44.716,76	13,69	13,86	14,00	28.624,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ALPA4	8,83	186,00	1.642,50	8,30	8,51	8,83	20.533,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ALSO3	23,00	425,00	9.773,03	22,78	22,96	23,35	16.511,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ARZZ3	73,69	28,00	2.063,24	70,69	72,48	74,00	8.552,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ASA3	11,86	6.993,00	82.937,88	11,66	11,86	12,06	26.796,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	AZUL4	14,90	272,00	4.053,52	14,56	14,86	15,05	11.578,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	B3SA3	12,98	6.660,00	86.446,96	12,64	12,87	13,10	45.647,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BBAS3	47,42	1.157,00	54.866,98	47,19	47,47	47,70	17.497,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BDOC3	13,21	1.228,00	16.221,88	13,19	13,24	13,40	4.928,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BDOC4	14,99	4.230,00	63.408,40	14,94	15,03	15,17	27.562,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BBSE3	31,04	549,00	17.038,48	30,50	31,12	31,35	23.130,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BEEF3	8,56	179,00	1.533,12	8,42	8,56	8,75	25.525,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BPAC11	32,30	4.762,00	153.813,90	32,25	32,55	33,12	17.860,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BRAP4	23,64	207,00	4.892,63	22,92	23,39	23,68	10.388,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BRFS3	9,07	1.327,00	12.034,66	9,00	9,10	9,39	52.265,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BRKM5	22,25	205,00	4.561,59	22,05	22,27	22,47	9.623,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CASH3	6,35	3.528,00	22.394,61	6,19	6,37	6,80	7.438,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CCRO3	12,66	978,00	12.379,28	12,48	12,65	12,72	13.026,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CIEL3	3,86	897,00	3.462,31	3,75	3,83	3,86	46.852,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CMIG4	12,46	1.420,00	17.693,72	12,28	12,51	12,70	17.344,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CMIN3	4,36	912,00	3.977,30	4,29	4,34	4,39	6.819,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	COGN3	3,01	1.492,00	4.489,84	2,95	3,00	3,04	12.139,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CPFE3	34,80	154,00	5.358,87	34,21	34,79	35,06	8.541,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CPLE6	8,75	4.536,00	39.690,63	8,59	8,70	8,75	27.161,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CRFB3	10,52	302,00	3.178,26	10,30	10,63	10,82	17.007,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CSAN3	17,91	1.111,00	19.902,88	17,60	17,90	18,01	14.685,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CSNA3	12,31	77,00	947,63	12,24	12,33	12,49	10.766,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CVCB3	2,59	300,00	776,99	2,50	2,61	2,71	16.504,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CYRE3	22,79	645,00	14.698,15	22,52	22,72	23,02	13.676,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	DXCO3	8,20	1.189,00	9.752,60	7,86	8,13	8,22	10.949,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	EGIE3	42,15	208,00	8.767,52	42,13	42,26	42,47	4.929,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2023

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE SETEMBRO DE 2023 À 29 DE SETEMBRO DE 2023



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ELET3	35,39	3.588,00	126.977,01	35,22	35,50	35,86	15.705,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ELET6	38,76	493,00	19.108,36	38,70	38,84	39,24	4.684,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	EMBR3	19,80	604,00	11.959,68	19,40	19,67	19,81	11.217,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ENEV3	12,05	1.244,00	14.984,53	11,86	12,05	12,15	11.276,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ENGL11	46,60	1.902,00	88.636,00	46,09	46,48	46,79	4.911,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	EQT3	31,90	1.937,00	61.789,80	31,74	31,96	32,12	8.844,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	EZTC3	22,08	218,00	4.814,28	21,96	22,15	22,65	5.007,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	FLRY3	14,73	4.239,00	62.440,47	14,58	14,71	14,81	14.638,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	GGBR4	26,00	377,00	9.802,00	25,85	26,03	26,40	19.507,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	GOAU4	11,97	889,00	10.642,97	11,79	11,90	12,14	16.864,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	GOLL4	7,24	1.185,00	8.575,76	7,07	7,16	7,24	10.571,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	HAPV3	4,43	3.552,00	15.731,88	4,24	4,39	4,47	36.655,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	HYPE3	39,79	105,00	4.177,60	38,88	39,50	39,85	10.437,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	IGT11	21,11	83,00	1.752,13	20,57	21,03	21,30	22.339,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	IRBR3	41,83	48,00	2.007,84	41,35	42,56	44,22	7.319,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ITSA4	9,34	5.068,00	47.337,46	9,20	9,32	9,39	23.076,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ITUB4	27,65	3.947,00	109.136,05	27,33	27,74	27,92	41.001,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	JBSS3	18,51	933,00	17.271,47	18,40	18,51	18,65	12.155,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	KLBN11	23,08	333,00	7.684,59	22,77	22,99	23,10	10.952,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	LRN3	16,78	750,00	12.585,90	16,05	16,74	17,08	37.843,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	LWSA3	7,25	635,00	4.606,42	7,03	7,15	7,26	6.179,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	MGLU3	2,86	2.691,00	7.695,16	2,75	2,81	2,86	26.290,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	MRFG3	7,34	240,00	1.762,66	7,26	7,35	7,48	27.984,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	MRVE3	11,79	683,00	8.051,21	11,43	11,78	11,92	16.500,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	MULT3	25,19	217,00	5.466,37	24,84	25,18	25,44	15.011,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	NTCO3	15,37	653,00	10.036,81	15,17	15,41	15,57	15.731,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	PCAR3	5,00	52,00	260,00	4,72	4,90	5,05	14.712,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	PETR3	35,69	22.812,00	814.154,82	34,68	35,29	35,81	33.585,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	PETRA	32,63	3.755,00	122.523,40	31,96	32,36	32,69	70.155,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	PETZ3	5,75	617,00	3.548,43	5,42	5,64	5,77	16.642,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	PRIO3	46,95	2.742,00	128.737,01	46,21	46,87	47,50	17.434,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RADL3	27,54	4.045,00	111.413,61	27,33	27,60	27,95	13.672,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	RAIL3	22,66	863,00	19.555,71	22,31	22,62	22,82	17.802,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	RAIZ4	3,63	1.328,00	4.820,64	3,63	3,66	3,74	18.901,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RDOR3	28,86	2.767,00	79.855,30	28,55	28,81	29,01	12.602,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RECV3	23,56	13.800,00	325.132,59	23,00	23,44	23,56	11.444,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	RENT3	63,72	424,00	27.017,23	63,36	63,82	64,53	19.495,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	RRRP3	33,20	145,00	4.814,00	32,85	33,11	33,75	15.936,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	SANB11	27,34	912,00	24.934,08	27,19	27,34	27,49	4.707,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	SANB11	27,29	18,00	491,22	27,19	27,34	27,49	4.707,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	SBSP3	58,72	222,00	13.035,84	57,59	58,55	58,93	6.694,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	SBSP3	58,07	58,00	3.368,06	57,59	58,55	58,93	6.694,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	SLCE3	40,57	292,00	11.845,94	40,18	40,54	40,82	5.663,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	SMT03	37,23	117,00	4.356,24	36,49	37,06	37,46	8.137,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	SOMA3	7,66	137,00	1.049,05	7,53	7,74	7,94	30.896,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	SUZB3	50,89	5,00	254,45	50,32	51,08	51,37	14.562,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	SUZB3	51,10	2.769,00	141.495,90	50,32	51,08	51,37	14.562,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	TAE11	35,07	42,00	1.472,94	34,25	34,69	35,05	10.741,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	TAE11	34,91	137,00	4.782,67	34,25	34,69	35,05	10.741,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	TIMS3	14,52	691,00	10.034,58	14,42	14,51	14,75	13.863,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	TOTS3	27,80	410,00	11.396,62	27,74	27,86	28,26	10.455,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	UGPA3	18,40	968,00	17.814,17	18,26	18,41	18,58	9.557,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	USIM5	6,94	17,00	117,98	6,89	6,92	6,96	9.502,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	USIM5	6,93	401,00	2.778,93	6,89	6,92	6,96	9.502,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VALE3	68,89	16.361,00	1.127.115,56	66,63	68,01	69,00	121.458,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VAMO3	11,96	21.149,00	252.943,24	11,80	11,94	12,04	12.509,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	VBR3	18,93	917,00	17.360,94	18,62	19,02	19,42	26.674,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	VIA3	1,29	997,00	1.285,49	1,26	1,29	1,38	14.745,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	VIVT3	41,68	348,00	14.504,64	41,16	41,60	42,05	11.049,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	WEGE3	35,95	10.052,00	361.369,98	35,57	35,92	36,21	16.559,00
01-09-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	YDUQ3	21,11	578,00	12.202,50	20,50	21,02	21,43	12.680,00
04-09-23	FIA EMB VIII ETF	Compra	BOVA11	114,14	65.800,00	7.510.412,00	113,82	114,31	114,85	28.568,00
04-09-23	FIA EMB VIII ETF	Compra	BOVV11	119,60	62.700,00	7.498.920,00	119,32	119,65	120,32	6.490,00
04-09-23	FIA RVA EMB II	Venda	BDDC4	14,86	45.200,00	671.895,64	14,81	14,90	15,04	22.008,00
04-09-23	FIA RVA EMB II	Compra	ELET3	35,19	19.800,00	696.797,79	34,82	35,32	35,85	12.831,00
04-09-23	FIA RVA EMB II	Venda	ITUB4	27,59	21.500,00	593.185,32	27,32	27,46	27,71	18.576,00
04-09-23	FIA RVA EMB II	Venda	MULT3	25,24	26.600,00	671.324,51	24,99	25,37	25,60	10.472,00
04-09-23	FIA RVA EMB II	Venda	STBP3	8,77	40.000,00	350.755,73	8,68	8,74	8,88	4.718,00
04-09-23	FIA RVA EMB II	Compra	VALE3	69,56	30.000,00	2.086.916,53	68,88	69,52	70,05	52.334,00
04-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	22,94	900,00	20.648,57	22,82	22,99	23,25	10.858,00
04-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	ASA3	12,26	3.100,00	37.993,62	11,85	12,19	12,35	9.950,00
04-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	13,86	2.500,00	34.647,64	13,65	13,79	13,92	5.458,00
04-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	47,31	600,00	28.384,50	47,18	47,37	47,70	11.921,00
04-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	31,71	900,00	28.539,93	31,56	31,95	32,60	12.125,00
04-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	3,81	6.200,00	23.650,01	3,81	3,83	3,89	9.677,00
04-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	35,38	1.100,00	38.916,07	34,82	35,32	35,85	12.831,00
04-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENAT3	15,80	2.300,00	36.347,77	15,58	15,81	16,07	6.462,00
04-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENAT3	15,76	1.500,00	23.641,53	15,58	15,81	16,07	6.462,00
04-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,07	2.900,00	35.000,79	11,85	12,00	12,17	7.098,00
04-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQT3	32,17	1.600,00	51.466,00	31,75	32,09	32,35	8.727,00
04-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	14,84	2.600,00	38.580,04	14,65	14,86	15,09	9.141,00
04-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	14,77	3.800,00	56.118,90	14,65	14,86	15,09	9.141,00
04-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,44	2.400,00	10.661,00	4,40	4,46	4,54	17.067,00
04-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGT11	21,60	2.500,00	54.000,63	21,08	21,56	21,70	12.981,00
04-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	27,44	1.900,00	52.134,47	27,32	27,46	27,71	18.576,00
04-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	LRN3	16,43	1.900,00	31.216,10	16,30	16,60	17,04	17.598,00
04-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	15,39	1.200,00	18.472,20	15,19	15,41	15,61	8.196,00
04-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETRA	32,35	400,00	12.940,90	32,21	32,41	32,72	39.962,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2023

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE SETEMBRO DE 2023 À 29 DE SETEMBRO DE 2023



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
04-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	46,62	600,00	27.971,00	46,41	46,60	47,02	10.255,00
04-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,60	1.500,00	33.900,00	22,51	22,64	22,81	6.356,00
04-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,64	12.500,00	282.994,62	22,51	22,64	22,81	6.356,00
04-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	23,77	1.100,00	26.151,00	23,29	23,67	23,88	6.981,00
04-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	63,45	800,00	50.760,47	63,13	63,64	64,30	8.802,00
04-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	21,65	1.500,00	32.481,39	21,33	21,67	21,84	10.691,00
04-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	51,08	1.200,00	61.295,07	50,65	51,03	51,47	6.468,00
04-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	18,94	900,00	17.042,82	18,77	18,93	19,11	12.619,00
05-09-23	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	46,82	11.800,00	552.444,00	46,08	46,59	47,03	8.655,00
05-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	ALSO3	22,60	1.600,00	36.161,50	22,41	22,65	22,93	24.505,00
05-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	12,74	23.100,00	294.387,75	12,21	12,72	12,99	54.323,00
05-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	31,55	5.600,00	176.660,21	31,21	31,52	31,79	16.177,00
05-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	35,08	2.800,00	98.236,82	34,71	35,02	35,54	27.867,00
05-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENAT3	16,19	100,00	1.619,20	15,61	16,09	16,29	8.967,00
05-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENAT3	16,15	1.800,00	29.072,77	15,61	16,09	16,29	8.967,00
05-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	14,44	1.400,00	20.211,60	14,28	14,36	14,56	13.978,00
05-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	14,38	1.700,00	24.441,42	14,28	14,36	14,56	13.978,00
05-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	14,40	3.200,00	46.080,00	14,28	14,36	14,56	13.978,00
05-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	NINJ3	4,38	1.300,00	5.695,02	4,24	4,37	4,40	234,00
05-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	NINJ3	4,38	3.200,00	14.016,00	4,24	4,37	4,40	234,00
05-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,29	8.900,00	198.343,72	22,01	22,23	22,69	18.615,00
05-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,25	9.900,00	220.226,98	22,01	22,23	22,69	18.615,00
05-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	22,96	1.600,00	36.736,00	22,51	22,81	23,92	25.056,00
05-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	22,80	3.500,00	79.798,21	22,51	22,81	23,92	25.056,00
05-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	62,50	800,00	49.999,77	61,91	62,31	63,06	15.823,00
05-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	SBS3	58,67	1.900,00	111.468,99	57,80	58,61	59,07	9.014,00
05-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	SBS3	58,67	1.500,00	88.006,14	57,80	58,61	59,07	9.014,00
05-09-23	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	13,80	14.205,00	196.054,45	13,76	13,82	13,94	7.686,00
05-09-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ELET3	35,00	1.331,00	46.588,98	34,71	35,02	35,54	27.867,00
05-09-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ELET3	35,00	1,00	35,00	34,71	35,02	35,54	27.867,00
05-09-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ELET3	34,92	1.485,00	51.856,20	34,71	35,02	35,54	27.867,00
05-09-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	46,46	2.066,00	95.985,92	46,08	46,59	47,03	8.655,00
06-09-23	FIA RVA EMB II	Venda	ABEV3	13,99	14.200,00	198.676,65	13,96	14,02	14,16	36.356,00
06-09-23	FIA RVA EMB II	Venda	BDDC4	14,45	20.500,00	296.125,05	14,37	14,44	14,67	40.063,00
06-09-23	FIA RVA EMB II	Venda	CSMG3	18,12	24.000,00	434.932,78	17,90	18,09	18,55	4.411,00
06-09-23	FIA RVA EMB II	Compra	PET4	33,70	9.900,00	333.599,22	33,22	33,52	33,80	65.648,00
06-09-23	FIA RVA EMB II	Compra	SOMA3	7,64	87.800,00	670.832,75	7,54	7,66	7,80	21.775,00
06-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	31,15	900,00	28.037,10	30,70	31,11	31,39	14.364,00
06-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	34,38	6.800,00	233.767,60	34,14	34,46	34,98	23.047,00
06-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	11,99	12.200,00	146.312,77	11,93	12,05	12,31	15.460,00
06-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	30,85	1.600,00	49.362,59	30,70	30,94	31,54	18.963,00
06-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	20,48	2.000,00	40.953,23	20,27	20,55	21,12	20.479,00
06-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	20,35	2.200,00	44.762,55	20,27	20,55	21,12	20.479,00
06-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	26,73	7.100,00	189.802,41	26,60	26,78	27,17	30.253,00
06-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	LREN3	15,64	7.000,00	109.451,90	15,48	15,68	16,14	33.926,00
06-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	NINJ3	4,33	3.100,00	13.412,68	4,28	4,39	4,47	453,00
06-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	NINJ3	4,40	17.900,00	78.760,00	4,28	4,39	4,47	453,00
06-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,00	8.200,00	180.395,08	21,81	22,01	22,34	25.822,00
06-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	21,88	1.700,00	37.203,44	21,70	21,95	22,56	16.160,00
06-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	60,96	3.100,00	188.969,00	60,42	61,15	62,60	19.788,00
06-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	50,01	600,00	30.007,63	49,77	50,16	50,98	12.456,00
06-09-23	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	13,73	7.094,00	97.430,68	13,65	13,78	13,89	7.317,00
06-09-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ELET3	34,79	2.819,00	98.079,49	34,14	34,46	34,98	23.047,00
06-09-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ELET3	34,18	2.819,00	96.363,21	34,14	34,46	34,98	23.047,00
06-09-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	45,68	4.248,00	194.063,48	45,24	45,60	46,67	5.246,00
06-09-23	FIA RVA EMB IV	Venda	PRI03	46,88	4.940,00	231.611,07	46,73	47,00	47,80	16.563,00
08-09-23	FIA RVA EMB II	Venda	BRFS3	8,80	106.600,00	938.409,03	8,58	8,74	9,09	20.510,00
08-09-23	FIA RVA EMB II	Compra	MRF33	7,53	150.400,00	1.131.804,65	7,23	7,43	7,60	17.145,00
08-09-23	FIA RVA EMB II	Compra	SOMA3	7,56	55.900,00	422.781,92	7,41	7,54	7,69	14.136,00
08-09-23	FIA RVA EMB II	Venda	TOTS3	27,66	15.600,00	431.567,80	27,43	27,66	27,86	11.582,00
08-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	22,57	2.200,00	49.648,09	22,37	22,56	22,70	9.458,00
08-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	12,29	3.800,00	46.707,85	12,22	12,30	12,60	20.262,00
08-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	13,79	5.500,00	75.817,60	13,73	13,80	13,95	8.493,00
08-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	46,70	1.600,00	74.726,29	46,30	46,62	47,02	32.844,00
08-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	31,17	1.100,00	34.288,28	30,96	31,20	31,44	9.632,00
08-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	30,80	2.100,00	64.676,67	30,53	30,77	31,08	17.917,00
08-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	3,65	15.000,00	54.805,22	3,63	3,65	3,68	24.681,00
08-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	33,93	900,00	30.533,43	33,60	34,15	34,53	20.608,00
08-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENAT3	16,24	400,00	6.496,85	15,96	16,24	16,53	5.124,00
08-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENAT3	16,19	1.900,00	30.769,98	15,96	16,24	16,53	5.124,00
08-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	11,78	2.500,00	29.461,27	11,72	11,79	11,92	11.441,00
08-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	31,09	4.700,00	146.120,11	30,69	31,04	31,22	13.234,00
08-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	14,23	4.000,00	56.907,56	14,15	14,25	14,33	8.962,00
08-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	14,20	2.900,00	41.180,00	14,15	14,25	14,33	8.962,00
08-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,35	3.200,00	13.912,74	4,30	4,37	4,52	44.316,00
08-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	20,20	5.800,00	117.155,07	20,11	20,23	20,46	11.361,00
08-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	26,93	3.200,00	86.166,47	26,53	26,85	27,11	37.408,00
08-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	15,50	5.700,00	88.360,31	15,25	15,51	15,68	27.961,00
08-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	14,78	3.100,00	45.812,01	14,71	14,81	15,02	12.223,00
08-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	11,56	1.800,00	20.802,69	11,43	11,56	11,74	3.860,00
08-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	PET4	33,42	400,00	13.367,90	33,26	33,42	33,67	57.395,00
08-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	47,18	900,00	42.457,68	46,36	47,18	47,54	17.171,00
08-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	21,88	500,00	10.940,00	21,74	22,02	22,21	20.217,00
08-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,03	1.100,00	24.232,52	21,74	22,02	22,21	20.217,00
08-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	21,86	100,00	2.186,00	21,74	22,02	22,21	20.217,00
08-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	22,00	1.600,00	35.194,34	21,15	21,92	22,20	7.977,00
08-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	60,31	2.100,00	126.651,00	60,05	60,36	61,09	19.253,00
08-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	SBS3	57,67	600,00	34.604,71	57,15	57,67	57,96	7.178,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2023

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE SETEMBRO DE 2023 À 29 DE SETEMBRO DE 2023



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
08-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	Sbsp3	57,71	2.500,00	144.281,56	57,15	57,67	57,96	7.178,00
08-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	20,40	2.200,00	44.869,68	20,02	20,45	20,65	6.692,00
08-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	47,86	700,00	33.501,37	47,48	48,54	49,06	25.933,00
08-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBR3	18,27	2.100,00	38.357,69	18,12	18,34	18,75	22.390,00
08-09-23	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	13,78	6.413,00	88.370,40	13,73	13,80	13,95	8.493,00
08-09-23	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	13,86	634,00	8.790,37	13,73	13,80	13,95	8.493,00
08-09-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	45,13	4.311,00	194.551,11	44,43	45,13	45,48	6.856,00
11-09-23	FIA RVA EMB II	Venda	B3SA3	12,64	35.200,00	444.753,03	12,58	12,80	12,97	49.056,00
11-09-23	FIA RVA EMB II	Venda	BRKMS	23,39	9.700,00	226.896,56	23,32	23,53	24,42	12.277,00
11-09-23	FIA RVA EMB II	Compra	VALE3	68,01	8.500,00	578.091,58	67,54	67,87	68,18	49.766,00
11-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	23,00	600,00	13.798,33	22,60	22,97	23,22	11.919,00
11-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	12,22	5.100,00	62.315,39	12,07	12,22	12,38	21.409,00
11-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	13,82	1.500,00	20.731,22	13,74	13,82	13,90	5.260,00
11-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	47,33	400,00	18.933,69	46,84	47,23	47,54	24.394,00
11-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	31,68	400,00	12.672,07	31,29	31,64	31,97	11.973,00
11-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	30,89	600,00	18.534,24	30,42	30,86	31,13	16.089,00
11-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	CIEL3	3,64	2.600,00	9.464,00	3,63	3,66	3,73	40.232,00
11-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	CIEL3	3,65	5.000,00	18.273,68	3,63	3,66	3,73	40.232,00
11-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	34,53	1.000,00	34.528,05	34,36	34,85	35,23	19.579,00
11-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENAT3	16,26	2.100,00	34.156,28	16,14	16,36	16,91	7.540,00
11-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	11,90	2.300,00	27.365,48	11,76	11,91	12,02	12.826,00
11-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	31,63	1.700,00	53.763,04	31,21	31,57	31,90	12.061,00
11-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	20,41	600,00	12.245,19	20,23	20,56	20,80	10.804,00
11-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	20,45	500,00	10.222,67	20,23	20,56	20,80	10.804,00
11-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	20,44	300,00	6.133,28	20,23	20,56	20,80	10.804,00
11-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	27,12	100,00	2.712,33	26,89	27,22	27,49	33.372,00
11-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	15,61	1.300,00	20.299,49	15,40	15,69	15,93	19.662,00
11-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	14,88	1.600,00	23.814,46	14,70	14,96	15,08	11.122,00
11-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	14,92	2.500,00	37.293,95	14,70	14,96	15,08	11.122,00
11-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRIO3	47,34	400,00	18.934,64	46,82	47,38	48,34	17.109,00
11-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	21,98	2.400,00	52.757,49	21,75	22,00	22,32	19.781,00
11-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	21,88	700,00	15.313,17	21,71	21,98	22,36	10.857,00
11-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	60,33	900,00	54.299,98	60,01	60,82	61,65	17.897,00
11-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	20,74	900,00	18.665,43	20,43	20,79	20,98	5.863,00
11-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	49,55	200,00	9.910,67	48,46	49,64	50,35	17.792,00
11-09-23	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	13,83	7.298,00	100.912,09	13,74	13,82	13,90	5.260,00
11-09-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ELET3	34,86	18,00	627,54	34,36	34,85	35,23	19.579,00
11-09-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	45,49	3.127,00	142.231,60	44,56	45,31	46,24	11.528,00
11-09-23	FIA RVA EMB IV	Venda	PRIO3	47,59	4.135,00	196.774,32	46,82	47,38	48,34	17.109,00
12-09-23	FIA RVA EMB II	Venda	BRKMS	22,95	18.000,00	413.034,94	22,80	23,00	23,60	11.830,00
12-09-23	FIA RVA EMB II	Venda	CSMG3	18,39	24.200,00	445.136,98	18,21	18,40	18,52	4.982,00
12-09-23	FIA RVA EMB II	Compra	HAPV3	4,59	111.800,00	513.162,00	4,43	4,60	4,68	65.353,00
12-09-23	FIA RVA EMB II	Compra	ONCO3	12,09	34.400,00	416.021,09	11,78	12,04	12,16	5.713,00
12-09-23	FIA RVA EMB II	Compra	PRIO3	48,20	5.700,00	274.719,70	47,85	48,26	48,71	16.990,00
12-09-23	FIA RVA EMB II	Compra	RDOR3	30,01	5.000,00	150.037,77	29,03	29,69	30,18	11.930,00
12-09-23	FIA RVA EMB II	Compra	RDOR3	30,03	500,00	15.015,00	29,03	29,69	30,18	11.930,00
12-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	14,64	3.700,00	54.164,23	14,46	14,65	14,73	8.241,00
12-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	LREN3	15,97	2.500,00	39.922,35	15,57	15,96	16,10	19.595,00
12-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	15,23	5.100,00	77.658,77	14,95	15,20	15,33	10.719,00
12-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,51	5.000,00	112.571,31	22,02	22,53	22,84	23.217,00
12-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	22,06	900,00	19.854,00	21,89	22,12	22,41	8.725,00
12-09-23	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	13,92	3.760,00	52.344,26	13,84	13,92	14,04	5.956,00
12-09-23	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	13,92	451,00	6.277,92	13,84	13,92	14,04	5.956,00
12-09-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	6,89	160,00	1.103,15	6,79	7,04	7,17	7.054,00
12-09-23	FIA RVA EMB IV	Venda	PRIO3	48,49	138,00	6.691,62	47,85	48,26	48,71	16.990,00
12-09-23	FIA RVA EMB IV	Venda	PRIO3	48,11	797,00	38.347,21	47,85	48,26	48,71	16.990,00
12-09-23	FIA RVA EMB IV	Venda	PRIO3	48,02	18,00	864,36	47,85	48,26	48,71	16.990,00
12-09-23	FIA RVA EMB IV	Venda	PRIO3	48,40	2.796,00	135.333,23	47,85	48,26	48,71	16.990,00
12-09-23	FIA RVA EMB IV	Venda	PRIO3	48,05	1.446,00	69.480,61	47,85	48,26	48,71	16.990,00
12-09-23	FIA RVA EMB IV	Venda	PRIO3	48,05	229,00	11.003,45	47,85	48,26	48,71	16.990,00
12-09-23	FIA RVA EMB IV	Venda	PRIO3	48,01	221,00	10.610,21	47,85	48,26	48,71	16.990,00
12-09-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RAIL3	22,36	4.799,00	107.305,64	22,02	22,53	22,84	23.217,00
12-09-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RAIL3	22,67	29,00	657,43	22,02	22,53	22,84	23.217,00
12-09-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RAIL3	22,52	1.667,00	37.534,05	22,02	22,53	22,84	23.217,00
12-09-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RAIL3	22,76	900,00	20.484,00	22,02	22,53	22,84	23.217,00
12-09-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RAIL3	22,69	1.171,00	26.564,26	22,02	22,53	22,84	23.217,00
13-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	13,99	900,00	12.591,00	13,90	14,00	14,09	4.497,00
13-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	47,37	300,00	14.212,00	47,13	47,51	47,90	27.640,00
13-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	3,70	4.800,00	17.744,00	3,61	3,69	3,77	36.947,00
13-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	36,63	3.100,00	113.549,95	35,77	36,78	37,26	36.261,00
13-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	36,74	2.100,00	77.146,58	35,77	36,78	37,26	36.261,00
13-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	36,87	5.500,00	202.776,45	35,77	36,78	37,26	36.261,00
13-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENAT3	16,74	800,00	13.394,00	16,69	16,86	17,21	5.912,00
13-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,13	1.500,00	18.201,15	12,05	12,19	12,43	14.802,00
13-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	33,13	7.200,00	238.509,66	32,20	33,07	33,29	22.044,00
13-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	33,18	3.900,00	129.383,86	32,20	33,07	33,29	22.044,00
13-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	33,15	1.800,00	59.670,00	32,20	33,07	33,29	22.044,00
13-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	33,12	1.000,00	33.117,31	32,20	33,07	33,29	22.044,00
13-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	14,78	1.200,00	17.740,39	14,60	14,74	14,87	11.011,00
13-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	14,82	1.000,00	14.820,43	14,60	14,74	14,87	11.011,00
13-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	14,76	1.700,00	25.098,55	14,60	14,74	14,87	11.011,00
13-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	21,32	1.300,00	27.715,06	21,09	21,37	21,66	12.930,00
13-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	27,79	1.300,00	36.126,57	27,49	27,81	28,04	41.343,00
13-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	23,18	4.000,00	92.713,19	22,64	23,25	23,64	30.803,00
13-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	23,32	7.500,00	174.892,26	22,64	23,25	23,64	30.803,00
13-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	23,07	2.400,00	55.368,00	22,64	23,25	23,64	30.803,00
13-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	21,83	2.500,00	54.571,89	21,58	21,84	22,17	13.822,00
13-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	63,01	400,00	25.202,22	61,87	63,18	64,05	15.666,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2023

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE SETEMBRO DE 2023 À 29 DE SETEMBRO DE 2023



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
28-09-23	FIA RVA EMB II	Venda	STBP3	8,48	20.000,00	169.666,00	8,40	8,53	8,69	6.398,00
28-09-23	FIA RVA EMB II	Venda	SUZB3	53,45	6.300,00	336.720,00	53,14	53,53	54,43	24.856,00
28-09-23	FIA RVA EMB II	Venda	UGPA3	18,59	10.700,00	198.913,00	18,12	18,46	18,72	14.425,00
28-09-23	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	66,60	36.000,00	2.397.779,00	65,96	66,58	67,04	55.140,00
28-09-23	FIA RVA EMB II	Venda	VBRB3	18,84	15.800,00	297.672,00	18,44	18,76	18,93	21.965,00
28-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	WGEF3	36,39	7.300,00	265.647,00	35,81	36,29	36,57	18.530,00
28-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	22,11	1.800,00	39.791,57	21,81	22,17	22,42	11.265,00
28-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	12,13	1.900,00	23.046,85	11,54	12,09	12,23	30.434,00
28-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	13,60	1.900,00	25.843,90	13,55	13,60	13,70	8.419,00
28-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	47,44	700,00	33.210,32	46,23	47,33	47,80	34.444,00
28-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	31,57	700,00	22.100,54	31,12	31,52	31,79	12.413,00
28-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	30,59	900,00	27.530,31	29,73	30,52	31,02	21.138,00
28-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	3,45	8.600,00	29.637,69	3,37	3,44	3,47	12.410,00
28-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	36,31	4.500,00	163.373,39	35,31	36,12	36,56	34.415,00
28-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENAT3	17,70	900,00	15.927,00	17,50	17,74	18,11	6.808,00
28-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,05	4.000,00	48.215,04	11,74	11,99	12,19	11.097,00
28-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	15,10	1.500,00	22.651,21	14,95	15,13	15,26	9.341,00
28-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	15,15	1.500,00	22.724,24	14,95	15,13	15,26	9.341,00
28-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	15,14	1.600,00	24.223,78	14,95	15,13	15,26	9.341,00
28-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGT11	19,97	6.400,00	127.799,00	19,53	19,98	20,17	16.910,00
28-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	27,17	3.400,00	92.391,67	26,45	27,07	27,38	41.876,00
28-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	13,34	2.600,00	34.688,84	12,75	13,33	13,54	50.960,00
28-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	13,30	3.100,00	41.245,10	12,75	13,33	13,54	50.960,00
28-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	14,98	1.300,00	19.469,00	14,64	14,96	15,50	33.812,00
28-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	47,78	600,00	28.669,06	47,13	47,63	48,52	23.387,00
28-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,25	900,00	20.025,00	22,14	22,62	22,86	26.073,00
28-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,54	800,00	18.031,90	22,14	22,62	22,86	26.073,00
28-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	20,28	1.400,00	28.388,13	20,15	20,30	20,66	10.798,00
28-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	20,24	3.200,00	64.764,26	20,15	20,30	20,66	10.798,00
28-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	56,68	2.200,00	124.694,18	55,65	56,80	57,40	19.095,00
28-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	SBSP3	59,12	1.300,00	76.860,50	58,64	59,10	59,55	12.947,00
28-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	20,85	600,00	12.507,49	19,90	20,76	21,06	10.087,00
28-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	53,43	1.200,00	64.121,38	53,14	53,53	54,43	24.856,00
28-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBRB3	18,76	1.400,00	26.261,38	18,44	18,76	18,93	21.965,00
28-09-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ELET3	36,35	2.266,00	82.375,88	35,31	36,12	36,56	34.415,00
28-09-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ELET3	36,24	2.395,00	86.799,87	35,31	36,12	36,56	34.415,00
28-09-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ELET6	39,65	1.421,00	56.336,87	38,45	39,56	39,92	11.255,00
28-09-23	FIA RVA EMB IV	Compra	EQTL3	32,12	7.230,00	232.260,68	31,75	32,02	32,36	19.303,00
28-09-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ITUB4	27,23	17.800,00	484.749,07	26,45	27,07	27,38	41.876,00
28-09-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	XPLG11	113,22	8,00	905,72	112,76	113,13	113,48	6.242,00
29-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,10	10.400,00	125.852,73	11,98	12,14	12,56	13.022,00
29-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,18	5.200,00	63.332,88	11,98	12,14	12,56	13.022,00
29-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	32,03	2.000,00	64.068,37	31,70	31,97	32,47	16.313,00
29-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	31,86	3.900,00	124.258,24	31,70	31,97	32,47	16.313,00
29-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	20,12	3.100,00	62.357,74	19,94	20,13	20,43	12.802,00
29-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	27,10	2.100,00	56.901,90	27,02	27,16	27,57	28.356,00
29-09-23	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	13,39	16.700,00	223.671,08	13,23	13,47	13,89	41.379,00
29-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	14,62	15.400,00	225.154,72	14,39	14,67	15,16	24.602,00
29-09-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,77	5.700,00	129.806,90	22,64	22,78	23,04	25.860,00
29-09-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ELET3	36,71	995,00	36.529,57	36,45	36,73	36,92	23.879,00
29-09-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ELET3	36,64	995,00	36.455,90	36,45	36,73	36,92	23.879,00
29-09-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ELET3	36,83	1.659,00	61.104,27	36,45	36,73	36,92	23.879,00
29-09-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ELET3	36,72	663,00	24.344,87	36,45	36,73	36,92	23.879,00
29-09-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ELET6	40,17	950,00	38.165,85	39,79	40,19	40,43	6.368,00
29-09-23	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	4,64	9.015,00	41.870,59	4,58	4,64	4,72	76.273,00
29-09-23	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	4,66	15.196,00	70.836,12	4,58	4,64	4,72	76.273,00
29-09-23	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	4,64	8.264,00	38.344,96	4,58	4,64	4,72	76.273,00
29-09-23	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	4,68	21.035,00	98.341,67	4,58	4,64	4,72	76.273,00
29-09-23	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	4,64	2.404,00	11.154,56	4,58	4,64	4,72	76.273,00
29-09-23	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	4,70	10.894,00	51.201,80	4,58	4,64	4,72	76.273,00
29-09-23	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	4,64	18.030,00	83.679,27	4,58	4,64	4,72	76.273,00
29-09-23	FIA RVA EMB IV	Venda	RENT3	58,17	3,00	174,51	57,70	58,33	58,96	26.849,00
29-09-23	FIA RVA EMB IV	Venda	RENT3	58,19	7.757,00	451.371,60	57,70	58,33	58,96	26.849,00
29-09-23	FIA RVA EMB IV	Venda	RENT3	58,12	7.220,00	419.660,23	57,70	58,33	58,96	26.849,00

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.