



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO

Novembro/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 – NOVEMBRO 2023



Data: 30/11/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS
CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais			
PL:	4.617.105.043,38	VAR / PL:	3,8566%
VAR:	178.063.995,80	ETL / PL:	4,8364%
ETL:	223.299.434,48	VAR / CDI:	0,0428%
Limite Fundo:		Status:	ENQUADRADO
Benchmark:		Duração DC:	0,00%
		Duração DU:	1,708,48
			1,175,36

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	194.716.300,02	Cenário Baixa - 10000 (+):	265.326.013,91	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	337.196.561,95	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	31.398.732,20
Cenário Alta - 09999 (-):	(228.029.149,06)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(206.502.690,56)	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	(55.066.249,06)	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(341.647.640,09)
Cenário Alta - 09999:	(33.312.849,05)	Cenário Baixa - 10000:	58.823.323,35	CENÁRIO BRADESCO 1:	282.130.312,88	CENÁRIO BRADESCO 2:	(310.248.907,90)

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
TCR11	10.208.090,07	678.569,06	638.586,63	0,36%	-1.297.673,70	76.251,07	532.996,66	-658.916,21
TEPP11	5.856.895,06	-55.740,13	-55.740,13	-0,03%	2.928.447,53	-2.928.447,53	858.620,82	-865.649,09
TIMS3	2.108.383,04	191.204,92	163.983,17	0,09%	674.682,57	-484.928,10	309.088,95	-311.619,01
TOTS3	3.673.460,11	1.045.747,95	999.703,27	0,66%	734.692,02	-734.692,02	538.529,25	-542.937,40
TRFX11	7.803.794,16	241.773,03	151.645,51	0,09%	3.901.844,90	-3.901.852,08	1.144.023,03	-1.153.397,48
UGEL11	1.153.337,12	349,66	337,72	0,00%	-945,22	770,29	1.152,87	-1.666,03
UGPA3	13.858.285,75	2.717.567,94	2.541.136,82	1,43%	3.464.571,44	-2.771.657,15	2.031.624,69	-2.048.254,63
UNEG11	10.580.214,99	755.603,06	704.694,49	0,40%	-1.464.672,75	109.133,78	621.545,87	-770.558,26
USIMS	203.951,28	59.501,66	56.982,70	0,03%	79.541,00	-44.869,28	29.899,26	-30.144,00
UTPS21	6.510.834,73	487.879,29	449.564,22	0,25%	-827.011,69	19.162,59	317.699,17	-401.176,93
VALE3	52.271.030,00	8.318.569,62	7.539.554,89	4,23%	13.067.757,50	-13.067.757,50	7.662.933,00	-7.725.668,23
VAMO22	1.092.046,55	170,10	162,65	0,00%	-504,22	410,57	640,91	-935,12
VAMO3	195.915,98	63.946,36	61.291,71	0,03%	68.570,59	-78.366,39	28.721,28	-28.956,38
VAMO33	11.791.466,06	915.583,89	826.787,64	0,46%	-1.246.534,00	-46.463,06	411.155,65	-532.180,49
VAMO34	7.297.524,44	561.608,65	509.826,12	0,29%	-796.106,60	-29.865,51	264.202,02	-341.328,41
VBBR3	13.108.106,25	904.539,34	698.007,33	0,39%	3.277.026,56	-3.277.026,56	1.921.648,38	-1.937.378,10
VCCS11	773.142,60	1.133,63	1.119,43	0,00%	-2.543,01	2.142,64	2.992,35	-4.095,23
VECS11	3.651.856,39	192,33	178,18	0,00%	-751,71	612,57	1.041,60	-1.541,27
VERDECS2	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
VERO12	4.962.600,21	311.598,99	285.017,84	0,16%	-433.780,64	-39.942,78	123.304,77	-161.565,16
VIMT13	7.478.067,14	506.232,14	467.043,44	0,26%	-856.120,20	5.291,10	317.344,04	-401.753,67
VIVT3	1.124.421,12	112.383,89	101.795,72	0,06%	168.661,04	-168.665,30	164.840,14	-166.189,44
VIXL14	1.196.639,69	136,83	129,27	0,00%	-444,43	362,57	583,38	-856,37
VRDN12	5.189.631,09	348.725,71	320.976,19	0,18%	-560.493,10	-16.580,77	192.355,32	-246.169,27
VVEO15	1.074.912,76	470,86	457,73	0,00%	-1.189,99	970,04	1.406,42	-2.015,92
VVEO16	1.058.764,73	579,17	564,63	0,00%	-1.425,86	1.166,30	1.671,62	-2.383,54
VVRT11	2.598.354,61	904,96	878,45	0,00%	-2.366,89	1.933,13	2.845,52	-4.084,78
WDOF24	-3.956,78	29.720,26	23.514,33	0,01%	-54.698,96	55.631,15	-71.046,24	71.454,44
WDOZ23	-2.648,90	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
WEGE3	6.004.823,89	626.973,32	400.885,93	0,23%	1.501.205,97	-1.501.223,54	880.307,18	-887.512,97
XPM11	3.484.672,58	158.092,81	-55.638,84	-0,03%	1.742.336,29	-1.742.336,29	510.853,00	-515.034,61
XPLG11	295.384,62	8.572,37	-1.055,43	0,00%	142.692,31	-142.692,31	41.837,39	-42.179,85
XPPR11	1.917.022,40	123.668,68	-19.693,79	-0,01%	958.511,20	-958.511,20	281.035,48	-283.335,91
YDUQ3	2.352.036,75	350.322,27	272.126,40	0,15%	917.294,33	-588.009,19	344.808,59	-347.631,03
Total Var:	4.853.701.036,34	216.723.528,37	178.063.995,80	99,98%	-33.312.849,06	58.823.323,35	282.130.312,88	-310.248.907,90

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: EMBRAERPREV RENDA FIXA
CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais			
PL:	3.421.075.187,22	VAR / PL:	3,3814%
VAR:	115.681.050,60	ETL / PL:	4,2404%
ETL:	145.068.704,44	VAR / CDI:	0,0376%
Limite Fundo:		Status:	ENQUADRADO
Benchmark:		Duração DC:	0,00%
		Duração DU:	2.202,07
			1.514,86

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (+):	234.917.992,12	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	194.303.588,14	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	-
Cenário Alta - 09999 (-):	(210.560.809,51)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(2.111.768,38)	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	-	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(221.713.878,70)
Cenário Alta - 09999:	(210.560.809,51)	Cenário Baixa - 10000:	232.806.223,74	CENÁRIO BRADESCO 1:	194.303.588,14	CENÁRIO BRADESCO 2:	(221.713.878,70)

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
GAXA	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
FI RF EMB II	2.873.662.395,20	84.851.564,85	84.438.412,58	72,99%	-154.191.243,87	229.093.001,78	172.840.401,98	-195.635.486,54
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	147.772.891,75	4.000.459,89	3.833.367,28	3,31%	-7.591.938,83	-1.124.572,76	1.748.954,56	-2.310.585,61
FIM EMB VI A CRED PRIV	266.747.081,91	5.736.645,11	5.585.704,57	4,83%	-11.107.552,70	5.624.990,33	6.746.753,29	-7.264.883,97
FIM EMB VII A CRED PRIV	352.169.028,16	22.915.449,40	21.823.556,17	18,87%	-37.670.074,10	-987.195,62	12.967.478,31	-16.502.922,58
Total Var:	3.650.351.396,91	117.506.119,25	115.651.050,60	100,00%	-210.560.809,51	232.806.223,74	194.303.588,14	-221.713.878,70

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – NOVEMBRO 2023



Relatório de Risco de Mercado

Data: 30/11/2023

EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL									
CNPJ: 10679245000140									
Dados Gerais									
PL:	621.384.414,47	VAR / PL:	11,6616%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	2,18		
VAR:	72.463.288,10	ETL / PL:	14,6241%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1,81		
ETL:	90.871.886,71	VAR / CDI:	0,1295%	Benchmark:					
Cenários de STRESS									
Cenário Alta - 09999 (+):	152.493.974,02	Cenário Baixa - 10000 (+):	-	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	81.932.587,06	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	-		
Cenário Alta - 09999 (-):	-	Cenário Baixa - 10000 (-):	(150.374.178,25)	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	-	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(82.606.645,72)		
Cenário Alta - 09999:	152.493.974,02	Cenário Baixa - 10000:	(150.374.178,25)	CENÁRIO BRADESCO 1:	81.932.587,06	CENÁRIO BRADESCO 2:	(82.606.645,72)		
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	
CAIXA	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
FIA RVA EMB II	225.051.161,28	26.801.509,08	26.766.297,79	36,94%	57.944.044,17	-59.539.654,61	32.212.994,97	-32.478.843,37	
FIA RVA EMB III	111.696.625,89	13.077.634,79	13.031.619,97	17,98%	30.514.841,77	-29.622.725,93	14.029.014,61	-14.147.114,64	
FIA RVA EMB IV	106.200.463,28	11.803.522,11	11.642.649,86	16,07%	28.592.562,46	-26.367.143,44	14.274.351,12	-14.391.716,39	
FIC FIA EMB VIII ETF	61.863.060,15	7.351.219,69	7.339.544,92	10,13%	5.565.360,38	-5.565.384,20	4.632.707,53	-4.569.815,02	
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	116.671.903,13	13.704.907,31	13.683.275,56	18,88%	29.877.165,25	-30.279.270,06	16.883.518,83	-17.021.156,30	
Total Var:	621.383.113,73	72.738.792,97	72.463.288,10	100,00%	152.493.974,03	-150.374.178,25	81.932.587,06	-82.606.645,72	



Relatório de Risco de Mercado

Data: 30/11/2023

FI RF EMB II									
CNPJ: 11005764000196									
Dados Gerais									
PL:	2.734.813.537,34	VAR / PL:	3,1026%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	2,439,66		
VAR:	84.851.483,56	ETL / PL:	3,8908%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1,678,30		
ETL:	106.407.183,60	VAR / CDI:	0,0345%	Benchmark:					
Cenários de STRESS									
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (+):	229.677.774,72	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	172.840.236,40	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	-		
Cenário Alta - 09999 (-):	(154.191.096,15)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(584.992,41)	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	-	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(195.635.299,13)		
Cenário Alta - 09999:	(154.191.096,15)	Cenário Baixa - 10000:	229.092.782,31	CENÁRIO BRADESCO 1:	172.840.236,40	CENÁRIO BRADESCO 2:	(195.635.299,13)		
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	
CSMGC3	11.012.662,76	176.717,28	157.100,41	0,19%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
ELET42	14.506.354,54	952.424,52	868.056,49	1,02%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
ENTV12	14.517.128,79	938.073,98	851.107,83	1,00%	-21.949,91	22.385,02	90.605,23	-137.903,21	
GASP17	49.531.521,10	434.431,77	83.219,03	0,10%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
IGSN15	2.750.984,98	174.954,40	159.628,23	0,19%	-373.976,56	-127.736,76	43.242,17	-58.276,56	
NEOE16	7.440.267,00	511.550,44	465.338,22	0,55%	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
NTNB20240815 - 760199_VENCIMENTO	124.122.969,95	319.639,40	123.310,76	0,15%	-1.274.478,21	-110.555,93	362.629,44	-476.293,04	
NTNB20260815 - 760199_VENCIMENTO	42.870.908,53	731.781,66	651.914,12	0,77%	-1.298.143,56	-93.133,10	389.780,40	-508.556,57	
NTNB20300815 - 760199_VENCIMENTO	26.792.897,65	717.299,89	704.772,70	0,83%	-1.470.643,73	1.701.030,24	1.172.835,56	-1.543.554,72	
NTNB20350515 - 760199_VENCIMENTO	237.924.951,12	8.252.981,50	8.225.354,69	9,69%	-282.892,93	-13.087,84	93.756,77	-120.262,26	
NTNB20400815 - 760199_VENCIMENTO	29.997.517,82	1.231.769,76	1.231.211,27	1,45%	-664.878,49	-53.346,78	192.411,56	-252.491,53	
NTNB20450515 - 760199_VENCIMENTO	227.339.850,70	10.687.307,30	10.680.969,08	12,59%	-1.260.421,42	1.259.306,98	837.967,94	-1.128.039,67	
NTNB20500815 - 760199_VENCIMENTO	730.051.624,43	37.876.524,99	37.851.904,03	44,61%	-1.144.217,12	1.256.373,16	872.592,25	-1.155.043,82	
NTNB20550515 - 760199_VENCIMENTO	227.020.795,44	12.881.007,82	12.869.324,84	15,17%	-1.430.447,52	1.575.823,87	1.222.912,79	-1.564.654,92	
PETRA5	9.293.131,68	348.247,44	297.800,26	0,35%	-17.553.219,54	22.058.662,73	17.282.438,24	-21.256.581,12	
SBSPC2	9.970.145,66	112.304,96	94.892,20	0,11%	-2.661.208,75	3.669.274,23	2.836.462,21	-3.353.557,67	
BBTOPIND	330.391.064,23	9.579.501,55	9.531.198,68	11,23%	-20.957.482,11	36.071.195,61	25.457.830,95	-29.192.386,99	
CAIXA	5.000,00	0,00	0,00	0,00%	-17.373.284,31	120.912.412,91	90.977.767,28	-101.165.959,02	
COMPROMISSADA_PRE	778.203.204,15	8.631,17	4.381,74	0,01%	-25.859.722,17	41.152.310,38	30.939.686,49	-33.630.870,58	
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-83.138,29	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-276.951,53	-88.196,34	36.245,58	-48.962,32	
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-287.178,30	-98.935,65	31.081,55	-41.906,13	
Total Var:	2.873.659.642,25	85.935.149,73	84.851.483,56	100,01%	-154.191.096,16	229.092.782,32	172.840.236,40	-195.635.299,13	

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – NOVEMBRO 2023



Relatório de Risco de Mercado

Data: 30/11/2023

FUNDO: FI RF EMB V CREDITO PRIVADO
CNPJ: 20726178000121

Dados Gerais							
PL:	141.485.662,30	VAR / PL:	2,8275%	Limite Fundo:	0,00%	Dutation DC:	732,99
VAR:	4.000.459,89	ETL / PL:	3,5458%	Status:	ENQUADRADO	Dutation DU:	504,23
ETL:	5.016.738,09	VAR / CDI:	0,0314%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (+):	352.274,10	CENARIO BRADESCO 1 (+):	1.748.954,56	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
Cenário Alta - 09999 (-):	(7.591.938,83)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(1.476.846,86)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(2.310.585,61)
Cenário Alta - 09999:	(7.591.938,83)	Cenário Baixa - 10000:	(1.124.572,75)	CENARIO BRADESCO 1:	1.748.954,56	CENARIO BRADESCO 2:	(2.310.585,61)

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
17H0164854	7.843.028,20	198.529,73	195.776,13	4,89%	-442.817,43	-107.144,87	81.350,75	-108.490,47
AEGP23	14.953.694,48	372.005,32	348.410,03	8,71%	-646.606,69	-226.140,36	75.999,10	-102.418,62
CCRDD1	3.160.322,71	56.060,09	43.292,78	1,08%	0,00	0,00	0,00	0,00
CMDT33	1.434.431,68	16.170,60	15.308,69	0,38%	-104.926,08	-19.442,11	17.763,39	-23.945,18
ENJG21	1.931.401,86	40.341,86	39.697,34	0,99%	-41.403,82	-14.260,38	4.486,03	-6.048,33
ENMI21	1.211.880,61	26.071,81	25.635,32	0,64%	-330,27	338,81	1.363,28	-2.074,95
ENTV12	19.083.975,55	1.233.176,42	1.217.324,47	30,43%	0,00	0,00	0,00	0,00
ERDV17_VENCIMENTO	13.082.797,62	294.944,59	277.112,69	6,93%	0,00	0,00	0,00	0,00
ERDV36	2.107.135,29	37.626,03	28.395,91	0,71%	-97.680,97	-25.370,18	16.925,65	-22.601,03
GASP17	10.247.900,92	89.882,44	8.809,07	0,22%	-63.740,66	-16.407,62	11.159,70	-14.898,14
GRRB24_VENCIMENTO	16.198.785,02	1.125.561,75	1.109.737,58	27,74%	-1.706.517,89	-122.431,22	512.398,81	-668.539,99
LFSN16000GM	14.862.722,31	227.715,11	177.486,49	4,44%	-538.686,47	-194.520,52	59.539,38	-80.275,06
LFSN18000DC5	4.913.458,40	86.101,10	80.164,78	2,00%	-70.599,03	-12.750,14	12.074,07	-16.275,27
OMGE21	13.237.506,07	270.115,35	255.518,81	6,39%	-304.271,12	351.937,29	242.655,63	-319.356,15
SBSPC2	7.640.726,70	86.066,09	81.492,66	2,04%	-1.436.641,46	-111.426,12	416.711,55	-547.062,65
TAE33	4.175.492,19	100.507,63	96.247,01	2,41%	-645.253,47	-168.081,71	87.925,86	-118.494,49
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	-299.095,36	-100.861,53	37.373,06	-50.266,92
COMPROMISSADA_PRE	11.709.153,02	129,87	50,23	0,00%	-845.727,75	-258.959,53	125.078,52	-167.609,81
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-22.520,92	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-220.082,13	-75.820,39	23.819,68	-32.115,21
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-127.658,25	-23.240,19	22.330,10	-30.113,35
Total Var:	147.772.891,71	4.261.005,77	4.000.459,89	100,00%	-7.591.938,83	-1.124.572,75	1.748.954,56	-2.310.585,61

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – NOVEMBRO 2023



Data: 30/11/2023

Relatório de Risco de Mercado

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

Dados Gerais										
PL:	251.989.392,01	VAR / PL:	2,2773%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:				
VAR:	5.738.644,65	ETL / PL:	2,8559%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:				771,01
ETL:	7.196.491,91	VAR / CDI:	0,0253%	Benchmark:						530,52

Cenários de STRESS										
Cenário Alta - 09999 (+):	415.091,52	Cenário Baixa - 10000 (+):	6.408.002,36	CENARIO BRADESCO 1 (+):	7.259.984,70	CENARIO BRADESCO 2 (+):	392.968,19			
Cenário Alta - 09999 (-):	(11.522.643,32)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(583.012,50)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(513.231,96)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(7.657.851,57)			
Cenário Alta - 09999:	(11.107.551,80)	Cenário Baixa - 10000:	5.824.989,86	CENARIO BRADESCO 1:	6.746.752,74	CENARIO BRADESCO 2:	(7.264.883,38)			

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
RSAN44	894.214,10	48.017,59	44.689,05	0,78%	-75.473,85	-8.472,87	20.594,64	-26.931,85
SMFT16	2.681.480,41	3.017,53	2.930,00	0,05%	-7.103,01	5.875,91	8.291,41	-11.631,15
SNGO18	1.692.913,39	121,17	115,07	0,00%	-449,86	368,78	619,65	-914,94
TBSP11	2.664.770,44	1.554,02	1.507,55	0,03%	-3.967,90	3.179,11	4.599,96	-6.540,75
UGEL11	1.153.337,12	349,66	337,96	0,01%	-945,22	770,29	1.152,87	-1.666,03
UNEG11	4.789.812,66	342.050,74	324.520,62	5,66%	-663.036,50	49.403,31	281.364,96	-348.820,75
VAMO33	2.891.542,10	224.522,49	204.565,92	3,56%	-305.679,17	-11.393,82	100.824,94	-130.503,05
VCCS11	783.546,82	1.385,31	1.344,48	0,02%	-3.107,59	2.618,33	3.656,59	-5.004,27
VECS11	3.651.856,39	192,33	181,81	0,00%	-751,71	612,67	1.041,60	-1.541,27
VERDECS2	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
VIXL14	1.196.639,69	136,83	130,84	0,00%	-444,43	362,57	583,38	-856,37
VVEO15	1.074.912,76	470,86	456,16	0,01%	-1.189,99	970,04	1.406,42	-2.015,92
VVEO16	1.058.764,73	579,17	561,58	0,01%	-1.425,86	1.166,30	1.671,62	-2.383,54
VVRT11	2.598.354,61	904,96	876,34	0,02%	-2.366,89	1.933,13	2.845,52	-4.084,78
Total Var:	266.747.060,22	7.136.035,68	5.738.644,65	99,98%	-11.107.551,81	5.824.989,86	6.746.752,74	-7.264.883,37

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – NOVEMBRO 2023

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

Dados Gerais			
PL:	292.786.595,57	VAR / PL:	7,8155%
VAR:	22.882.833,62	ETL / PL:	9,8010%
ETL:	28.695.996,54	VAR / CDI:	0,0868%
Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	1.968,12
Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1.353,89
Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (+):	619.267,30	CENARIO BRADESCO 1 (+):	12.949.021,58	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
Cenário Alta - 09999 (-):	(37.616.457,93)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(1.605.057,84)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(16.479.433,81)
Cenário Alta - 09999:	(37.616.457,93)	Cenário Baixa - 10000:	(985.790,54)	CENARIO BRADESCO 1:	12.949.021,58	CENARIO BRADESCO 2:	(16.479.433,81)

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
ANEM11	11.213.435,64	721.592,92	718.817,94	3,14%	-1.348.274,22	47.174,24	530.436,15	-662.758,92
ANET11	2.254.933,14	89.634,15	88.028,37	0,39%	-148.219,51	-25.062,45	33.623,19	-44.461,37
ASAB11	6.780.803,13	395.707,00	395.412,62	1,73%	-609.989,04	-39.469,38	192.021,04	-247.830,94
BRKP28	9.434.696,60	729.728,28	725.023,80	3,17%	-1.236.867,68	-2.096,80	460.038,01	-584.343,72
BTOW15	5.466.896,02	503.208,94	501.801,66	2,19%	-716.612,72	-7.469,10	254.831,06	-327.764,88
CAEC21	9.083.639,12	518.811,20	514.284,36	2,25%	-756.319,32	-88.065,44	200.946,65	-264.729,43
CAIXA	1.000,02	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CART13	10.308.220,67	699.082,80	698.818,82	3,05%	-1.126.086,61	-27.973,46	390.028,51	-498.506,19
CBAN32	16.560.679,62	1.233.591,09	1.232.595,40	5,39%	-1.864.567,19	-41.960,30	647.880,00	-830.384,09
CBAN72	4.853.300,21	368.266,70	367.938,21	1,61%	-563.773,75	-9.219,99	199.160,63	-254.808,31
CJEN13	7.323.862,57	473.084,03	472.847,03	2,07%	-786.630,23	-19.719,27	272.589,71	-347.745,50
CNRD11	8.722.152,72	604.041,14	602.498,88	2,63%	-1.033.543,16	-1.043,98	379.087,99	-481.012,39
COMPROMISSADA_PRE	5.750.889,54	63,78	25,25	0,00%	-162,21	165,42	669,57	-1.019,10
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-140.253,58	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CONX12	7.106.763,36	398.261,63	396.330,96	1,73%	-589.382,72	-69.462,59	157.131,38	-206.620,49
CREDZM24	210.806,29	110.906,62	96.183,54	0,42%	0,00	0,00	0,00	0,00
CRMGM15	9.795.167,10	511.156,44	509.436,17	2,23%	-788.725,06	-83.893,89	220.666,54	-287.935,07
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ERDV17	9.951.648,06	224.354,52	203.659,55	0,89%	-409.760,84	-147.965,28	45.299,62	-61.062,56
ERDV38	5.995.056,48	110.457,76	103.189,56	0,45%	-360.058,82	-110.448,75	51.574,89	-89.183,01
GBSP11	5.157.126,92	361.086,35	357.464,01	1,56%	-760.975,43	92.266,13	347.230,19	-421.130,80
GRRB24	8.534.701,88	593.028,05	586.098,66	2,56%	-756.874,86	-58.707,41	219.554,05	-288.232,52
HARG11	10.897.359,03	717.869,68	715.433,94	3,13%	-1.279.647,40	19.264,87	483.307,10	-609.089,89
HBSA21	7.850.235,57	621.477,43	619.739,65	2,71%	-876.757,45	-28.496,55	294.414,89	-380.109,59
HVRD15	11.319.212,64	888.325,82	887.818,73	3,88%	-1.403.781,48	2.910,69	513.094,32	-653.676,83
IPL11	8.427.204,09	486.646,81	486.621,11	2,13%	-802.279,21	-39.753,52	261.615,24	-335.341,84
IRBR12	11.846.493,83	281.577,29	259.564,69	1,13%	-806.516,31	-207.029,73	144.674,62	-193.168,84
ITPO14	8.639.104,05	674.736,86	673.344,49	2,94%	-1.144.724,25	33.862,81	444.389,28	-560.574,91
LAMEA6	9.380.760,85	690.960,77	689.299,10	3,01%	-981.386,56	-43.691,91	321.082,90	-415.153,44
LCAMD1	11.464.294,60	899.200,97	896.451,04	3,92%	-1.257.211,68	-44.526,81	418.766,54	-541.089,14
LORTA7	6.508.433,10	520.711,53	519.075,95	2,27%	-727.743,69	-25.210,91	243.123,84	-314.174,57
MOVI37	8.843.504,63	680.346,32	678.317,28	2,96%	-954.390,75	-37.041,50	315.379,82	-407.680,79
MTRJ19	9.285.967,66	499.127,50	497.723,50	2,18%	-755.829,08	-69.567,79	219.520,64	-286.756,82
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PASN12	4.550.555,55	207.272,85	206.127,39	0,90%	-324.929,50	-45.904,23	82.008,28	-107.717,02
PEJA11	5.064.537,61	361.001,61	360.125,51	1,57%	-516.496,50	-26.080,67	165.896,55	-214.746,33
QUAT12	3.966.298,05	74.753,55	66.304,37	0,29%	-248.594,05	-76.741,96	35.902,82	-48.192,58
RAHD11	12.853.234,80	841.541,45	838.691,66	3,67%	-1.581.269,98	66.191,34	629.811,04	-783.915,56
RDVE11	7.758.558,68	486.887,76	486.283,83	2,13%	-859.764,17	-4.166,56	310.184,22	-392.182,16
RMSA12	11.566.175,28	879.879,77	871.762,59	3,81%	-1.815.719,76	196.996,57	816.654,30	-998.668,91
RSAN44	10.769.070,03	578.278,47	576.040,26	2,52%	-908.935,78	-102.039,30	248.022,40	-324.341,73
TCI11	10.208.090,07	678.569,06	675.913,38	2,95%	-1.297.673,70	76.251,07	532.996,66	-658.916,21
UNEG11	5.790.702,33	413.552,31	410.143,93	1,79%	-801.636,26	59.730,47	340.180,91	-421.737,51
UTPS21	6.510.834,73	487.879,29	486.612,40	2,13%	-827.011,69	19.162,59	317.699,17	-401.176,93
VAMO33	8.899.923,96	691.061,40	687.774,87	3,01%	-940.854,83	-35.069,24	310.330,71	-401.677,44
VAMO34	7.297.524,44	561.608,65	560.091,48	2,45%	-796.106,60	-29.865,51	264.202,02	-341.328,41
VERDECS2	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
VERO12	4.962.600,21	311.598,99	309.297,95	1,35%	-433.780,64	-39.942,78	123.304,77	-161.565,16
VIMI13	7.478.067,14	506.232,14	505.454,56	2,21%	-856.120,20	5.291,10	317.344,04	-401.753,67
VRON12	5.189.631,09	348.725,71	348.575,96	1,52%	-560.493,10	-16.580,77	192.355,32	-246.169,27
Total Var:	361.653.549,52	23.035.887,39	22.882.833,62	100,02%	-37.616.457,93	-985.790,54	12.949.021,58	-16.479.433,81

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – NOVEMBRO 2023



bradesco

Data: 30/11/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIM EMB II A
CNPJ: 20725957000102

Dados Gerais	
PL: 197.933.292,19	VAR / PL: 0,4939%
VAR: 977.573,72	ETL / PL: 0,6194%
ETL: 1.225.916,88	VAR / CDI: 0,0055%
Limite Fundo: 0,00%	Dutacion DC: 719,11
Status: ENQUADRADO	Dutacion DU: 494,66
Benchmark:	

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+): 3.424.158,78	Cenário Baixa - 10000 (+): 5.180.135,76	CENARIO BRADESCO 1 (+): 5.996.813,55	CENARIO BRADESCO 2 (+): 5.611.760,52		
Cenário Alta - 09999 (-): (5.483.363,79)	Cenário Baixa - 10000 (-): (2.819.021,36)	CENARIO BRADESCO 1 (-): (4.281.605,95)	CENARIO BRADESCO 2 (-): (7.996.813,57)		
Cenário Alta - 09999: (2.059.205,01)	Cenário Baixa - 10000: 2.361.114,40	CENARIO BRADESCO 1: 1.715.207,60	CENARIO BRADESCO 2: (2.385.053,05)		

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
CDB323RSITI	6.295.809,96	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	673.739,66	7,47	3,89	0,00%	-19,00	19,38	76,44	-119,39
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-30.618,67	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CRGT16	149.977,88	23,83	-23,11	0,00%	135,85	-113,55	-206,42	312,46
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DHF24	-0,01	40,59	12,03	0,00%	-295,47	302,25	1.187,58	-1.802,34
DHF25	13.240,73	89.902,09	88.046,36	9,01%	-309.135,44	243.666,56	376.993,53	-554.412,47
DHF26	-113,94	1.662,00	-1.595,49	-0,16%	3.843,84	-3.114,49	-4.279,81	6.110,88
DHF27	151,76	4.937,32	4.611,39	0,47%	-10.413,94	8.719,27	11.703,59	-16.198,37
DHF29	122,20	9.866,27	8.810,81	0,90%	-20.613,68	18.039,35	24.999,85	-32.353,54
DHF33	1.255,83	96.864,30	-82.190,56	-8,41%	193.815,77	-182.261,22	-265.128,57	299.653,75
DHJ24	13,18	80,07	74,69	0,01%	-783,60	755,50	1.744,65	-2.625,86
DHJ25	-13.982,35	116.099,62	-113.099,34	-11,57%	336.354,79	-267.412,93	-399.138,72	582.798,65
DHN24	51,84	298,48	288,23	0,03%	-1.838,76	1.564,60	2.900,07	-4.330,51
DHN25	-74.793,24	811.198,77	-786.728,54	-80,48%	2.129.614,73	-1.693.415,95	-2.456.419,51	3.561.484,51
DHN26	-15.564,99	323.431,06	-305.798,19	-31,28%	705.954,59	-578.687,32	-787.026,16	1.106.940,43
DHN27	66,19	2.700,89	2.493,00	0,26%	-5.716,66	4.829,76	6.565,44	-8.938,94
DIV24	44,45	347,75	340,45	0,03%	-1.484,62	1.199,73	2.000,19	-2.963,37
DIV25	91,84	1.403,16	1.354,88	0,14%	-3.406,18	2.726,24	3.858,42	-5.550,37
ERDV18	1.346.506,65	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
IDIF24P381200	54.459,84	12.623,51	-3.742,13	-0,38%	54.439,21	-94.015,91	-369.406,77	54.459,84
IDIF24P381300	94.880,40	12.626,01	3.742,87	0,38%	-82.927,23	94.039,94	369.503,04	-94.880,40
LF002306J15	10.456.688,13	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306SWQ	10.467.326,84	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306U55	6.283.277,20	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20260301 - 210100	282.429,12	160,63	-120,28	-0,01%	-1.615,55	2.844,54	72,52	-110,37
LFT20260901 - 210100	1.664.128,94	1.257,66	-833,21	-0,09%	-9.828,19	22.388,83	990,87	-1.507,44
LTN20250401 - 100000	12.122.869,59	115.828,86	112.833,11	11,54%	-341.042,06	276.142,72	408.651,67	-596.644,64
LTN20250701 - 100000	62.367.415,80	780.972,33	758.153,69	77,55%	-2.096.488,09	1.737.103,44	2.472.036,67	-3.583.405,03
LTN20260701 - 100000	12.405.997,93	311.955,73	296.360,70	30,32%	-695.906,41	621.887,54	813.195,54	-1.142.911,15
NTNB20240815 - 760199_NEGOCIACAO	12.985.198,20	33.439,27	24.071,06	2,46%	-131.859,74	131.638,49	87.664,51	-118.010,44
NTNB20250815 - 760199_NEGOCIACAO	19.217.567,91	142.961,62	134.816,03	13,79%	-344.995,13	372.815,47	231.903,04	-310.224,08
NTNB20260815 - 760199_NEGOCIACAO	22.284.298,25	380.380,11	379.892,11	38,86%	-594.764,06	653.062,77	453.568,25	-600.391,78
NTNB20270815 - 760199_NEGOCIACAO	5.221.639,67	107.103,11	106.491,71	10,89%	-169.720,26	191.812,53	135.795,76	-178.527,26
NTNB20280815 - 760199_NEGOCIACAO	13.085.023,93	303.304,92	294.887,68	30,17%	-532.803,44	595.008,31	441.239,16	-573.929,22
NTNB20290815 - 760199_NEGOCIACAO	1.204.965,95	62.516,02	54.419,89	5,57%	-127.706,27	199.568,55	150.160,77	-166.876,60
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
Total Var:	198.444.247,18	3.723.993,45	977.573,72	100,00%	-2.059.205,01	2.361.114,40	1.715.207,60	-2.385.053,05

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – NOVEMBRO 2023



Data: 30/11/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIM EMB III A IMOBILIÁRIO
CNPJ: 32711990000162

Dados Gerais	
PL:	67.702.092,05
VAR:	2.095.690,65
ETL:	2.628.080,62
VAR / PL:	3,0955%
ETL / PL:	3,8818%
VAR / CDI:	0,0344%
Limite Fundo:	0,00%
Status:	ENQUADRADO
Benchmark:	
Dutacion DC:	1,00
Dutacion DU:	1,00

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	34.033.353,76	Cenário Baixa - 10000 (+):	7,37	CENARIO BRADESCO 1 (+):	8.107.322,94
Cenário Alta - 09999 (-):	(7,23)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(34.033.360,94)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-
Cenário Alta - 09999:	34.033.346,53	Cenário Baixa - 10000:	(34.033.353,57)	CENARIO BRADESCO 1:	8.107.322,94
				CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	(8.173.701,08)
				CENARIO BRADESCO 2:	(8.173.701,08)

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

Produto	MiM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
AIEC11	2.029.160,00	107.260,23	60.622,90	2,89%	1.014.580,00	-1.014.580,00	297.474,86	-299.909,85
BMLC11	3.286.707,99	115.197,69	-50.960,88	-2,43%	3.286.707,99	-3.286.707,99	481.831,39	-485.775,44
BPML11	2.239.176,00	125.397,90	61.642,91	2,94%	2.239.176,00	-2.239.176,00	328.263,20	-330.950,21
ETLG11	1.752.720,24	32.733,53	-12.473,28	-0,69%	0,00	0,00	0,00	0,00
CAIXA	1.000,76	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CEOC11	637.155,50	72.149,58	-60.726,34	-2,90%	318.577,75	-318.577,75	93.407,00	-94.171,58
CNES11	351.387,30	40.421,81	-33.934,83	-1,62%	175.693,65	-175.693,65	51.513,38	-51.935,04
COMPROMISSADA_PRE	256.341,27	2,84	-1,13	0,00%	-7,23	7,37	29,85	-45,43
CONTAS_A PAGAR_RECEBER	1.021.005,92	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
FVPQ11	1.203.518,40	84.263,63	73.296,14	3,50%	601.759,20	-601.759,20	176.435,80	-177.880,02
GALG11	468.113,81	9.424,08	-4.826,33	-0,23%	234.056,91	-234.056,91	68.625,49	-69.187,22
HBRH11	3.713.276,73	179.582,52	-137.441,69	-6,56%	3.713.276,73	-3.713.276,73	544.366,37	-548.822,30
HSLG11	1.182.575,11	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
MALL11	4.463.755,20	69.952,88	-13.580,21	-0,65%	2.231.877,60	-2.231.877,60	654.386,51	-659.743,02
MAXR11	1.707.470,24	85.231,74	17.054,69	0,81%	853.735,12	-853.735,12	250.315,14	-252.364,10
NEWL11	3.257.662,80	155.162,92	-98.577,93	-4,70%	1.628.831,40	-1.628.831,40	477.573,37	-481.482,56
NEWU11	1.026.021,84	56.755,52	-29.664,44	-1,42%	1.026.021,84	-1.026.021,84	150.414,80	-151.646,03
OULG11	200.785,50	23.825,35	21.284,75	1,02%	100.392,75	-100.392,75	29.435,15	-29.676,10
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PATC11	3.535.888,20	2.083.552,06	1.834.082,06	87,52%	1.767.929,10	-1.767.929,10	518.356,81	-522.599,84
PVBH1	2.452.602,32	131.270,59	120.608,84	5,76%	0,00	0,00	0,00	0,00
PVBH2	8.997,96	9.634,95	-5.607,57	-0,27%	0,00	0,00	0,00	0,00
QAGR11	5.335.003,71	174.459,69	64.653,61	3,09%	2.667.501,86	-2.667.501,86	782.111,54	-788.513,55
RBRL11	2.499.403,64	78.336,79	11.725,80	0,56%	2.499.403,64	-2.499.403,64	366.412,57	-369.411,86
RCRB11	5.959.497,79	185.010,95	139.714,24	6,67%	0,00	0,00	0,00	0,00
TEPP11	5.856.895,06	158.451,61	95.037,04	4,53%	2.928.447,53	-2.928.447,53	858.620,82	-865.649,09
TRXF11	7.803.704,16	241.773,03	-75.488,60	-3,60%	3.901.844,90	-3.901.852,08	1.144.023,03	-1.153.387,48
XPIN11	3.484.672,58	158.092,81	62.069,34	2,96%	1.742.336,29	-1.742.336,29	510.853,00	-515.034,61
XLPG11	285.384,62	8.572,37	2.962,39	0,14%	142.692,31	-142.692,31	41.837,39	-42.179,85
XPPR11	1.917.022,40	123.668,68	54.239,16	2,59%	958.511,20	-958.511,20	281.035,48	-283.335,91
Total Var:	67.936.877,07	4.510.185,76	2.095.690,65	100,00%	34.033.346,53	-34.033.353,57	8.107.322,94	-8.173.701,08

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – NOVEMBRO 2023



Data: 30/11/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO:	FIA RVA EMB II
CNPJ:	1329426800125

Dados Gerais	
PL:	225.051.162,26
VAR:	26.801.509,07
ETL:	33.610.173,65
VAR / PL:	11,9091%
ETL / PL:	14,9345%
VAR / CDE:	0,1323%
Limite Fundo:	0,00%
Status:	ENQUADRADO
Benchmark:	Dutacion DC: 1,00
	Dutacion DU: 1,00

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	57.944.123,22	Cenário Baixa - 10000 (+):	80,62	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	32.212.994,97
Cenário Alta - 09999 (-):	(79,05)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(58.539.735,23)	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	-
Cenário Alta - 09999:	57.944.044,17	Cenário Baixa - 10000:	(58.539.654,61)	CENÁRIO BRADESCO 1:	32.212.994,97
				CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	-
				CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(32.476.843,37)
				CENÁRIO BRADESCO 2:	(32.476.843,37)

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
ABEV3	6.097.594,45	806.024,17	786.836,40	2,94%	853.663,22	-1.829.322,88	893.907,95	-901.224,46
ARZ3	1.370.754,00	205.435,22	183.929,31	0,69%	411.226,20	-411.226,61	200.952,54	-202.597,44
AZUL4	547.236,00	221.728,76	214.645,47	0,80%	328.341,60	-191.532,60	80.224,80	-80.881,48
B3SA3	6.876.485,70	1.592.385,18	1.562.756,88	5,83%	1.719.121,43	-1.719.121,43	1.008.092,80	-1.016.344,59
BBAS3	6.718.626,00	431.658,28	300.012,25	1,12%	1.679.656,50	-1.679.656,50	984.950,67	-993.012,92
BBDC4	7.794.631,60	1.201.311,06	1.142.400,00	4,26%	1.948.657,90	-1.948.657,90	1.142.692,99	-1.152.046,55
BBSE3	1.082.980,00	37.582,88	-1.163,70	0,00%	216.596,00	-216.596,00	158.764,87	-160.064,44
BPAC11	7.211.066,00	1.113.382,58	1.065.083,87	3,97%	2.163.319,80	-2.523.873,10	1.057.142,28	-1.065.795,56
BRFS3	2.923.277,30	747.477,31	659.614,02	2,46%	730.819,33	-730.819,33	428.552,45	-432.060,39
BRIT3	339.900,00	58.618,04	28.042,39	0,10%	159.753,00	-159.753,00	49.829,34	-50.237,22
CAIXA	10.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CBAV3	662.400,00	137.459,68	113.573,23	0,42%	264.944,00	-264.976,00	97.107,84	-97.902,72
COMPROMISSADA_PRE	2.802.774,52	31,09	18,39	0,00%	-79,06	80,62	326,32	-496,67
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	2.506.677,04	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPFE3	2.397.135,00	302.108,27	286.387,46	1,08%	479.427,00	-479.427,00	351.419,99	-354.296,55
CPLE6	2.851.244,00	312.675,72	294.421,81	1,10%	627.273,68	-627.273,68	417.992,37	-421.413,86
CRFB3	1.564.920,00	517.254,70	478.647,09	1,73%	391.230,00	-391.243,80	229.417,27	-231.295,18
CSAN3	2.115.800,00	439.073,22	413.778,38	1,54%	528.950,00	-528.950,00	310.176,28	-312.715,24
CURY3	671.232,00	109.727,32	101.681,29	0,38%	201.369,60	-201.373,44	98.402,61	-99.208,09
CXSE3	2.100.834,00	70.330,23	33.770,69	0,13%	420.166,80	-420.166,80	307.982,26	-310.503,27
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DIRR3	1.224.930,00	249.952,11	228.027,06	0,85%	367.479,00	-367.485,14	179.574,74	-181.044,65
ECOR3	1.600.250,00	335.571,34	325.909,20	1,22%	400.062,50	-400.062,50	234.596,65	-236.516,95
ELET3	5.075.710,92	988.941,50	974.736,87	3,64%	1.522.713,28	-1.522.725,70	744.099,22	-750.190,07
ELET6	3.284.484,00	594.337,40	575.704,20	2,15%	985.345,20	-985.352,82	481.505,35	-485.446,74
ENEV3	1.716.957,00	350.753,79	338.910,13	1,26%	635.274,09	-635.274,09	251.705,90	-253.766,25
ENGH1	1.382.836,00	240.447,20	222.600,98	0,83%	235.082,12	-235.082,12	202.723,76	-204.383,16
EQTL3	6.474.806,00	789.942,66	730.296,80	2,72%	1.294.961,20	-1.294.961,20	949.206,56	-956.976,33
GMAT3	917.575,00	123.829,56	114.288,70	0,43%	165.163,50	-146.812,00	134.516,50	-135.617,59
GOAU4	1.805.168,00	373.873,75	350.899,08	1,31%	541.550,40	-451.309,56	264.637,63	-266.803,83
HAUV3	2.945.764,56	715.622,22	651.495,92	2,43%	1.001.559,95	-1.001.559,95	431.849,08	-435.384,00
ITSA4	4.689.204,00	739.729,37	732.252,21	2,73%	890.900,67	-890.948,76	687.437,31	-693.064,35
ITUB4	18.917.260,83	2.531.278,98	2.482.741,54	9,26%	3.783.452,17	-3.594.279,56	2.773.270,44	-2.795.971,15
JBS3	3.458.290,00	538.886,72	463.817,64	1,73%	1.210.401,50	-1.210.401,50	506.985,31	-511.135,26
KLBN11	1.541.531,00	126.627,28	53.315,80	0,20%	385.382,75	-308.306,20	225.988,45	-227.838,28
LEN3	4.193.175,50	1.464.867,94	1.424.504,50	5,32%	838.635,10	-838.635,10	614.719,53	-619.751,34
MRF3	1.461.888,00	598.602,92	577.881,28	2,16%	584.755,20	-438.566,40	214.312,78	-216.067,05
MRVE3	671.098,00	228.261,84	218.915,21	0,82%	201.329,40	-201.336,34	98.382,97	-99.188,28
MULT3	1.226.269,00	149.462,66	133.481,58	0,50%	367.880,70	-306.567,25	179.771,04	-181.242,56
ONCO3	1.882.475,00	301.316,28	212.724,75	0,79%	658.866,25	-658.866,25	275.970,84	-278.229,81
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PETR3	7.080.060,00	655.593,90	-480.234,16	-1,79%	1.770.015,00	-2.124.018,00	1.037.936,80	-1.046.432,87
PETR4	16.673.242,69	1.430.133,76	-940.211,24	-3,51%	3.918.310,67	-4.701.972,81	2.297.697,38	-2.316.505,27
PRIO3	5.915.784,00	484.477,87	-306.319,51	-1,14%	3.549.470,40	-3.549.470,40	867.253,93	-874.352,88
RADL3	4.395.963,68	540.684,33	437.225,69	1,63%	877.196,74	-877.196,74	642.965,21	-648.246,39
RALL3	2.544.190,00	199.690,18	149.973,33	0,56%	1.144.895,50	-839.552,70	372.979,25	-376.031,28
RDOR3	1.364.590,00	383.056,26	373.240,17	1,39%	409.374,00	-409.374,00	200.047,43	-201.684,92
RENT3	7.378.916,00	1.784.629,30	1.758.161,31	6,56%	2.435.042,28	-1.918.518,16	1.081.749,09	-1.090.603,79
SBS3	3.242.880,00	293.876,39	227.465,24	0,85%	810.720,00	-810.720,00	475.406,21	-479.297,66
SUZ3	2.979.412,00	347.719,45	-153.669,06	-0,57%	744.853,00	-595.882,40	436.781,80	-440.357,09
TIMS3	1.406.784,00	127.578,34	109.745,23	0,41%	450.170,88	-323.560,32	206.234,53	-207.922,68
TOTS3	2.810.797,73	800.168,20	782.469,47	2,92%	562.159,55	-562.159,55	412.062,95	-415.435,90
UGPA3	1.661.450,00	325.805,32	290.295,62	1,08%	415.362,50	-332.290,00	243.568,57	-245.562,31
VALE3	35.802.110,75	5.697.656,06	5.325.588,71	19,87%	8.950.527,69	-8.950.527,69	5.248.589,44	-5.291.551,97
VBBR3	4.177.315,00	288.260,23	219.257,75	0,82%	1.044.328,75	-1.044.328,75	612.394,38	-617.407,16
WEG3	3.453.190,00	360.553,12	272.512,27	1,02%	863.297,50	-863.307,60	506.237,65	-510.381,48
YDUQ3	2.059.225,00	306.709,65	255.267,67	0,95%	803.097,75	-514.806,25	301.882,39	-304.353,46
Total Var:	225.051.161,27	33.772.161,61	26.801.509,07	100,01%	57.944.044,17	-58.539.654,61	32.212.994,97	-32.476.843,37

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – NOVEMBRO 2023



Data: 30/11/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIA RVA EMB III
CNPJ: 38452593000108

Dados Gerais		Limite Fundo:		ENQUADRADO		0,00%		Dutacion DC:		1,00	
PL:	111.696.941,29	VAR / PL:	11,7081%	Status:		Dutacion DU:					
VAR:	13.077.634,79	ETL / PL:	14,6026%	Benchmark:							
ETL:	16.399.881,63	VAR / CDI:	0,1301%								

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	31.444.873,92	Cenário Baixa - 10000 (-):	945.882,36	CENARIO BRADESCO 1 (+):	15.236.800,69	CENARIO BRADESCO 2 (+):	1.214.725,44
Cenário Alta - 09999 (-):	(930.032,15)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(30.568.608,30)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(1.207.786,08)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(15.361.840,08)
Cenário Alta - 09999:	30.514.841,77	Cenário Baixa - 10000:	(29.622.725,93)	CENARIO BRADESCO 1:	14.029.014,61	CENARIO BRADESCO 2:	(14.147.114,64)

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
ALOS3	2.723.093,32	228.939,57	218.742,12	1,67%	0,00	0,00	0,00	0,00
ASAI3	430.569,00	92.593,60	89.876,89	0,69%	120.559,32	-111.951,27	63.121,42	-63.638,10
AURE3	1.225.043,17	105.001,05	96.465,94	0,74%	306.260,79	-379.771,72	179.591,33	-181.061,38
BBAS3	3.383.517,42	217.384,23	152.734,04	1,17%	845.879,36	-845.879,36	496.023,65	-500.083,88
BBSE3	2.651.110,00	92.002,03	-3.237,61	-0,02%	530.222,00	-530.222,00	388.652,73	-391.834,06
BPAC11	2.962.472,24	457.403,24	443.199,80	3,39%	888.741,67	-1.036.865,28	434.298,43	-437.853,40
CAIXA	999,98	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CIEL3	2.244.366,00	437.152,26	355.154,70	2,72%	673.309,80	-561.091,50	329.024,06	-331.717,30
COMPROMISSADA_PRE	5.314.836,28	58,95	35,08	0,00%	-149,91	152,88	618,80	-941,83
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-254.430,40	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DOLF24	-63.308,55	475.524,20	345.260,37	2,64%	-875.183,29	890.098,34	-1.136.739,84	1.143.271,00
ELET3	8.370.375,30	1.630.867,41	1.604.592,47	12,27%	2.511.112,69	-2.511.133,08	1.227.097,02	-1.237.141,47
ENAT3	996.007,00	216.316,70	-174.994,68	-1,34%	348.602,45	-348.602,45	146.014,63	-147.209,84
ENEV3	6.004.425,78	1.226.632,40	1.194.070,84	9,13%	2.221.637,54	-3.062.257,15	880.248,82	-887.454,13
ENGH11	221.676,00	38.544,97	35.666,23	0,27%	37.684,92	-48.768,72	32.497,70	-32.763,71
ENJU3	159.041,00	25.214,87	15.713,94	0,12%	71.568,45	-42.941,07	23.315,41	-23.506,26
EQLT3	9.126.206,70	1.113.420,23	1.036.011,25	7,92%	1.825.241,34	-1.825.241,34	1.337.901,90	-1.348.853,35
FLRY3	1.605.395,00	180.955,00	161.440,51	1,23%	321.079,00	-321.079,00	235.350,91	-237.277,38
HAPV3	939.685,47	228.280,23	210.093,01	1,61%	319.493,06	-319.493,06	137.757,89	-138.885,51
IGTH11	8.919.828,63	1.274.189,58	1.224.518,11	9,36%	1.783.965,73	-1.783.965,73	1.307.646,88	-1.318.350,67
ITUB4	8.564.143,77	1.145.950,11	1.123.921,86	8,59%	1.712.828,75	-1.627.187,32	1.255.503,48	-1.265.780,45
LREN3	2.523.877,49	881.705,82	854.453,42	6,53%	504.775,50	-504.775,50	370.000,44	-373.029,09
LWSA3	98.286,51	14.460,98	12.421,66	0,09%	39.314,60	-39.314,60	14.408,80	-14.526,75
NTCO3	2.541.372,84	834.316,77	795.154,17	6,08%	635.343,21	-635.343,21	372.565,26	-376.614,91
ONCO3	802.900,00	128.515,30	92.287,42	0,71%	281.015,00	-281.015,00	117.705,14	-116.668,62
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PETR4	1.030.617,00	94.040,54	-63.391,24	-0,48%	257.654,25	-309.185,10	151.088,45	-152.325,19
PETZ3	203.196,00	62.880,84	59.035,25	0,45%	50.799,00	-50.799,00	29.788,53	-30.032,37
PRIO3	4.257.711,00	348.688,66	-219.168,79	-1,68%	2.554.626,60	-2.554.626,60	624.180,43	-629.289,69
RAIL3	7.357.770,00	577.501,85	454.197,84	3,47%	3.310.996,50	-2.428.064,10	1.078.649,08	-1.087.478,41
RECV3	3.616.648,20	445.179,50	-178.533,89	-1,37%	2.169.988,92	-2.169.988,92	530.200,63	-534.540,60
RENT3	6.631.598,12	1.603.886,57	1.579.920,12	12,08%	2.188.427,38	-1.724.215,51	972.192,28	-980.150,20
RENT9	48.992,64	12.004,49	11.815,61	0,09%	0,00	0,00	0,00	0,00
SBSPP3	2.060.580,00	186.733,96	142.886,26	1,09%	515.145,00	-515.145,00	302.081,03	-304.553,72
SCAR3	141.010,00	15.778,06	-6.663,78	-0,05%	84.606,00	-84.606,00	20.672,07	-20.841,28
SMFT3	3.139.140,00	597.736,17	579.786,73	4,43%	1.255.656,00	-1.255.656,00	460.197,92	-463.964,89
SOMA3	2.958.135,00	1.280.641,45	1.226.201,73	9,38%	887.440,50	-887.490,05	433.662,59	-437.212,35
SUZB3	8.379.300,46	977.926,43	-434.693,17	-3,32%	2.094.825,12	-1.675.860,09	1.228.405,45	-1.238.460,61
VBBR3	384.294,30	26.518,65	21.071,82	0,16%	96.073,58	-96.073,58	56.337,54	-56.798,70
WDOF24	-3.956,78	29.720,26	21.678,77	0,17%	-54.698,96	55.631,15	-71.046,24	71.454,44
Total Var:	111.696.925,89	17.305.266,92	13.077.634,79	99,99%	30.514.841,77	-29.622.725,93	14.029.014,61	-14.147.114,64

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – NOVEMBRO 2023



Data: 30/11/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIA RVA EMB IV
CNPJ: 38452613000132

Dados Gerais					
PL:	106.200.466,36	VAR / PL:	11,1144%	Limite Fundo:	0,00%
VAR:	11.803.522,11	ETL / PL:	13,9379%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	14.802.092,92	VAR / Cdt:	0,1235%	Benchmark:	Dutacion DU:
					Dutacion DC: 1,00

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	28.592.808,58	Cenário Baixa - 10000 (+):	250,99	CENARIO BRADESCO 1 (+):	14.274.351,12
Cenário Alta - 09999 (-):	(246,11)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(26.367.394,43)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-
Cenário Alta - 09999:	28.592.562,46	Cenário Baixa - 10000:	(26.367.143,44)	CENARIO BRADESCO 1:	14.274.351,12
				CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	(14.391.716,39)
				CENARIO BRADESCO 2:	(14.391.716,39)

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
AJRES3	1.852.937,84	158.819,23	137.405,45	1,16%	463.234,46	-574.423,34	271.640,69	-273.864,21
CAXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	8.725.631,27	96,78	57,26	0,00%	-246,11	250,99	1.015,91	-1.546,25
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	62.749,36	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPLE3	2.311.646,94	272.004,17	264.743,27	2,24%	508.562,33	-508.562,33	338.887,44	-341.661,42
CPLE6	3.447.261,84	378.036,77	360.863,45	3,06%	758.397,61	-758.397,61	505.368,59	-509.505,30
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ENGH1	6.798.539,02	1.182.128,39	1.144.939,56	9,70%	1.155.751,63	-1.495.678,58	996.665,82	-1.004.824,07
EQTL3	10.820.044,56	1.320.072,72	1.280.908,01	10,85%	2.164.008,91	-2.164.008,91	1.586.218,53	-1.599.202,59
GGPS3	6.043.653,00	860.124,21	803.011,69	6,80%	2.719.643,85	-2.719.643,85	885.999,53	-893.251,91
GMAT3	6.192.024,70	835.632,74	765.994,62	6,49%	1.114.564,45	-990.723,95	907.750,82	-915.181,25
HAPV3	5.956.135,20	1.446.939,36	1.333.942,66	11,30%	2.025.085,97	-2.025.085,97	873.169,42	-880.316,78
ITUB4	12.190.486,23	1.631.183,39	1.570.097,94	13,30%	2.438.097,25	-2.316.192,38	1.787.125,28	-1.801.753,87
MATD3	1.186.129,75	208.925,20	179.110,02	1,52%	355.838,93	-355.838,93	173.886,62	-175.309,98
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PRIO3	5.008.620,57	410.185,00	-271.303,71	-2,30%	3.005.172,34	-3.005.172,34	734.263,78	-740.274,12
RAIL3	13.294.755,30	1.043.488,14	878.746,51	7,45%	5.982.639,89	-4.387.269,25	1.949.011,13	-1.964.964,83
RENT3	4.209.464,44	1.018.080,92	999.577,69	8,47%	1.389.123,27	-1.094.460,75	617.107,49	-622.158,84
RENT9	48.632,40	11.916,22	11.704,95	0,10%	0,00	0,00	0,00	0,00
UGPA3	10.815.029,50	2.120.794,59	1.950.361,38	16,52%	2.703.757,38	-2.163.005,90	1.585.483,33	-1.598.461,36
VBRR3	7.235.721,35	499.308,94	392.361,37	3,32%	1.808.930,34	-1.808.930,34	1.060.756,75	-1.069.439,62
Total Var:	106.200.463,27	13.397.736,76	11.803.522,11	99,98%	28.592.562,46	-26.367.143,44	14.274.351,12	-14.391.716,39



Data: 30/11/2023

Relatório de Risco de Mercado

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

Dados Gerais							
PL:	116.572.790,36	VAR / PL:	11,7565%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	7,29
VAR:	13.704.907,30	ETL / PL:	14,7432%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	5,32
ETL:	17.186.506,66	VAR / CDI:	0,1306%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	29.882.658,80	Cenário Baixa - 10000 (+):	8.191,94	CENARIO BRADESCO 1 (+):	16.883.518,82	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
Cenário Alta - 09999 (-):	(5.493,56)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(30.287.462,00)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(17.021.156,30)
Cenário Alta - 09999:	29.877.165,24	Cenário Baixa - 10000:	(30.279.270,06)	CENARIO BRADESCO 1:	16.883.518,82	CENARIO BRADESCO 2:	(17.021.156,30)

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
SUZB3	1.851.484,06	216.081,90	-95.510,40	-0,70%	462.871,02	-370.296,81	271.427,56	-273.649,34
TAEE11	401.424,60	43.858,67	42.273,10	0,31%	100.356,15	-100.356,15	58.846,85	-59.330,55
TMS3	701.599,04	63.626,57	54.960,31	0,40%	224.511,69	-161.367,78	102.854,42	-103.696,34
TOTS3	862.662,38	245.679,75	240.092,95	1,75%	172.532,48	-172.532,48	126.466,31	-127.501,50
UGPA3	1.381.806,25	270.968,03	242.294,04	1,77%	345.451,56	-276.361,25	202.572,80	-204.230,96
USIM5	203.951,28	59.501,66	57.812,93	0,42%	79.541,00	-44.869,28	29.899,26	-30.144,00
VALE3	16.468.919,25	2.620.913,56	2.447.820,47	17,86%	4.117.229,81	-4.117.229,81	2.414.343,56	-2.434.106,27
VAM03	195.915,98	63.946,36	61.210,32	0,45%	68.570,59	-78.366,39	28.721,28	-28.956,38
VBBR3	1.310.775,60	90.451,52	68.395,33	0,50%	327.693,90	-327.693,90	192.169,70	-193.732,63
VIVT3	1.124.421,12	112.383,89	105.869,16	0,77%	168.661,04	-168.665,30	164.840,14	-166.189,44
WEGE3	2.551.633,89	266.420,20	202.218,96	1,48%	637.908,47	-637.915,94	374.069,53	-377.131,49
VDUQ3	292.811,75	43.612,62	36.021,14	0,26%	114.196,58	-73.202,94	42.926,20	-43.277,58
Total Var:	116.571.903,12	17.881.934,74	13.704.907,30	100,00%	29.877.165,24	-30.279.270,06	16.883.518,82	-17.021.156,30

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 – NOVEMBRO 2023



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

30/11/2023

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	627.836,64	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	232.079,81	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	139.247,89	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	20/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	463.798,72	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	25/08/17	25/08/17	15/08/24	PETR	9.169.342,69	AAA	Aaa.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	18/12/17	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	3.210.300,00	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	21/12/17	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	937.050,79	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/01/18	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	3.330.528,13	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB II	19/02/18	19/02/18	15/02/25	SABESP	9.790.360,42	brAAA	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/02/18	19/02/18	15/02/25	SABESP	6.075.988,14	brAAA	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	13/03/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	13.301.952,85	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB II	23/05/18	23/05/18	15/05/28	COMGAS	25.647.424,18	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	654.956,14	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	654.956,14	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	654.956,14	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	653.708,37	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	654.956,14	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	04/07/18	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	12.463.235,27	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/07/18	26/07/18	15/07/25	AEGEA SA	14.359.229,54	brA	Aa1.br	AA(bra)
FI RF EMB II	26/07/18	26/07/18	15/07/25	CSMG	10.724.909,24	-	Aa3.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/02/13	15/02/25	CEMIG	1.386.672,36	brA+	A1.br	AA-(bra)
FIM EMB I A	12/02/19	09/01/19	15/01/25	ITAUBB	2.784.401,60	-	AAA.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	566.967,33	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	3.589.884,51	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	2.044.353,36	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	6.180.761,68	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	715.443,27	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	5.788.586,47	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	8.585.319,25	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	884.548,04	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	620.120,52	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	30/09/20	28/09/20	22/09/25	HAPVIDA	174.058,05	-	-	AAA(bra)
FIM EMB II A	08/01/21	22/05/19	15/04/24	ECORODOV	1.340.775,98	-	-	AA(bra)
FIM EMB II A	05/02/21	07/08/19	15/07/24	COPEL GT	149.360,60	-	-	AA+(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	6.459.380,08	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	6.471.961,82	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	4.256.062,49	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/07/19	15/06/29	NEOENERG	617.805,28	brAA+	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/07/19	15/06/29	NEOENERG	6.141.292,75	brAA+	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	1.762.417,05	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	3.377.905,26	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	3.614.021,32	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	31/07/20	15/07/34	IGUA SAN	2.662.924,06	brAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	23/05/18	15/05/28	COMGAS	22.338.079,12	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	235.277,80	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	414.088,92	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	470.555,59	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	235.277,80	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	287.980,02	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	242.258,72	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	702.878,30	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	26/10/16	27/01/25	BRADESCO	14.303.534,76	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	12/12/17	15/11/24	CCR	3.100.221,02	brAAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	14/12/17	15/11/24	ECORODOV	2.066.263,61	brAA	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	19/02/18	15/02/25	SABESP	1.426.958,23	brAAA	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	23/05/18	15/05/28	COMGAS	9.928.035,16	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	28/06/18	15/06/27	JAGUARA	1.837.678,90	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	28/06/18	15/06/27	ENERGMIR	1.150.574,44	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	31/07/18	01/08/25	BRADESCO	4.619.005,30	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	181.405,44	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	245.100,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	22/12/20	15/12/26	IRB	2.693.872,46	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	120.000,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	856.539,27	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	56.250,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	1.501.626,53	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	07/04/21	15/03/31	LOCALIZA	5.347.939,31	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	1.640.439,40	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/06/21	06/01/21	15/11/25	QUATA	1.070.040,38	-	-	A(bra)

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – NOVEMBRO 2023



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

30/11/2023

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	26/08/20	25/08/25	CSAN	19.534,91	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	211.919,46	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	527.442,46	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	330.342,46	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	330.342,46	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	332.903,48	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	676.633,09	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	666.483,59	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	860.703,64	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	214.925,41	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	131.860,62	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	330.000,38	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	990.347,66	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	14/06/21	19/06/19	19/06/24	BNBBM	585.258,46	brAAA	AAbr	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	14/06/21	12/06/19	12/06/24	BNBBM	887.151,70	brAAA	AAbr	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	15/06/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	60.900,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	16/06/21	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	393.624,56	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	17/06/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	808.347,52	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	17/06/21	18/03/21	15/02/26	CORSAN	784.662,29	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	18/06/21	18/06/21	15/12/30	MG050	554.468,33	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	36.750,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	756.212,21	-	A.br	0
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	190.500,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	86.393,78	-	A.br	0
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	25/06/21	25/06/21	20/06/26	OURO VER	1.508.264,67	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	3.199.769,56	-	A.br	0
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	01/07/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	2.798.731,78	-	A.br	0
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/07/21	01/03/21	18/02/25	RENNER	1.143.418,61	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/07/21	01/03/21	18/02/25	RENNER	241.816,88	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/07/21	07/04/21	15/03/29	CAGECE	1.242.349,52	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	08/07/21	08/07/21	15/06/31	VAMOS	268.514,71	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/07/21	07/04/21	15/03/29	CAGECE	2.831.374,80	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/07/21	08/07/21	15/06/31	VAMOS	5.327.672,89	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	12/07/21	12/07/21	12/07/26	BRADESCO	4.193.960,58	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	2.115.923,16	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	225.922,12	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	1.027.734,11	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	219.300,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	534.421,74	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	193.500,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	283.800,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	141.900,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	1.900.861,94	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	297.148,79	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	4.231.846,33	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	377.832,69	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	377.832,69	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	1.347.055,66	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	909.094,60	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/07/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	2.979.658,77	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	19/07/21	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	620.909,87	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	242.700,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/07/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	1.998.591,64	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/07/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	732.347,48	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	11/06/18	15/05/25	INTERVIA	1.265.489,85	-	Aa2.br	-
FIM EMB I A	21/07/21	17/03/21	05/03/24	ENERG TR	1.306.356,73	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.159.919,93	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	927.632,71	-	-	AA-(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	20/09/19	20/08/26	VAMOS	1.064.596,19	brAA+	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	23/07/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.663.404,99	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/07/21	07/11/19	15/10/24	BKBR	1.016.673,67	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/07/21	23/12/20	15/12/26	RD COLIN	2.203.353,92	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	04/08/21	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	375.814,89	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	06/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	704.587,82	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	11/08/21	11/08/21	15/08/31	CSAN	1.058.584,00	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	11/08/21	19/11/19	15/06/27	AUTOPIST	1.252.244,38	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	17/08/21	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	2.675.608,78	-	-	AA(bra)

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – NOVEMBRO 2023



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

30/11/2023

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	18/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	1.306.919,35	brAA	-	AA-(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	18/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	1.014.158,21	brAA	-	AA-(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	27/08/21	27/08/21	20/08/31	S LUIZ A	1.037.157,50	-	-	AAA(bra)	
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	690.471,56	-	-	AA(bra)	
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	61.833,27	-	-	AA(bra)	
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	309.166,37	-	-	AA(bra)	
FIM EMB I A	16/09/21	17/06/19	15/06/24	PROLAGOS	1.164.914,82	-	-	AA(bra)	
FIM EMB I A	16/09/21	12/05/21	15/04/26	ELETROB	2.006.404,03	brAAA	-	-	
FIM EMB I A	16/09/21	22/10/19	21/10/26	AUTOBAN	540.530,99	brAAA	-	-	
FIM EMB I A	17/09/21	04/10/18	01/10/24	EQUATENE	1.429.092,95	brAA+	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/09/21	20/09/21	15/09/29	MOV_PART	1.070.040,01	brAA+	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.108.936,66	brAA+	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.108.936,66	brAA+	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	1.109.229,94	brAA+	-	AA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	830.801,61	-	-	AA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	830.801,61	-	-	AA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	276.185,40	-	-	AA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	276.185,40	-	-	AA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	784.487,15	-	-	AA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	784.487,15	-	-	AA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	1.008.072,45	-	-	AA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	391.597,38	-	-	AA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	391.597,38	-	-	AA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	23/09/21	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	4.184.421,52	brAAA	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	23/09/21	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	4.240.609,59	brAAA	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	24/09/21	05/04/21	15/03/24	CCPR	41.039,30	-	A.br	-	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	27/09/21	28/12/20	15/01/26	LOCAMERI	1.912.474,07	brAAA	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	27/09/21	29/03/21	01/04/24	CNH	2.456.656,08	-	-	AA+(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	30/09/21	30/09/21	15/09/31	SIMPAR	870.748,36	brAA+	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	04/10/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	691.980,88	brAA	-	AA-(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/10/21	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	2.463.457,54	-	-	AA-(bra)	
FIM EMB I A	20/10/21	20/10/21	20/10/24	DAYCOVAL	2.746.255,96	brAA+	AA.br	AA(bra)	
FIM EMB I A	20/10/21	20/10/21	20/10/24	DAYCOVAL	1.523.359,81	brAA+	AA.br	AA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/10/21	22/10/21	15/12/35	CART	2.352.219,59	brAA+	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	22/10/21	22/10/21	15/12/35	CART	883.516,63	brAA+	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	25/10/21	22/04/21	15/03/26	VIX LOGI	172.352,31	-	-	A+(bra)	
FIM EMB I A	27/10/21	27/10/21	15/10/29	CONT GLO	1.975.493,21	-	-	AA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/10/21	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	1.251.080,83	brAAA	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	04/11/21	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	3.400.229,93	brA	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/11/21	10/11/21	15/10/28	LIGHT	352.635,09	-	-	D	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	12/11/21	12/11/21	15/10/31	VAMOS	2.154.420,01	brAA+	-	AAA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	18/11/21	18/11/21	15/10/31	HIDRO BR	4.148.207,27	-	-	AA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/11/21	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	12.390,36	-	-	AA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/11/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	2.233.268,21	-	-	AA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/11/21	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	2.411.163,69	-	-	AA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	03/12/21	11/06/19	11/06/24	BNBBM	585.891,59	brAAA	AA.br	AA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/12/21	06/12/21	15/12/35	TESC	2.772.175,93	-	-	A+(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/12/21	06/01/21	15/11/25	QUATA	2.500.003,44	-	-	A(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/12/21	20/12/21	15/11/35	ORIZON	2.132.080,81	brAA+	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/01/22	22/04/21	15/03/26	VIX LOGI	991.799,85	-	-	A+(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/01/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.257.319,70	brAA	-	-	
FIM EMB I A	19/01/22	19/01/22	19/01/24	BES INV	1.292.111,15	brAAA	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/01/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	360.705,17	-	-	AAA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/01/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	2.151.831,77	-	-	AAA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	367.175,74	brAA+	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	355.701,50	brAA+	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	3.175.728,23	-	-	AA+(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	849.093,90	brAA+	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	757.299,97	brAA+	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/03/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	1.106.458,98	-	-	AA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	12/04/22	12/04/22	08/04/27	UNIGEL P	286.059,99	BB-	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	19/04/22	19/04/22	16/04/29	VERT-10	736.931,79	-	-	AAAsf(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/04/22	26/04/22	15/04/24	LIGHT	967.787,86	-	-	D	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	111.234,96	brAA	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.284.672,56	brAA	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	12/05/22	12/05/22	15/04/27	BRKA	1.874.765,62	-	A+.br	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	12/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.539.965,90	brAA	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	19/05/22	19/05/22	13/05/28	CEA MODA	477.229,56	-	-	AA-(bra)	

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – NOVEMBRO 2023



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

30/11/2023

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	26/05/22	26/05/22	10/05/27	GUAR	2.342.167,89	-	-	A
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	2.490.725,83	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	581.635,21	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.184.378,75	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	03/03/22	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	3.246.841,91	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/03/22	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	2.533.040,01	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/03/22	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	1.043.986,12	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/03/22	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	3.336.619,49	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/03/22	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	2.670.725,43	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/06/22	06/12/21	15/12/35	TESC	862.744,82	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	465.308,17	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	06/12/21	15/12/35	TESC	541.143,93	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	282.500,17	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	30/09/21	15/09/31	SIMPAP	1.874.400,42	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	08/07/21	15/06/31	VAMOS	914.228,67	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	08/07/21	15/06/31	VAMOS	74.587,42	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	771.650,95	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	872.580,33	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/06/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	1.316.573,86	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	27/06/22	27/06/22	07/07/24	LAGE	2.429.230,15	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	3.228.311,25	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	12/11/21	15/10/31	VAMOS	2.083.324,15	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	12/11/21	15/10/31	VAMOS	1.561.954,51	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	25/07/22	25/07/22	22/07/27	CM HOSPI	1.023.701,58	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/07/22	10/01/22	10/01/28	AMBIPAR	2.499.470,83	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	27/07/22	25/03/22	15/03/44	GBS PART	1.407.197,81	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/07/22	28/07/22	18/07/25	1V11	1.721.645,17	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	29/07/22	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	1.790.940,94	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/08/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	1.215,95	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	525.480,31	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	07/04/21	15/03/29	CAGECE	1.535.603,11	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	07/04/21	15/03/29	CAGECE	2.558.580,76	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/08/22	30/08/22	15/08/29	TRBR	5.776.188,85	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/09/22	02/09/22	02/09/29	AEGEA SA	1.750.069,10	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	27/09/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	52.286,06	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/09/22	28/09/22	28/09/27	B.BRASIL	4.361.691,46	-	AAA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/10/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	36.478,65	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	03/11/22	06/04/21	15/03/29	ANET	1.983.349,73	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	08/11/22	08/11/22	27/10/27	CM HOSPI	999.263,71	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/11/22	08/11/22	15/06/42	BRK AMBI	5.273.545,19	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/11/22	02/05/22	15/04/38	RDVE	1.736.967,42	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/11/22	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	1.605.042,75	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	11/11/22	11/11/22	15/10/40	RAHOLD	2.882.907,64	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	11/11/22	11/11/22	15/10/40	RAHOLD	10.690.922,98	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	3.865.199,61	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	1.739.923,69	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	1.424.635,51	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.420.148,45	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.728.732,10	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.415.724,31	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	01/12/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	1.751.996,64	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	2.150.251,18	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	2.281.077,70	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	1.663.844,91	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/12/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	3.211.789,62	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	15/12/21	15/11/36	ITAPOA T	1.210.950,75	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	02/05/22	15/04/38	RDVE	2.010.105,25	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	3.292.118,16	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/01/23	26/01/23	20/01/26	CELG	3.250.157,90	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/03/23	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	308.591,51	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	1.195.178,95	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	15/12/21	15/11/36	ITAPOA T	3.676.650,09	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	27/07/22	15/04/36	BRV_VDR	8.698.252,50	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/03/23	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.003.849,89	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	14/04/23	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	711.174,31	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	17/04/23	17/04/23	17/03/30	VERO	2.933.913,13	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/04/23	12/05/22	15/04/27	BRKA	1.113.358,96	-	A+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/04/23	12/05/22	15/04/27	BRKA	30.733,86	-	A+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/04/23	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	2.226.557,94	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	1.837.270,34	-	-	AAA(bra)

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – NOVEMBRO 2023



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

30/11/2023

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	06/04/23	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	2.217.838,82	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	18/06/21	15/12/30	MG050	3.363.404,89	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	08/11/22	15/06/42	BRK AMBI	1.311.866,65	-	AA-br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	08/07/21	15/06/31	VAMOS	1.785.835,95	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	773.062,75	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	22/10/21	15/12/35	CART	1.514.599,93	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	2.377.511,02	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	02/10/20	15/09/34	BRKA	294.205,21	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	02/10/20	15/09/34	BRKA	2.808.221,89	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	18/03/21	15/02/31	CORSAN	1.584.136,59	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	22/10/21	15/12/35	CART	654.031,79	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	10/02/21	15/12/31	METRORIO	5.527.442,42	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	18/11/21	15/10/31	HIDRO BR	2.632.516,15	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/05/23	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	219.568,12	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/05/23	08/11/22	15/06/42	BRK AMBI	2.294.916,25	-	AA-br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/05/23	22/10/21	15/12/35	CART	2.157.157,48	brAA+	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.204.668,10	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	16/05/23	23/12/20	15/12/27	SABESP	2.408.221,94	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	21/07/21	15/07/31	CACHOEIR	1.937.616,40	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	29/10/21	15/10/26	COELBA	1.829.673,63	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	04/05/22	15/04/27	LOCAMERI	2.854.918,06	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	23/12/21	21/12/28	SMARTIFI	3.295.157,44	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	18/05/23	12/04/22	08/04/27	UNIGEL P	71.958,09	BB-	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/05/23	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	60.398,82	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/06/23	25/06/21	20/06/26	OURO VER	302.505,06	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/06/23	25/03/22	15/03/44	GBS PART	2.880.131,70	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/06/23	26/07/21	15/06/33	ASA BRAN	2.952.853,84	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	23/06/23	23/06/23	15/05/43	IGUA RJ	1.264.822,62	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/06/23	08/07/21	15/06/31	VAMOS	1.053.813,70	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/06/23	28/07/22	18/07/25	1V11	390.660,77	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/07/23	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	1.516.681,51	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/07/23	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	991.467,13	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/07/23	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	991.467,13	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/07/23	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	1.516.681,51	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/07/23	28/07/22	18/07/25	1V11	1.184.618,24	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/07/23	28/07/22	18/07/25	1V11	289.573,35	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/07/23	23/12/20	15/12/26	RD COLIN	1.641.693,46	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	1.454.712,24	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	1.454.712,24	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	15/12/21	15/11/36	ITAPOA T	2.379.287,40	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	26/07/21	15/06/33	ASA BRAN	2.906.479,22	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	01/08/23	31/07/23	25/07/28	TIMSA	2.560.168,92	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/23	17/04/23	17/03/30	VERO	1.295.189,29	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/23	06/12/21	15/12/35	TESC	2.025.729,59	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/23	02/05/22	15/04/38	RDVE	2.989.144,75	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/08/23	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.292.986,88	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/08/23	05/06/18	05/06/28	BRADESCO	4.090.212,99	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/08/23	08/08/23	15/01/34	SPERIO4	2.410.159,68	brAA+	-	-
FIM EMB II A	29/08/23	29/08/23	29/08/25	BRADESCO	10.335.686,26	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIM EMB II A	30/08/23	30/08/23	01/09/25	VOLKSWAG	6.180.251,20	brAAA	AAA.br	-
FIM EMB II A	06/09/23	06/09/23	08/09/25	BTG PACT	10.307.062,73	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIM EMB II A	08/09/23	08/09/23	08/09/25	B VOTORA	6.178.020,29	brAAA	AA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/09/23	06/01/21	15/11/25	QUATA	2.431,91	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	19/09/23	21/08/23	21/08/25	ABC	5.144.608,04	brAAA	AA+ br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	19/09/23	13/09/23	15/09/25	PANAMERI	5.089.105,65	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/09/23	21/09/23	15/09/28	ELETROB	2.607.951,06	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/09/23	28/09/23	15/09/30	CSMG	2.518.194,23	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/09/23	23/12/21	21/12/28	SMARTIFI	2.555.361,21	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/09/23	19/05/21	10/05/30	RODO BR	2.533.837,89	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/09/23	06/09/21	20/08/31	S LUJZ A	1.482.928,55	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/09/23	13/09/23	15/09/25	B VOTORA	5.088.505,68	brAAA	AA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/10/23	14/11/22	10/10/31	CORREDOR	2.309.180,45	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/10/23	20/10/23	20/10/28	SANTANDE	4.869.759,41	-	AAA.br	A-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/11/23	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	2.966.306,41	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/11/23	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	2.917.666,47	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/11/23	18/03/21	15/02/31	CORSAN	2.957.204,67	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/11/23	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	2.966.800,01	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/11/23	18/06/21	15/12/30	MG050	1.009.132,36	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	17/11/23	23/08/22	15/08/32	PETRJ	4.459.971,92	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	23/11/23	29/09/22	15/09/28	VERT5	2.515.685,57	-	-	AAA(bra)



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

30/11/2023

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	23/11/23	10/12/21	17/11/28	DESKTOP	2.518.392,69	-	A.br	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	-	FIDC VERDECARD SN3	705.154,98	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	-	FIDC CREZ SN6	2.135.949,62	brAA (sf)	-	A+sf(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	FIDC VERDECARD SN5	175.092,38	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	VERDECARD FIDC SN6	1.167.305,25	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	FIDC VERDECARD SN8	1.375.723,19	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	RB CAP CREDIT AL SN3	693.387,54	brAA-(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	BR ELETRO FIDC S1	2.395.970,47	-	-	Aasf(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	INSS CONS PDL I FIDC	2.075.490,93	-	-	AAAsf(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	-	-	-	DRIVER SIX FIDC SN	1.594.108,02	-	AAA.br	-

Observação: Em novembro 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 **4.695.978.275,49**

Tópico do Enquadramento	Limite	Aplicação Atual	Valor Limite	% Aplicado	Status
% do Segmento RF/PL PLANO	100,00%	3.994.086.663,92	4.695.978.275,49	85,05%	Enquadrado
% do PL em Títulos de Emissão do Tesouro Nacional e/ou do BAC	100,00%	3.249.588.419,94	4.695.978.275,49	69,20%	Enquadrado
% do PL em Títulos RF1, exceto títulos do Tesouro Nacional	80,00%	744.498.243,98	3.756.782.676,37	15,85%	Enquadrado
% do PL em FIDC	20,00%	Verificar Rel. de Diversificação de FIDC's	939.195.669,09	0,00%	Enquadrado
% do PL em uma mesma pessoa jurídica não-financeira	10,00%	ficar Rel. de Diversificação Inst. Não Financ.	469.597.834,55	0,00%	Enquadrado
% do PL em Instituições Financeiras	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Financ.	1.173.994.568,87	0,00%	Enquadrado
% de uma mesma Série de Debêntures	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Debêntures	1.173.994.568,87	0,00%	Enquadrado
% do PL em RV	70,00%	596.597.061,91	3.287.184.736,86	12,70%	Enquadrado
% do capital votante de uma empresa	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação RV	1.173.994.568,87	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Imobiliários	20,00%	74.766.739,14	939.195.669,09	1,59%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Empréstimos	15,00%	25.140.890,56	704.396.769,31	0,54%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Estruturados	20,00%	0,00	939.195.669,09	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos no Exterior	10,00%	0,00	469.597.834,55	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 NOVEMBRO DE 2023 À 30 DE NOVEMBRO 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
01/11/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Compra	6,1490%	6,0523%	5,9151%	6,4086%	0,0967%	NÃO
01/11/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Compra	6,1490%	6,0523%	5,9151%	6,4086%	0,0967%	NÃO
01/11/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Compra	6,1490%	6,0523%	5,9151%	6,4086%	0,0967%	NÃO
01/11/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Compra	6,1490%	6,0523%	5,9151%	6,4086%	0,0967%	NÃO
01/11/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Compra	6,1490%	6,0523%	5,9151%	6,4086%	0,0967%	NÃO
01/11/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Compra	6,1490%	6,0523%	5,9151%	6,4086%	0,0967%	NÃO
01/11/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Compra	6,1490%	6,0523%	5,9151%	6,4086%	0,0967%	NÃO
01/11/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Compra	6,1490%	6,0523%	5,9151%	6,4086%	0,0967%	NÃO
01/11/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Compra	6,1490%	6,0523%	5,9151%	6,4086%	0,0967%	NÃO
01/11/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Compra	6,1490%	6,0523%	5,9151%	6,4086%	0,0967%	NÃO
01/11/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,9895%	5,9727%	5,8469%	6,1815%	0,0168%	NÃO
01/11/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,9895%	5,9727%	5,8469%	6,1815%	0,0168%	NÃO
03/11/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Venda	6,1310%	5,9500%	5,8005%	6,2941%	0,1810%	NÃO
03/11/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Venda	6,1310%	5,9500%	5,8005%	6,2941%	0,1810%	NÃO
16/11/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,8495%	5,7909%	5,6812%	6,0146%	0,0586%	NÃO
16/11/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,8595%	5,7909%	5,6812%	6,0146%	0,0686%	NÃO

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE NOVEMBRO DE 2023 À 30 DE NOVEMBRO 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
13/11/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	LFT	01/03/2026	Venda	0,0405%	0,0424%	0,0259%	0,0747%	-0,0019%	NÃO
13/11/2023	FIM EMB II A	BNP	LIQUIDEZ	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,8795%	5,9365%	5,7451%	6,0787%	-0,0570%	NÃO
16/11/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2025	Compra	5,9620%	5,9931%	5,7151%	6,3138%	-0,0311%	NÃO
16/11/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2026	Compra	5,6442%	5,6629%	5,4910%	5,9853%	-0,0187%	NÃO
16/11/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2028	Compra	5,6200%	5,6400%	5,4568%	5,9453%	-0,0200%	NÃO
17/11/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	LFT	01/09/2025	Venda	0,0075%	0,0092%	-0,0057%	0,0499%	-0,0017%	NÃO
17/11/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	LFT	01/03/2026	Venda	0,0424%	0,0410%	0,0276%	0,0762%	0,0014%	NÃO
17/11/2023	FIM EMB II A	BNP	CONCORDI	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,7995%	5,7741%	5,6323%	5,9655%	0,0254%	NÃO
30/11/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	LFT	01/03/2026	Venda	0,0449%	0,0446%	0,0311%	0,0844%	0,0003%	NÃO

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – NOVEMBRO 2023



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE NOVEMBRO DE 2023 À 30 DE NOVEMBRO DE 2023



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBovespa			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
10-11-23	FIA RVA EMB IV	Venda	IGTI11	20,85	7.158,00	149.215,27	20,65	20,84	21,25	26.179,00
10-11-23	FIA RVA EMB IV	Venda	IGTI11	20,90	6.964,00	145.556,99	20,65	20,84	21,25	26.179,00
10-11-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ITUB4	29,71	34.800,00	1.033.838,00	29,27	29,65	29,87	47.346,00
10-11-23	FIA RVA EMB IV	Compra	PRI03	46,48	11.100,00	515.938,00	45,03	46,28	46,90	34.018,00
10-11-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	21,25	6.266,00	133.163,00	21,08	21,30	21,81	39.945,00
10-11-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	21,55	3.560,00	76.718,00	21,08	21,30	21,81	39.945,00
10-11-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	21,32	3.791,00	80.839,40	21,08	21,30	21,81	39.945,00
13-11-23	FIA RVA EMB II	Compra	CRFB3	10,60	12.800,00	135.675,88	10,47	10,61	10,86	10.413,00
13-11-23	FIA RVA EMB II	Venda	GMAT3	6,00	72.200,00	433.201,38	5,96	6,00	6,08	11.479,00
13-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	24,48	1.700,00	41.612,85	24,37	24,56	24,81	11.003,00
13-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALPA4	9,14	3.400,00	31.061,52	9,02	9,12	9,30	6.277,00
13-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	12,58	1.300,00	16.351,69	12,46	12,61	12,82	18.005,00
13-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	13,77	1.400,00	19.276,88	13,56	13,75	13,88	5.570,00
13-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	50,08	500,00	25.040,50	49,83	50,06	50,29	14.410,00
13-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBSF3	31,53	800,00	25.224,00	31,17	31,49	31,79	11.782,00
13-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	33,51	1.000,00	33.509,42	33,31	33,51	33,95	12.211,00
13-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	3,85	7.600,00	29.280,00	3,82	3,86	3,93	17.529,00
13-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	3,90	9.400,00	36.636,68	3,82	3,86	3,93	17.529,00
13-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	38,25	1.300,00	49.723,32	37,25	37,95	38,50	24.277,00
13-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	38,10	800,00	30.480,64	37,25	37,95	38,50	24.277,00
13-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	38,27	1.000,00	38.270,00	37,25	37,95	38,50	24.277,00
13-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENAT3	15,63	2.400,00	37.503,02	15,35	15,62	15,94	6.617,00
13-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	11,79	3.600,00	42.459,12	11,63	11,76	11,90	13.511,00
13-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	50,19	400,00	20.077,00	49,45	50,01	50,51	6.616,00
13-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	16,79	1.000,00	16.788,88	16,40	16,57	17,05	15.588,00
13-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,38	4.200,00	18.400,45	4,28	4,35	4,45	31.793,00
13-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	20,60	3.000,00	61.787,74	20,44	20,61	20,98	16.013,00
13-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	20,60	2.300,00	47.388,34	20,44	20,61	20,98	16.013,00
13-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	29,36	2.700,00	79.280,25	29,17	29,36	29,52	29.798,00
13-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	LREN3	13,38	2.600,00	34.800,22	12,87	13,26	13,52	36.603,00
13-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	ONCO3	10,24	1.600,00	16.386,00	9,94	10,22	10,35	9.090,00
13-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETRA	35,26	4.200,00	148.072,90	34,67	35,41	35,75	108.709,00
13-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	46,59	600,00	27.952,82	46,21	46,48	46,92	17.052,00
13-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,76	2.200,00	50.082,70	22,53	22,80	23,19	24.753,00
13-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	18,88	1.200,00	22.657,98	18,62	18,81	19,26	10.029,00
13-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	18,76	800,00	15.008,00	18,62	18,81	19,26	10.029,00
13-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	18,79	1.500,00	28.186,60	18,62	18,81	19,26	10.029,00
13-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	18,81	5.800,00	109.092,18	18,62	18,81	19,26	10.029,00
13-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	55,55	1.100,00	61.109,54	55,30	55,57	56,60	14.616,00
13-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SBSF3	61,77	200,00	12.354,00	60,55	61,82	62,16	7.171,00
13-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	21,91	4.600,00	100.771,43	21,56	21,87	22,07	5.325,00
13-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	6,65	3.400,00	22.624,49	6,44	6,63	6,70	21.405,00
13-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	54,02	1.100,00	59.418,33	53,59	54,12	55,12	16.892,00
13-11-23	FIA RVA EMB IV	Venda	ELET3	37,56	866,00	32.526,96	37,25	37,95	38,50	24.277,00
13-11-23	FIA RVA EMB IV	Venda	ELET3	37,79	2.560,00	96.743,28	37,25	37,95	38,50	24.277,00
13-11-23	FIA RVA EMB IV	Venda	ELET3	37,73	541,00	20.411,93	37,25	37,95	38,50	24.277,00
13-11-23	FIA RVA EMB IV	Venda	IGTI11	20,60	17.410,00	358.676,61	20,44	20,61	20,98	16.013,00
13-11-23	FIA RVA EMB IV	Venda	UGPA3	23,68	1.122,00	26.569,17	23,38	23,71	23,94	22.422,00
13-11-23	FIA RVA EMB IV	Venda	UGPA3	23,63	7.388,00	174.615,08	23,38	23,71	23,94	22.422,00
13-11-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	21,43	1.164,00	24.944,52	21,19	21,39	21,56	25.186,00
13-11-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	21,39	8.328,00	178.128,24	21,19	21,39	21,56	25.186,00
13-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	MAXR11	72,03	1.442,00	103.867,08	71,90	72,04	73,40	60,00
14-11-23	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	60,78	3.900,00	237.040,61	57,75	60,28	61,30	11.331,00
14-11-23	FIA RVA EMB II	Compra	BPAC11	34,20	11.700,00	400.104,00	33,44	34,25	34,71	33.785,00
14-11-23	FIA RVA EMB II	Compra	CRFB3	11,09	19.100,00	211.744,13	10,61	11,04	11,17	14.666,00
14-11-23	FIA RVA EMB II	Compra	CSAN3	18,24	10.200,00	186.033,84	17,88	18,15	18,60	41.562,00
14-11-23	FIA RVA EMB II	Compra	CURY3	16,90	25.500,00	431.044,50	16,71	16,91	17,34	14.335,00
14-11-23	FIA RVA EMB II	Venda	ELET3	39,05	18.500,00	722.333,63	37,96	39,15	39,68	39.848,00
14-11-23	FIA RVA EMB II	Compra	MULT3	26,70	8.000,00	213.614,28	25,81	26,35	26,84	34.312,00
14-11-23	FIA RVA EMB II	Venda	PETR3	38,41	8.400,00	322.604,74	38,10	38,46	38,72	26.197,00
14-11-23	FIA RVA EMB II	Venda	RAIL3	23,38	26.100,00	610.272,35	22,86	23,30	23,59	37.964,00
14-11-23	FIA RVA EMB II	Compra	RENT3	58,93	12.100,00	713.109,32	56,55	59,02	60,47	57.215,00
14-11-23	FIA RVA EMB II	Venda	SUZB3	52,79	10.000,00	527.914,93	52,50	53,24	54,43	33.888,00
14-11-23	FIA RVA EMB II	Compra	VBBR3	21,95	8.800,00	193.135,64	21,52	21,90	22,12	38.023,00
14-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALPA4	9,45	3.800,00	35.901,36	9,02	9,45	9,64	13.243,00
14-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	12,60	1.500,00	18.894,72	12,50	12,70	12,90	30.262,00
14-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	14,01	2.200,00	30.826,51	13,70	14,01	14,15	11.635,00
14-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	50,19	900,00	45.172,69	49,97	50,25	50,94	51.261,00
14-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBSF3	31,65	900,00	28.483,20	31,44	31,62	31,93	33.022,00
14-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	34,11	400,00	13.644,00	33,44	34,25	34,71	33.785,00
14-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	34,15	1.200,00	40.982,75	33,44	34,25	34,71	33.785,00
14-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	CIEL3	3,92	17.500,00	68.613,63	3,82	3,90	3,95	25.960,00
14-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	39,50	4.000,00	157.992,19	37,96	39,15	39,68	39.848,00
14-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	39,02	3.300,00	128.765,33	37,96	39,15	39,68	39.848,00
14-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	39,50	2.500,00	98.754,24	37,96	39,15	39,68	39.848,00
14-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENAT3	15,99	1.100,00	17.590,07	15,45	15,96	16,24	8.914,00
14-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENAT3	16,02	1.200,00	19.220,24	15,45	15,96	16,24	8.914,00
14-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,44	11.600,00	144.288,17	11,83	12,39	12,74	43.566,00
14-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,39	3.000,00	37.161,70	11,83	12,39	12,74	43.566,00
14-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	51,52	1.500,00	77.275,81	50,00	51,32	51,84	19.395,00
14-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	51,38	900,00	46.238,25	50,00	51,32	51,84	19.395,00
14-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	33,81	2.700,00	91.290,97	33,47	33,87	34,25	33.810,00
14-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	16,97	1.800,00	30.542,05	16,56	16,92	17,14	30.881,00
14-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,45	4.000,00	17.807,53	4,32	4,47	4,59	85.937,00
14-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	21,20	1.700,00	36.044,66	20,69	21,22	21,54	33.793,00
14-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	21,20	8.100,00	171.743,61	20,69	21,22	21,54	33.793,00
14-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	29,78	7.300,00	217.404,13	29,43	29,78	30,07	60.758,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – NOVEMBRO 2023

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE NOVEMBRO DE 2023 À 30 DE NOVEMBRO DE 2023



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
14-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	13,97	2.200,00	30.742,02	13,25	13,94	14,15	42.078,00
14-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	14,31	9.000,00	128.826,57	13,81	14,47	15,07	60.637,00
14-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	ONCO3	10,10	1.100,00	11.105,09	9,83	10,10	10,38	27.610,00
14-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETRA	35,92	300,00	10.776,16	35,49	35,88	36,24	96.282,00
14-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	47,07	1.900,00	89.437,72	46,15	46,84	47,34	25.695,00
14-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	23,34	6.500,00	151.729,00	22,86	23,30	23,59	37.964,00
14-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	23,29	3.200,00	74.514,11	22,86	23,30	23,59	37.964,00
14-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	25,46	4.400,00	112.034,17	24,23	25,36	25,85	27.954,00
14-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	19,19	1.900,00	36.455,70	18,62	19,10	19,42	17.196,00
14-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	19,20	2.200,00	42.240,00	18,62	19,10	19,42	17.196,00
14-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	59,28	700,00	41.497,90	56,55	59,02	60,47	57.215,00
14-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	59,22	12.800,00	758.071,48	56,55	59,02	60,47	57.215,00
14-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SBSP3	63,03	400,00	25.212,81	61,79	62,84	63,72	15.388,00
14-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	6,75	700,00	4.726,95	6,61	6,77	6,98	26.539,00
14-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	52,78	3.100,00	163.613,62	52,50	53,24	54,43	33.888,00
14-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	52,67	3.000,00	158.016,54	52,50	53,24	54,43	33.888,00
14-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	52,50	300,00	15.750,00	52,50	53,24	54,43	33.888,00
14-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	VBRR3	21,97	800,00	17.578,89	21,52	21,90	22,12	38.023,00
14-11-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	51,38	4.929,00	253.260,30	50,00	51,32	51,84	19.395,00
14-11-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	51,34	402,00	20.638,99	50,00	51,32	51,84	19.395,00
14-11-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	51,37	592,00	30.413,38	50,00	51,32	51,84	19.395,00
14-11-23	FIA RVA EMB IV	Venda	IGTI11	21,26	1.115,00	23.704,51	20,69	21,22	21,54	33.793,00
14-11-23	FIA RVA EMB IV	Venda	IGTI11	21,07	1.392,00	29.323,10	20,69	21,22	21,54	33.793,00
14-11-23	FIA RVA EMB IV	Venda	IGTI11	21,14	1.392,00	29.430,30	20,69	21,22	21,54	33.793,00
14-11-23	FIA RVA EMB IV	Venda	IGTI11	21,24	7.660,00	162.668,37	20,69	21,22	21,54	33.793,00
14-11-23	FIA RVA EMB IV	Venda	IGTI11	21,24	2.527,00	53.685,39	20,69	21,22	21,54	33.793,00
14-11-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RAIL3	23,29	22.809,00	531.195,51	22,86	23,30	23,59	37.964,00
16-11-23	FIA RVA EMB II	Compra	AZUL4	17,32	32.400,00	561.298,16	16,56	17,00	17,64	31.716,00
16-11-23	FIA RVA EMB II	Venda	BRKM5	19,77	4.900,00	96.889,58	19,48	19,78	20,04	15.761,00
16-11-23	FIA RVA EMB II	Compra	CURY3	16,98	12.900,00	219.082,15	16,74	16,96	17,25	11.410,00
16-11-23	FIA RVA EMB II	Venda	GMAT3	6,18	32.700,00	201.970,76	6,02	6,18	6,31	18.279,00
16-11-23	FIA RVA EMB II	Venda	ITUB4	29,86	14.300,00	426.963,32	29,77	30,19	30,56	98.677,00
16-11-23	FIA RVA EMB II	Compra	MGLU3	2,01	184.800,00	371.448,00	1,76	2,01	2,25	83.578,00
16-11-23	FIA RVA EMB II	Compra	MRVE3	10,73	51.700,00	554.827,49	10,49	10,69	10,86	30.519,00
16-11-23	FIA RVA EMB II	Venda	ONCO3	9,78	41.800,00	408.999,42	9,71	9,84	10,17	8.202,00
16-11-23	FIA RVA EMB II	Venda	PETRA	36,21	8.400,00	304.175,05	35,50	35,81	36,49	116.109,00
16-11-23	FIA RVA EMB II	Venda	RAIL3	23,57	23.800,00	560.849,92	23,32	23,57	23,71	32.230,00
16-11-23	FIA RVA EMB II	Compra	RDOR3	25,78	51.300,00	1.322.328,18	25,34	25,79	26,09	22.281,00
16-11-23	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	73,46	8.500,00	624.431,32	73,01	73,75	74,34	74.871,00
16-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	25,42	900,00	22.876,88	25,15	25,46	25,70	24.637,00
16-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALPA4	9,67	3.400,00	32.869,10	9,44	9,70	9,90	15.804,00
16-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ASA13	13,11	12.900,00	169.124,54	12,55	12,94	13,55	39.063,00
16-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ASA13	12,96	5.200,00	67.392,00	12,55	12,94	13,55	39.063,00
16-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	14,27	5.600,00	79.914,12	14,01	14,30	14,43	14.971,00
16-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	14,32	3.400,00	48.688,00	14,01	14,30	14,43	14.971,00
16-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	50,22	1.400,00	70.304,66	49,86	50,20	50,48	50.106,00
16-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	32,11	1.600,00	51.374,13	31,70	32,09	32,38	21.644,00
16-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	34,05	2.500,00	85.117,99	33,84	34,14	34,79	36.638,00
16-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	3,83	11.500,00	44.032,24	3,78	3,83	3,97	31.799,00
16-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	40,28	2.500,00	100.701,71	39,40	40,31	40,77	46.106,00
16-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENAT3	15,97	1.200,00	19.159,29	15,83	16,29	17,00	10.700,00
16-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,79	2.100,00	26.864,16	12,35	12,80	13,03	28.519,00
16-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	52,03	4.100,00	213.342,62	50,80	52,01	52,50	14.625,00
16-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	51,45	600,00	30.870,00	50,80	52,01	52,50	14.625,00
16-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	34,36	5.800,00	199.291,53	33,95	34,40	34,72	35.249,00
16-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	17,23	2.200,00	37.915,41	16,93	17,16	17,39	20.183,00
16-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,69	6.700,00	31.396,24	4,52	4,66	4,75	88.963,00
16-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	21,50	6.000,00	129.001,34	21,21	21,48	21,65	23.299,00
16-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	21,44	1.400,00	30.014,68	21,21	21,48	21,65	23.299,00
16-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	30,25	7.500,00	226.856,19	29,77	30,19	30,56	98.677,00
16-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	14,37	1.900,00	27.306,51	13,95	14,38	14,58	53.889,00
16-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	14,70	800,00	11.761,59	14,20	14,70	14,94	36.118,00
16-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	ONCO3	9,79	2.000,00	19.574,45	9,71	9,84	10,17	8.202,00
16-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETRA	35,72	1.600,00	57.149,16	35,50	35,81	36,49	116.109,00
16-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	PETZ3	4,26	3.600,00	15.338,20	4,08	4,24	4,32	21.130,00
16-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	45,23	2.500,00	113.063,62	44,56	45,50	46,83	53.420,00
16-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	45,15	1.300,00	58.696,77	44,56	45,50	46,83	53.420,00
16-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	23,51	1.100,00	25.861,00	23,32	23,57	23,71	32.230,00
16-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	23,57	3.600,00	84.849,19	23,32	23,57	23,71	32.230,00
16-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	23,59	3.100,00	73.118,68	23,32	23,57	23,71	32.230,00
16-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	25,74	2.200,00	56.633,40	25,34	25,79	26,09	22.281,00
16-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	19,10	4.200,00	80.213,61	18,88	19,11	19,57	20.163,00
16-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	19,07	2.200,00	41.961,32	18,88	19,11	19,57	20.163,00
16-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	60,81	3.800,00	231.089,81	58,93	60,58	61,28	45.074,00
16-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SBSP3	64,43	700,00	45.101,45	63,02	64,41	65,12	16.538,00
16-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	23,05	200,00	4.610,74	22,73	23,06	23,30	13.180,00
16-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	6,80	14.100,00	95.825,24	6,62	6,79	6,95	32.926,00
16-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	6,78	10.600,00	71.888,37	6,62	6,79	6,95	32.926,00
16-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	53,19	1.400,00	74.468,83	52,53	53,04	53,57	24.200,00
16-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	53,22	2.100,00	111.771,64	52,53	53,04	53,57	24.200,00
16-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	VBRR3	21,86	1.000,00	21.859,94	21,54	21,86	22,12	42.042,00
16-11-23	FIA RVA EMB IV	Compra	CPL66	9,43	33.603,00	316.759,96	9,30	9,41	9,51	48.615,00
17-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	25,44	100,00	2.543,50	25,11	25,28	25,71	18.248,00
17-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ASA13	13,24	6.200,00	82.098,50	13,04	13,17	13,45	21.215,00
17-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ASA13	13,21	700,00	9.249,01	13,04	13,17	13,45	21.215,00
17-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ASA13	13,18	1.200,00	15.816,00	13,04	13,17	13,45	21.215,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – NOVEMBRO 2023



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE NOVEMBRO DE 2023 À 30 DE NOVEMBRO DE 2023

DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
17-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	50,69	300,00	15.208,23	50,22	50,62	50,96	33.685,00
17-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	3,87	9.800,00	37.889,59	3,85	3,86	3,90	26.877,00
17-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	40,73	2.500,00	101.823,02	39,86	40,51	41,21	25.923,00
17-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,99	4.800,00	62.368,86	12,79	12,94	13,20	23.909,00
17-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	13,00	2.800,00	36.400,00	12,79	12,94	13,20	23.909,00
17-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	52,31	1.200,00	62.769,43	51,69	52,19	52,84	9.529,00
17-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	34,27	1.400,00	47.976,39	34,04	34,28	34,67	27.212,00
17-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	21,77	400,00	8.708,83	21,50	21,74	21,95	22.923,00
17-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	21,83	2.000,00	43.661,90	21,50	21,74	21,95	22.923,00
17-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	30,49	5.500,00	167.710,99	30,12	30,45	30,59	44.378,00
17-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	14,41	200,00	2.882,56	14,26	14,47	14,81	30.695,00
17-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	14,48	400,00	5.793,86	14,26	14,47	14,81	30.695,00
17-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	15,34	1.600,00	24.544,00	14,99	15,26	15,47	36.748,00
17-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	15,27	12.700,00	193.937,28	14,99	15,26	15,47	36.748,00
17-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETRA	36,62	2.100,00	76.896,47	35,82	36,53	36,92	115.625,00
17-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	46,19	800,00	36.951,46	45,70	46,27	46,89	36.186,00
17-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	46,45	400,00	18.580,62	45,70	46,27	46,89	36.186,00
17-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	23,29	1.200,00	27.942,00	23,15	23,37	23,81	31.198,00
17-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	25,68	600,00	15.409,32	25,21	25,51	26,43	15.385,00
17-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	19,29	2.200,00	42.447,89	19,05	19,48	19,98	11.851,00
17-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	60,86	2.700,00	164.329,47	60,37	60,82	61,48	29.652,00
17-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	22,90	1.500,00	34.347,15	22,55	22,85	23,35	11.140,00
17-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	6,79	3.700,00	25.127,37	6,70	6,76	6,95	19.520,00
17-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	6,77	14.900,00	100.860,47	6,70	6,76	6,95	19.520,00
17-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	6,76	1.700,00	11.492,00	6,70	6,76	6,95	19.520,00
17-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	53,25	500,00	26.626,26	52,94	53,38	54,22	24.479,00
17-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	53,31	2.900,00	154.600,23	52,94	53,38	54,22	24.479,00
17-11-23	FIA RVA EMB IV	Venda	GGPS3	18,25	15.561,00	283.988,25	18,01	18,22	18,40	7.743,00
17-11-23	FIA RVA EMB IV	Venda	GGPS3	18,20	27.403,00	498.737,30	18,01	18,22	18,40	7.743,00
20-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	25,27	3.600,00	90.988,71	24,75	25,17	25,50	20.128,00
20-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	12,93	4.600,00	59.472,46	12,82	12,92	13,22	23.634,00
20-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	31,95	500,00	15.973,86	31,49	31,88	32,02	14.867,00
20-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	31,89	3.100,00	98.861,54	31,49	31,88	32,02	14.867,00
20-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	33,44	400,00	13.375,60	32,92	33,33	33,79	33.004,00
20-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	3,86	20.500,00	79.072,47	3,84	3,86	3,90	16.708,00
20-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	40,60	600,00	24.357,23	40,25	40,58	41,07	19.325,00
20-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,93	3.200,00	41.371,19	12,85	12,90	13,06	14.120,00
20-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,94	6.200,00	80.228,79	12,85	12,90	13,06	14.120,00
20-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	51,24	1.200,00	61.484,57	50,88	51,23	51,98	11.614,00
20-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	34,16	700,00	23.910,48	33,86	34,14	34,42	29.693,00
20-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	22,11	1.000,00	22.114,39	21,58	22,01	22,19	14.122,00
20-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	30,63	6.500,00	199.112,06	30,25	30,63	30,83	36.821,00
20-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	15,56	2.300,00	35.798,86	15,27	15,63	15,92	28.742,00
20-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	15,77	10.300,00	162.430,56	15,27	15,63	15,92	28.742,00
20-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETRA	36,95	1.600,00	59.118,82	36,27	36,81	37,22	105.265,00
20-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	23,56	800,00	18.847,76	23,09	23,43	23,68	31.202,00
20-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	RDOR3	25,74	2.000,00	51.475,51	25,10	25,88	26,09	14.088,00
20-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	19,89	3.000,00	59.667,47	19,72	19,88	20,10	10.569,00
20-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	19,90	700,00	13.930,92	19,72	19,88	20,10	10.569,00
20-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	60,97	300,00	18.290,56	60,16	60,82	61,27	20.880,00
20-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SBSP3	64,32	200,00	12.863,57	63,75	64,27	64,66	7.711,00
20-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	6,83	1.700,00	11.615,00	6,59	6,82	6,94	17.681,00
20-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	52,66	500,00	26.332,25	52,46	52,82	53,71	21.920,00
20-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	52,77	5.600,00	295.522,82	52,46	52,82	53,71	21.920,00
20-11-23	FIA RVA EMB IV	Venda	GGPS3	18,26	725,00	13.236,26	17,98	18,25	18,43	8.930,00
20-11-23	FIA RVA EMB IV	Venda	GGPS3	18,31	45.189,00	827.280,62	17,98	18,25	18,43	8.930,00
20-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	BPML11	90,77	78,00	7.080,06	90,77	91,80	94,72	11,00
20-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	HBRH11	95,47	122,00	11.647,34	94,99	95,20	95,48	11,00
20-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	HBRH11	94,99	1,00	94,99	94,99	95,20	95,48	11,00
20-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	HBRH11	95,00	147,00	13.965,00	94,99	95,20	95,48	11,00
20-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	MAXR11	71,81	26,00	1.867,06	71,81	72,30	73,84	225,00
20-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	MAXR11	72,50	6,00	435,00	71,81	72,30	73,84	225,00
20-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	MAXR11	72,40	50,00	3.620,00	71,81	72,30	73,84	225,00
20-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	NEWL11	108,70	237,00	25.761,90	107,02	107,89	108,70	1.202,00
20-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	NEWL11	108,05	16,00	1.728,80	107,02	107,89	108,70	1.202,00
20-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	NEWL11	107,42	327,00	35.126,34	107,02	107,89	108,70	1.202,00
20-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	NEWL11	107,16	1,00	107,16	107,02	107,89	108,70	1.202,00
20-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	NEWL11	107,66	2,00	215,32	107,02	107,89	108,70	1.202,00
20-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	NEWL11	107,38	2,00	214,76	107,02	107,89	108,70	1.202,00
20-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	NEWL11	107,50	5,00	537,50	107,02	107,89	108,70	1.202,00
20-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	NEWL11	107,62	4,00	430,48	107,02	107,89	108,70	1.202,00
20-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	NEWL11	107,60	46,00	4.949,60	107,02	107,89	108,70	1.202,00
20-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	NEWL11	107,67	1,00	107,67	107,02	107,89	108,70	1.202,00
20-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	NEWL11	107,65	2,00	215,30	107,02	107,89	108,70	1.202,00
20-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	NEWL11	107,12	5,00	535,60	107,02	107,89	108,70	1.202,00
20-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	NEWL11	107,61	2,00	215,22	107,02	107,89	108,70	1.202,00
20-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	NEWL11	107,13	1,00	107,13	107,02	107,89	108,70	1.202,00
20-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	NEWL11	107,63	1,00	107,63	107,02	107,89	108,70	1.202,00
20-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	NEWL11	107,17	1,00	107,17	107,02	107,89	108,70	1.202,00
20-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	NEWL11	107,51	1,00	107,51	107,02	107,89	108,70	1.202,00
20-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	NEWL11	107,98	189,00	20.408,22	107,02	107,89	108,70	1.202,00
20-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	NEWL11	107,78	1,00	107,78	107,02	107,89	108,70	1.202,00
20-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	NEWL11	107,59	6,00	645,54	107,02	107,89	108,70	1.202,00
20-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	OULG11	32,90	3.833,00	126.105,70	32,81	32,91	33,40	389,00
20-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	OULG11	32,81	2.422,00	79.465,82	32,81	32,91	33,40	389,00
20-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	PATC11	39,75	1.109,00	44.082,75	39,63	40,15	41,95	450,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – NOVEMBRO 2023

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE NOVEMBRO DE 2023 À 30 DE NOVEMBRO DE 2023

DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBV/BOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
20-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	PATC11	40,00	1.539,00	61.560,00	39,63	40,15	41,95	450,00
20-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	QAGR11	47,95	314,00	15.056,30	47,69	47,92	48,10	326,00
20-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	QAGR11	48,05	92,00	4.420,60	47,69	47,92	48,10	326,00
20-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	QAGR11	47,94	63,00	3.020,22	47,69	47,92	48,10	326,00
20-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	QAGR11	47,89	50,00	2.394,50	47,69	47,92	48,10	326,00
20-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	QAGR11	48,04	3,00	144,12	47,69	47,92	48,10	326,00
20-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	QAGR11	47,97	12,00	575,64	47,69	47,92	48,10	326,00
20-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	QAGR11	47,87	1,00	47,87	47,69	47,92	48,10	326,00
20-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	QAGR11	48,10	319,00	15.343,90	47,69	47,92	48,10	326,00
20-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	QAGR11	47,86	26,00	1.244,36	47,69	47,92	48,10	326,00
20-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	QAGR11	47,88	59,00	2.824,92	47,69	47,92	48,10	326,00
20-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	XPPR11	19,04	6.577,00	125.226,08	19,04	19,04	19,11	1.622,00
21-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	12,67	4.300,00	54.487,82	12,61	12,70	12,88	26.528,00
21-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	12,67	2.000,00	25.346,14	12,61	12,70	12,88	26.528,00
21-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	51,10	400,00	20.438,51	50,77	51,14	51,42	41.279,00
21-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBSF3	31,89	3.300,00	105.249,56	31,68	31,89	32,05	10.725,00
21-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	3,83	11.600,00	44.375,97	3,79	3,83	3,89	10.683,00
21-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	40,10	700,00	28.072,67	39,88	40,23	40,65	18.925,00
21-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,60	2.500,00	31.492,79	12,51	12,66	12,90	12.543,00
21-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	51,30	1.000,00	51.300,03	50,83	51,14	51,53	6.728,00
21-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	51,44	300,00	15.432,77	50,83	51,14	51,53	6.728,00
21-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	51,05	600,00	30.627,73	50,83	51,14	51,53	6.728,00
21-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	33,93	1.000,00	33.926,25	33,70	33,94	34,28	13.689,00
21-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	16,92	900,00	15.231,15	16,82	16,97	17,18	10.378,00
21-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,60	32.000,00	147.268,39	4,51	4,59	4,66	69.876,00
21-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	21,73	1.500,00	32.593,36	21,45	21,71	22,04	12.741,00
21-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	30,62	8.200,00	251.057,63	30,51	30,65	30,85	31.284,00
21-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	LREN3	14,41	1.500,00	21.620,56	14,25	14,39	14,62	26.888,00
21-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	15,56	2.800,00	43.572,16	15,40	15,60	15,84	18.027,00
21-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	PETRA	36,36	500,00	18.180,69	35,91	36,27	36,54	62.727,00
21-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	47,69	500,00	23.844,65	46,68	47,68	48,16	19.017,00
21-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,97	7.000,00	160.773,11	22,68	23,02	23,41	38.838,00
21-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,86	1.100,00	25.142,14	22,68	23,02	23,41	38.838,00
21-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	19,79	700,00	13.854,60	19,61	19,86	20,16	7.021,00
21-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	59,70	400,00	23.879,53	59,17	59,83	61,09	25.576,00
21-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	22,12	800,00	17.693,70	21,66	22,01	22,55	8.641,00
21-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	6,60	2.500,00	16.500,00	6,56	6,65	6,88	21.722,00
21-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	6,61	7.700,00	50.924,33	6,56	6,65	6,88	21.722,00
21-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	6,63	4.700,00	31.161,00	6,56	6,65	6,88	21.722,00
21-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	52,91	1.100,00	58.195,82	52,57	52,92	53,48	14.194,00
21-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	52,92	600,00	31.750,47	52,57	52,92	53,48	14.194,00
21-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	52,91	1.800,00	95.230,18	52,57	52,92	53,48	14.194,00
22-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	25,25	1.200,00	30.294,81	24,81	25,38	25,87	24.119,00
22-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	14,67	19.100,00	280.172,27	14,37	14,54	14,95	27.949,00
22-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	51,02	400,00	20.408,98	50,60	51,02	51,36	22.494,00
22-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBSF3	31,99	900,00	28.788,14	31,60	31,97	32,09	14.895,00
22-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBSF3	31,98	3.100,00	99.144,01	31,60	31,97	32,09	14.895,00
22-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	33,18	900,00	29.863,45	32,80	33,27	33,70	24.814,00
22-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	3,86	21.000,00	81.044,68	3,80	3,86	3,93	33.333,00
22-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	40,24	1.600,00	64.384,16	39,89	40,35	40,78	33.815,00
22-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENAT3	15,82	900,00	14.242,00	15,62	15,89	16,28	8.209,00
22-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	13,15	6.200,00	81.505,80	12,75	13,12	13,30	23.551,00
22-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	52,01	1.400,00	72.813,41	51,02	51,93	52,79	9.103,00
22-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	34,40	1.900,00	65.364,87	34,17	34,44	34,71	28.893,00
22-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	17,03	700,00	11.919,03	16,88	17,06	17,37	11.848,00
22-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	21,86	2.800,00	61.210,23	21,62	22,06	22,46	19.500,00
22-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	30,88	4.400,00	135.885,12	30,77	30,98	31,23	53.928,00
22-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	15,00	14.300,00	214.553,25	14,51	14,96	15,28	53.373,00
22-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	16,20	11.000,00	178.252,85	15,74	16,15	16,42	29.113,00
22-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	ONCO3	9,72	1.400,00	13.602,00	9,57	9,77	10,08	7.409,00
22-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	47,08	700,00	32.953,83	46,32	46,88	47,27	29.827,00
22-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,66	2.100,00	47.582,40	22,49	22,67	23,11	33.199,00
22-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,79	200,00	4.557,58	22,49	22,67	23,11	33.199,00
22-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,61	4.300,00	97.232,33	22,49	22,67	23,11	33.199,00
22-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,66	2.600,00	58.905,74	22,49	22,67	23,11	33.199,00
22-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	19,85	1.200,00	23.816,84	19,56	19,83	20,10	12.632,00
22-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	60,99	800,00	48.794,42	60,18	60,73	61,45	27.937,00
22-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SBSF3	65,95	300,00	19.784,70	65,15	65,95	66,36	17.638,00
22-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	22,35	1.000,00	22.349,59	21,99	22,37	23,10	7.843,00
22-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	6,71	4.600,00	30.884,75	6,52	6,73	6,93	23.393,00
22-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	53,20	2.400,00	127.680,53	52,75	53,25	53,43	13.089,00
22-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	53,27	1.100,00	58.595,79	52,75	53,25	53,43	13.089,00
22-11-23	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	14,40	1.613,00	23.227,20	14,37	14,54	14,95	27.949,00
22-11-23	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	14,48	16.571,00	239.959,07	14,37	14,54	14,95	27.949,00
22-11-23	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	14,42	3.521,00	50.757,07	14,37	14,54	14,95	27.949,00
22-11-23	FIA RVA EMB IV	Compra	CPL66	9,36	35.075,00	328.148,73	9,26	9,35	9,44	25.663,00
22-11-23	FIA RVA EMB IV	Compra	CPL66	9,38	38.513,00	361.251,94	9,26	9,35	9,44	25.663,00
22-11-23	FIA RVA EMB IV	Venda	RENT3	60,34	436,00	26.307,41	60,18	60,73	61,45	27.937,00
22-11-23	FIA RVA EMB IV	Venda	RENT3	60,37	3.184,00	192.213,80	60,18	60,73	61,45	27.937,00
22-11-23	FIA RVA EMB IV	Venda	RENT3	60,72	344,00	20.887,68	60,18	60,73	61,45	27.937,00
22-11-23	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	21,83	7.097,00	154.940,41	21,66	21,88	22,05	22.556,00
22-11-23	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	21,97	23.801,00	522.989,02	21,66	21,88	22,05	22.556,00
23-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	25,26	500,00	12.631,03	24,85	25,28	25,67	13.586,00
23-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	13,42	10.300,00	138.241,98	13,03	13,41	13,72	18.783,00
23-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	14,60	500,00	7.300,00	14,40	14,53	14,75	13.484,00
23-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	14,53	6.300,00	91.536,19	14,40	14,53	14,75	13.484,00
23-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	51,06	300,00	15.316,88	50,80	51,13	51,48	12.517,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – NOVEMBRO 2023

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE NOVEMBRO DE 2023 À 30 DE NOVEMBRO DE 2023



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
23-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	B85E3	31,88	500,00	15.941,28	31,65	31,89	32,10	14.236,00
23-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	33,88	500,00	16.938,80	33,04	33,81	34,03	12.162,00
23-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	CIEL3	3,88	3.300,00	12.803,95	3,82	3,88	3,93	5.882,00
23-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	13,29	2.200,00	29.233,14	13,02	13,30	13,42	6.663,00
23-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	34,75	1.400,00	48.654,44	34,36	34,74	35,00	12.743,00
23-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,56	3.100,00	14.126,77	4,48	4,54	4,62	18.602,00
23-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	21,99	2.000,00	43.982,44	21,72	22,00	22,34	9.090,00
23-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	30,86	1.800,00	55.554,01	30,58	30,87	31,13	30.438,00
23-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	LREN3	15,01	1.000,00	15.010,94	14,76	14,99	15,16	19.244,00
23-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	16,39	800,00	13.113,63	15,94	16,38	16,55	18.659,00
23-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	PETRA	35,15	400,00	14.060,90	34,81	35,08	35,25	33.207,00
23-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	47,07	400,00	18.826,64	46,85	47,12	47,34	8.982,00
23-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	23,00	3.800,00	87.413,06	22,62	22,93	23,10	17.351,00
23-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	23,02	1.600,00	36.824,10	22,62	22,93	23,10	17.351,00
23-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	19,69	900,00	17.721,56	19,48	19,63	19,82	4.371,00
23-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	60,64	2.400,00	145.544,74	59,74	60,55	60,99	18.216,00
23-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SBSF3	67,36	200,00	13.472,27	65,73	67,25	67,91	10.115,00
23-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	22,20	700,00	15.539,23	21,90	22,20	22,36	5.862,00
23-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	6,84	2.100,00	14.368,71	6,47	6,79	6,91	19.352,00
23-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	53,71	800,00	42.965,01	53,21	53,76	54,12	6.557,00
23-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	VBRR3	22,32	700,00	15.625,88	21,76	22,23	22,40	11.751,00
23-11-23	FIA RVA EMB IV	Venda	RENT3	60,72	10.458,00	634.998,75	59,74	60,55	60,99	18.216,00
23-11-23	FIA RVA EMB IV	Venda	RENT3	60,77	399,00	24.245,61	59,74	60,55	60,99	18.216,00
24-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	13,40	3.500,00	46.901,45	13,07	13,32	13,66	16.651,00
24-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	14,54	5.600,00	81.404,35	14,42	14,52	14,66	13.526,00
24-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENAT3	15,72	4.200,00	66.040,31	15,55	15,71	15,90	6.152,00
24-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,48	13.800,00	61.875,41	4,39	4,47	4,56	30.177,00
24-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,52	3.400,00	15.368,00	4,39	4,47	4,56	30.177,00
24-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	59,88	3.400,00	203.583,79	59,48	59,88	60,63	15.018,00
24-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	6,67	7.000,00	46.719,81	6,50	6,63	6,74	23.342,00
24-11-23	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	14,47	14.422,00	208.743,18	14,42	14,52	14,66	13.526,00
24-11-23	FIA RVA EMB IV	Compra	CPL6	9,45	48.810,00	461.205,98	9,28	9,42	9,52	17.557,00
24-11-23	FIA RVA EMB IV	Compra	CPL6	9,38	199,00	1.866,62	9,28	9,42	9,52	17.557,00
24-11-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RAIL3	22,56	23.100,00	521.188,00	22,38	22,59	22,91	31.955,00
24-11-23	FIA RVA EMB IV	Venda	RENT3	59,74	8.189,00	489.206,86	59,48	59,88	60,63	15.018,00
24-11-23	FIA RVA EMB IV	Compra	VBRR3	22,25	23.800,00	529.441,00	22,05	22,23	22,40	12.675,00
24-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	BMLC11	106,37	25,00	2.659,18	102,78	104,89	106,60	14,00
24-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	HBRH11	95,14	63,00	5.994,04	93,80	95,47	95,47	17,00
24-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	NEWL11	108,05	26,00	2.809,30	108,05	108,36	108,63	68,00
24-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	PATC11	40,35	260,00	10.489,74	39,75	40,10	40,50	166,00
27-11-23	FIA RVA EMB II	Venda	B85E3	31,71	15.500,00	491.505,00	31,55	31,75	32,05	17.641,00
27-11-23	FIA RVA EMB II	Venda	CBAV1	0,54	8.093,00	4.360,50	0,45	0,51	0,60	439,00
27-11-23	FIA RVA EMB II	Compra	CRFB3	11,40	18.000,00	205.200,00	11,16	11,31	11,46	14.399,00
27-11-23	FIA RVA EMB II	Compra	ENEV3	13,27	3.900,00	51.738,91	12,54	12,97	13,70	42.652,00
27-11-23	FIA RVA EMB II	Compra	HAPV3	4,56	63.700,00	290.472,00	4,42	4,53	4,59	34.204,00
27-11-23	FIA RVA EMB II	Venda	MGLU3	1,94	184.800,00	358.512,00	1,92	1,97	2,07	51.503,00
27-11-23	FIA RVA EMB II	Compra	MRVE3	9,61	17.700,00	170.097,00	9,44	9,61	9,80	18.718,00
27-11-23	FIA RVA EMB II	Compra	PRI03	46,22	2.600,00	120.172,00	45,61	46,25	47,34	24.622,00
27-11-23	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	29,10	7.000,00	203.700,00	28,27	28,82	29,13	16.356,00
27-11-23	FIA RVA EMB II	Venda	SUZB3	53,75	3.600,00	193.500,00	53,40	53,71	54,10	15.506,00
27-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	13,55	6.000,00	81.298,54	13,13	13,48	13,68	21.618,00
27-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	41,26	3.400,00	140.277,94	40,38	41,04	41,48	26.833,00
27-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENAT3	15,44	2.200,00	33.978,58	15,28	15,44	15,72	3.873,00
27-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,70	8.200,00	104.173,37	12,54	12,97	13,70	42.652,00
27-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,68	1.600,00	20.288,00	12,54	12,97	13,70	42.652,00
27-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	52,01	1.900,00	98.818,53	51,12	52,04	52,51	8.792,00
27-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETRA	34,99	1.600,00	55.987,21	34,75	35,03	35,40	49.265,00
27-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,48	2.100,00	47.211,44	22,33	22,53	22,80	21.788,00
27-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	19,03	2.700,00	51.377,66	18,89	19,07	19,58	8.876,00
27-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	58,79	1.400,00	82.310,79	58,33	58,92	60,28	28.035,00
27-11-23	FIA RVA EMB IV	Compra	SOMA3	6,58	12.200,00	80.314,43	6,52	6,61	6,79	19.993,00
27-11-23	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	14,51	3.953,00	57.339,72	14,43	14,50	14,57	8.502,00
27-11-23	FIA RVA EMB IV	Compra	CPL6	9,50	5.856,00	55.614,30	9,40	9,50	9,56	18.588,00
27-11-23	FIA RVA EMB IV	Compra	CPL6	9,48	3.958,00	37.533,54	9,40	9,50	9,56	18.588,00
27-11-23	FIA RVA EMB IV	Compra	CPL6	9,53	12.147,00	115.738,50	9,40	9,50	9,56	18.588,00
28-11-23	FIA RVA EMB II	Venda	CBAV1	0,45	3.636,00	1.646,64	0,42	0,44	0,51	433,00
28-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	13,72	7.500,00	102.899,03	13,40	13,69	13,91	26.747,00
28-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	14,64	3.900,00	57.109,10	14,52	14,62	14,75	8.390,00
28-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	14,62	8.600,00	125.746,83	14,52	14,62	14,75	8.390,00
28-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	41,21	2.000,00	82.412,57	40,67	41,19	41,70	18.714,00
28-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENAT3	15,58	1.700,00	26.477,95	15,40	15,55	15,76	4.992,00
28-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENAT3	15,53	900,00	13.974,08	15,40	15,55	15,76	4.992,00
28-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,34	7.400,00	91.324,60	12,09	12,34	12,78	33.502,00
28-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,28	19.700,00	241.856,65	12,09	12,34	12,78	33.502,00
28-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,29	30.200,00	371.175,50	12,09	12,34	12,78	33.502,00
28-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	52,75	2.200,00	116.039,86	52,15	52,67	53,17	6.686,00
28-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	52,46	100,00	5.245,54	52,15	52,67	53,17	6.686,00
28-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,69	30.600,00	143.537,89	4,51	4,66	4,73	44.188,00
28-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	10,33	1.000,00	10.330,30	10,23	10,42	10,58	6.142,00
28-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	10,38	2.500,00	25.955,37	10,23	10,42	10,58	6.142,00
28-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	46,02	2.700,00	124.261,54	45,43	45,98	46,53	22.931,00
28-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	19,24	2.500,00	48.088,87	18,92	19,20	19,36	11.310,00
28-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	19,22	700,00	13.454,00	18,92	19,20	19,36	11.310,00
28-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	6,55	6.100,00	39.953,08	6,40	6,51	6,75	18.593,00
28-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	6,49	4.500,00	29.198,32	6,40	6,51	6,75	18.593,00
28-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	6,55	2.700,00	17.673,90	6,40	6,51	6,75	18.593,00
28-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	6,44	2.600,00	16.744,00	6,40	6,51	6,75	18.593,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – NOVEMBRO 2023



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE NOVEMBRO DE 2023 À 30 DE NOVEMBRO DE 2023



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
28-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	53,14	1.500,00	79.703,49	52,89	53,24	54,05	15.479,00
28-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBRR3	22,17	10.100,00	223.928,85	21,63	22,13	22,67	54.801,00
28-11-23	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	14,60	3.849,00	56.201,15	14,52	14,62	14,75	8.390,00
28-11-23	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	14,65	3.310,00	48.485,63	14,52	14,62	14,75	8.390,00
28-11-23	FIA RVA EMB IV	Compra	CPL66	9,49	2.928,00	27.781,64	9,43	9,55	9,66	26.778,00
28-11-23	FIA RVA EMB IV	Compra	CPL66	9,58	2.928,00	28.045,27	9,43	9,55	9,66	26.778,00
28-11-23	FIA RVA EMB IV	Compra	CPL66	9,51	1.757,00	16.711,15	9,43	9,55	9,66	26.778,00
28-11-23	FIA RVA EMB IV	Compra	CPL66	9,51	2.342,00	22.270,99	9,43	9,55	9,66	26.778,00
28-11-23	FIA RVA EMB IV	Compra	CPL66	9,60	3.203,00	30.764,15	9,43	9,55	9,66	26.778,00
28-11-23	FIA RVA EMB IV	Compra	CPL66	9,56	8.784,00	84.002,37	9,43	9,55	9,66	26.778,00
28-11-23	FIA RVA EMB IV	Venda	HAPV3	4,65	13.150,00	61.182,57	4,51	4,66	4,73	44.188,00
28-11-23	FIA RVA EMB IV	Venda	HAPV3	4,68	12.861,00	60.139,38	4,51	4,66	4,73	44.188,00
28-11-23	FIA RVA EMB IV	Venda	HAPV3	4,69	19.725,00	92.512,99	4,51	4,66	4,73	44.188,00
29-11-23	FIA RVA EMB II	Venda	CBAV1	0,43	3.104,00	1.340,09	0,40	0,44	0,48	731,00
29-11-23	FIA RVA EMB II	Compra	LREN3	16,09	22.200,00	357.242,51	15,61	16,06	16,25	58.799,00
29-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	24,97	500,00	12.482,50	24,75	24,99	25,43	12.710,00
29-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	13,69	4.700,00	64.320,77	13,13	13,53	13,88	27.463,00
29-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	13,80	2.500,00	34.500,00	13,13	13,53	13,88	27.463,00
29-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	14,62	7.200,00	105.250,77	14,51	14,60	14,73	10.306,00
29-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	52,85	300,00	15.855,48	52,36	52,69	53,05	28.023,00
29-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	31,57	1.900,00	59.977,73	31,35	31,56	31,98	15.849,00
29-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	40,94	900,00	36.846,30	40,61	40,89	41,23	23.515,00
29-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENAT3	15,63	2.600,00	40.643,13	15,46	15,62	15,85	6.030,00
29-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,39	12.400,00	153.647,89	12,04	12,41	12,72	25.949,00
29-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,14	1.700,00	20.638,00	12,04	12,41	12,72	25.949,00
29-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,51	2.000,00	25.018,25	12,04	12,41	12,72	25.949,00
29-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	52,48	500,00	26.238,63	51,92	52,46	52,99	6.920,00
29-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	52,75	600,00	31.647,69	51,92	52,46	52,99	6.920,00
29-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	52,39	200,00	10.477,21	51,92	52,46	52,99	6.920,00
29-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	34,35	1.200,00	41.224,26	34,09	34,32	34,65	21.968,00
29-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	16,96	900,00	15.267,21	16,81	17,01	17,19	7.932,00
29-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	22,61	1.700,00	38.439,75	21,94	22,53	22,72	27.017,00
29-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	31,21	1.300,00	40.571,15	30,84	31,17	31,38	40.626,00
29-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	15,95	1.700,00	27.116,24	15,61	16,06	16,25	58.799,00
29-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	16,06	37.500,00	602.260,38	15,61	16,06	16,25	58.799,00
29-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	16,51	8.000,00	132.094,19	16,10	16,44	16,74	27.546,00
29-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	PETRA	35,25	1.500,00	52.881,25	34,94	35,28	36,03	70.531,00
29-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	46,03	2.200,00	101.267,26	45,62	46,02	46,70	26.125,00
29-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	46,02	400,00	18.407,84	45,62	46,02	46,70	26.125,00
29-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,95	4.000,00	91.807,81	22,58	22,84	23,20	18.297,00
29-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	23,00	1.300,00	29.903,82	22,58	22,84	23,20	18.297,00
29-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	19,66	1.900,00	37.354,89	19,29	19,64	19,82	8.806,00
29-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	19,69	900,00	17.720,83	19,29	19,64	19,82	8.806,00
29-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	59,55	500,00	29.775,87	58,95	59,43	59,85	22.712,00
29-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	22,44	600,00	13.461,05	22,27	22,45	22,73	7.418,00
29-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	6,28	23.300,00	146.428,47	6,13	6,35	6,59	25.356,00
29-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	6,31	2.100,00	13.258,11	6,13	6,35	6,59	25.356,00
29-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	6,40	16.400,00	105.003,14	6,13	6,35	6,59	25.356,00
29-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	53,96	800,00	43.166,51	52,84	53,60	54,25	18.806,00
29-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	53,45	2.800,00	149.648,70	52,84	53,60	54,25	18.806,00
29-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBRR3	22,50	5.500,00	123.727,62	21,89	22,49	22,85	41.462,00
29-11-23	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	14,60	3.319,00	48.470,19	14,51	14,60	14,73	10.306,00
29-11-23	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	14,52	3.909,00	56.776,87	14,51	14,60	14,73	10.306,00
29-11-23	FIA RVA EMB IV	Compra	CPL66	9,45	6.556,00	61.945,63	9,37	9,44	9,54	32.381,00
29-11-23	FIA RVA EMB IV	Compra	CPL66	9,43	4.704,00	44.379,24	9,37	9,44	9,54	32.381,00
30-11-23	FIA RVA EMB II	Compra	ITUB4	31,40	17.400,00	546.435,86	31,23	31,48	31,66	48.024,00
30-11-23	FIA RVA EMB II	Compra	LREN3	16,39	37.600,00	616.139,90	15,86	16,28	16,51	38.453,00
30-11-23	FIA RVA EMB II	Venda	SUZB3	52,85	6.600,00	348.804,79	52,43	53,33	54,54	33.767,00
30-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	25,55	2.400,00	61.323,60	24,94	25,47	25,64	20.140,00
30-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	14,65	6.400,00	93.734,64	14,54	14,63	14,69	6.471,00
30-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	31,46	4.600,00	144.700,17	31,30	31,41	31,65	27.114,00
30-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	3,99	76.900,00	306.611,11	3,75	3,94	4,05	23.013,00
30-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENAT3	15,56	2.600,00	40.449,76	15,43	15,53	15,75	6.947,00
30-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	52,08	1.200,00	62.491,15	51,62	52,42	52,93	7.009,00
30-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	52,30	300,00	15.690,00	51,62	52,42	52,93	7.009,00
30-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,36	13.900,00	60.604,00	4,31	4,37	4,51	43.041,00
30-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	23,09	2.300,00	53.115,20	22,69	23,06	23,27	20.342,00
30-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	23,06	2.100,00	48.418,54	22,69	23,06	23,27	20.342,00
30-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	31,41	9.800,00	307.823,35	31,23	31,48	31,66	48.024,00
30-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	16,40	12.600,00	206.668,77	15,86	16,28	16,51	38.453,00
30-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	10,82	500,00	5.407,92	10,37	10,69	10,89	7.229,00
30-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	10,63	3.900,00	41.474,51	10,37	10,69	10,89	7.229,00
30-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	PETRA	35,59	100,00	3.558,55	35,24	35,72	35,92	51.721,00
30-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	46,67	400,00	18.667,13	45,58	46,36	47,65	33.976,00
30-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,60	9.700,00	219.220,00	22,45	22,75	23,08	35.263,00
30-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,60	1.200,00	27.117,87	22,45	22,75	23,08	35.263,00
30-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	19,83	700,00	13.877,97	19,54	19,80	20,03	7.104,00
30-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT9	47,13	39,00	1.838,07	59,36	59,92	60,45	26.249,00
30-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	6,00	17.300,00	103.859,04	5,84	5,97	6,18	33.462,00
30-11-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	53,07	2.300,00	122.067,84	52,43	53,33	54,54	33.767,00
30-11-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBRR3	23,25	5.500,00	127.862,32	22,64	23,14	23,38	37.951,00
30-11-23	FIA RVA EMB IV	Venda	RENT9	47,13	38,00	1.790,94	59,36	59,92	60,45	26.249,00
30-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	BTGL11	100,45	12.026,00	1.208.005,94	99,36	100,51	101,00	8.895,00
30-11-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	GALG11	9,29	34.364,00	319.404,51	9,25	9,28	9,33	5.679,00

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.