



# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO

Agosto/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 – AGOSTO 2023



Data: 31/08/2023

## Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS  
 CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais		Limite Fundo:		Status:		ENQUADRADO		0,00% Duração DU:		1,772,54	
PL:	4.486.939.781,74	VAR / PL:	2,1727%	Status:	ENQUADRADO	Duração DU:	0,00%	Duração DU:	1,772,54	ETL:	1,218,57
VAR:	97.487.976,27	ETL / PL:	2,2747%	Benchmark:							
ETL:	122.253.855,26	VAR / CDI:	0,0243%								

Cenários de STRESS											
Cenário Alta - 09999 (+):	181.176.479,95	Cenário Baixa - 10000 (+):	303.665.030,66	CENARIO BRADESCO 1 (+):	378.092.187,86	CENARIO BRADESCO 2 (+):	49.365.244,66				
Cenário Alta - 09999 (-):	(220.428.640,41)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(189.676.865,99)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(69.763.869,28)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(392.468.612,66)				
Cenário Alta - 09999:	(39.252.160,47)	Cenário Baixa - 10000:	113.988.164,67	CENARIO BRADESCO 1:	308.328.318,58	CENARIO BRADESCO 2:	(343.103.367,90)				

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
17H0164854	8.169.897,68	34.350,12	5.907,54	0,01%	0,00	0,00	0,00	0,00
AEC023	14.520.792,42	55.795,69	-12.347,07	-0,01%	-390.004,99	-18.879,84	101.320,70	-134.829,50
CCRDD1	6.322.923,56	27.279,27	17.567,35	-0,02%	915.696,51	-1.562.232,64	958.854,59	-966.703,33
CMDT33	1.397.962,89	4.774,05	-1.815,13	0,00%	-556.663,13	-65.315,69	122.324,11	-164.306,93
CSMGC3	10.722.292,58	39.517,97	-15.318,95	-0,02%	-7.625,20	6.391,12	9.199,47	-12.650,02
ELET42	14.431.103,79	109.453,09	82.782,79	0,08%	1.235.069,98	-1.235.069,98	362.122,52	-365.086,69
ENJG21	1.882.275,90	7.615,59	715,92	0,00%	17.034,46	-17.034,46	9.989,00	-10.070,77
ENMI21	1.181.054,96	4.892,29	672,93	0,00%	1.939.170,62	-1.385.121,87	812.235,47	-818.884,05
ENTV12	32.639.761,05	264.560,89	239.059,26	0,25%	-4.450,03	3.658,26	5.481,99	-7.798,00
ERDV17_VENCIMENTO	12.703.368,53	46.294,53	-4.546,84	0,00%	-1.071.787,19	380.940,33	554.251,89	-690.613,17
ERDV36	4.336.624,94	18.777,83	-12.137,87	-0,01%	-124.810,12	6.966,86	39.397,79	-51.960,53
GAS017	6.602.915,36	1.606.955,00	-888.810,57	-0,91%	-193,54	157,26	251,46	-365,23
GRBR24_VENCIMENTO	15.703.059,85	126.389,85	95.990,98	0,10%	-529,46	433,25	658,14	-843,30
ICSN15	2.665.915,41	35.955,40	31.212,80	0,03%	385.837,00	-385.837,00	188.545,68	-190.089,03
IFSN16000GM	14.560.785,02	45.475,59	-610,47	0,00%	-486.319,15	113.006,00	209.098,11	-269.085,98
IFSN18000C5	4.792.760,86	19.482,90	6.338,47	0,01%	831.346,59	-771.964,69	435.269,32	-438.832,24
NEOE16	7.214.788,88	57.931,72	45.750,46	0,05%	1.926.502,31	-2.388.919,48	1.129.700,95	-1.138.948,16
NTNB20240815 - 760199_VENCIMENTO	121.219.539,40	654.041,76	-451.734,36	-0,46%	121.394,32	-70.813,35	29.660,68	-29.903,47
NTNB20260815 - 760199_VENCIMENTO	42.320.510,58	368.003,79	-90.427,18	-0,09%	3.145.241,90	-3.145.241,90	1.844.369,85	-1.859.467,01
NTNB20300815 - 760199_VENCIMENTO	26.619.522,36	321.067,27	293.599,19	0,30%	3.305.454,45	-3.305.454,45	1.938.318,49	-1.954.184,67
NTNB20350815 - 760199_VENCIMENTO	243.997.221,25	5.083.320,93	4.954.170,80	5,08%	253.370,57	-253.370,57	148.576,50	-149.792,66
NTNB20400815 - 760199_VENCIMENTO	30.030.392,17	629.388,11	605.431,21	0,83%	2.408.104,89	-2.408.104,89	1.412.112,71	-1.423.671,61
NTNB20450815 - 760199_VENCIMENTO	232.221.961,20	7.330.182,45	7.026.104,39	7,21%	1.083.922,33	-1.083.940,17	794.528,15	-801.031,79
NTNB20500815 - 760199_VENCIMENTO	726.393.235,70	25.809.599,72	24.398.773,69	25,03%	0,00	0,00	0,00	0,00
NTNB20550815 - 760199_VENCIMENTO	232.627.547,75	8.740.208,78	8.199.201,80	8,41%	-72,74	59,18	102,40	-150,67
OMGE31	12.900.778,20	56.890,88	18.579,61	0,02%	-988,01	806,95	1.393,33	-2.047,46
PETRA5	9.095.756,15	58.386,09	-36.044,25	-0,04%	8.568,00	-8.568,00	5.024,28	-5.065,40
SBSPC2	17.162.893,26	58.681,31	-22.400,16	-0,02%	-74,44	64,11	138,14	-206,39
TAE333	8.571.751,66	38.335,76	-26.444,15	-0,03%	3.327.866,34	-3.327.866,34	487.865,21	-491.858,65
020913	2.177.294,53	256.728,54	193.009,04	0,20%	3.469.422,75	-4.047.659,87	1.695.391,25	-1.709.268,94
ABEV5	6.540.617,92	453.094,13	419.132,30	0,43%	1.449.692,00	-1.449.692,00	212.524,85	-214.264,46
AEC041	1.999.677,38	1.781,24	1.615,48	0,00%	21.886,88	-21.886,88	12.834,46	-12.939,52
AJEC11	2.470.139,95	214.325,69	162.298,24	0,17%	0,00	0,00	0,00	0,00
ALPA4	68.137,82	12.527,72	6.061,06	0,01%	1.259.574,84	-1.259.574,84	738.614,69	-744.660,65
ALSO3	5.540.487,48	900.027,23	777.443,93	0,80%	438.284,79	-239.064,43	116.822,82	-117.779,08
AMBPI3	2.587.150,50	797,48	737,98	0,00%	-962.981,66	314.342,44	482.433,09	-609.989,66
ANEM11	10.868.816,73	241.202,56	178.772,69	0,18%	-7.147,76	5.843,95	8.605,39	-12.241,83
ANET11	2.451.179,62	11.217,11	4.721,17	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ANHB10	661.053,79	25,27	22,98	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
APRB28	1.246.774,39	87,26	80,80	0,00%	-566.979,21	167.736,89	266.408,39	-341.269,50
ARRZ3	1.286.123,33	207.132,35	192.896,85	0,20%	-595.496,43	106.225,17	224.712,80	-294.936,29
ASAB11	6.579.545,61	65.615,44	59.164,80	0,06%	0,00	0,00	0,00	0,00
ASAJ3	2.969.094,96	467.181,08	348.974,60	0,36%	-963.659,59	291.761,56	455.927,23	-580.508,35
AURE3	7.706.009,22	359.111,26	198.714,13	0,20%	9.483,26	-9.483,26	3.475,62	-3.504,07
AZUL4	202.323,87	79.404,11	68.156,69	0,07%	-134.898,51	123.643,31	167.734,01	-205.298,03
B3SA3	12.580.967,58	2.133.389,04	2.000.116,90	2,05%	-900.957,52	27.841,35	429.428,74	-548.201,22
BBSA3	13.221.817,80	1.268.647,25	531.682,13	0,55%	-436.365,63	139.153,68	211.186,21	-269.079,99
BBD04	1.013.482,28	159.773,35	145.082,82	0,15%	-0,10	0,10	0,42	-0,64
BBD04	9.632.419,55	1.449.795,89	1.281.353,38	1,31%	-146.893,20	-27.850,90	28.345,66	-38.199,45
BBS03	5.419.700,86	423.448,26	-277.470,21	-0,28%	150.242,68	-150.242,68	88.103,31	-88.823,47
BBT0PIND	327.335.654,66	5.071.168,67	4.626.289,91	4,75%	0,00	0,00	0,00	0,00
BCBF14	274.185,54	6,68	6,06	0,00%	-99,95	1.224,47	1.224,47	-1.732,42
BCBF15	3.118.016,22	94,19	74,78	0,00%	-1.746,07	1.416,82	2.131,27	-3.062,24
BEF3	34.272,00	6.466,36	2.094,25	0,00%	-1.869,89	1.512,77	2.404,26	-3.503,20
BKBR18	1.086.067,77	7,50	-2,00	0,00%	367.381,15	-367.381,15	107.716,15	-108.597,87
BMLC11	3.327.866,34	167.144,09	-89.683,49	-0,09%	-0.029,63	4.204,39	6.122,51	-8.465,21
BPAC11	11.564.742,49	1.878.082,51	1.582.413,46	1,62%	908.733,13	-757.277,61	444.067,59	-447.702,52
BPML11	1.449.692,00	79.434,80	-6.051,77	-0,01%	-613.217,72	186.211,37	290.479,90	-369.185,20
BRAP4	87.547,60	7.758,32	4.522,53	0,00%	-42.537,92	-8.188,71	8.274,23	-11.140,48
BRELETR0	2.631.581,86	56.847,65	-4.507,86	0,00%	61.801,04	-74.161,25	36.240,13	-36.536,78
BRFS3	5.038.299,36	847.359,56	496.086,94	0,50%	25.798,56	-26.798,56	10.805,91	-10.894,36
BRKM5	796.981,44	175.163,81	134.835,33	0,14%	213.369,75	-213.369,75	62.560,01	-63.072,10
BRKP28	9.354.775,06	224.462,43	176.855,19	0,18%	-976.677,33	338.709,66	490.803,85	-620.112,61
BRKPA0	3.449.081,86	1.335,87	1.237,49	0,00%	60.492,18	-84.689,05	35.472,61	-35.762,98
BTLG11	3.042.640,07	5.168,09	2.681,68	0,00%	-29.651,26	30.237,11	133.040,89	-202.486,66
BTLG13	10.377,00	617,76	526,23	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
BTOW15	5.303.904,10	110.084,27	93.585,47	0,10%	-677.483,05	113.997,83	253.625,08	-332.332,71
CAEC21	9.050.881,17	64.322,19	41.719,41	0,04%	568.766,75	-568.775,08	416.912,13	-420.324,78
CAIXA	78.042,71	0,00	0,00	0,00%	205,97	-164,76	-289,55	435,09
CART13	10.961.881,58	170.336,43	144.856,68	0,16%	468.841,05	-468.867,35	312.285,36	-314.841,58
CASH8	23.789,16	7.597,37	5.942,01	0,01%	674.894,05	-674.898,05	449.727,52	-453.401,78
CBAN22	6.664.975,61	57.218,35	47.881,03	0,05%	0,00	0,00	0,05	-0,09
CBAN32	9.989.107,06	159.939,06	138.090,82	0,14%	0,00	0,00	-0,01	0,02
CBAN72	4.695.949,34	81.926,18	69.607,16	0,07%	-0,07	0,07	0,25	-0,38
CCPR3	43.068,27	0,04	-0,03	0,00%	-5.652,40	4.804,68	6.976,23	-9.397,10
CCRO3	600.970,72	34.904,00	29.039,33	0,03%	0,00	0,00	0,00	0,00
CDB32RSITI	6.117.310,39	0,00	0,00	0,00%	49.427,55	-49.427,55	28.984,32	-29.221,57
CEAB22	556.379,89	189,04	174,55	0,00%	-566.704,58	94.065,92	216.677,57	-282.002,50
CEEB3	1.957.326,60	286,26	264,79	0,00%	-6.357,97	5.480,15	7.887,00	-10.435,99
CELG12	3.232.937,68	229,63	203,59	0,00%	83.815,68	-83.815,68	49.149,52	-49.551,83
CEOC14	754.762,30	200.732,88	166.744,88	0,17%	190.023,68	-233.210,88	126.624,87	-127.961,36
CGBP13	2.236.456,01	1.126,04	1.024,76	0,00%	-3.894,07	3.254,57	4.723,99	-6.528,53
CIEL3	3.029.110,44	502.398,67	303.311,52	0,31%	-358.317,23	-57.492,40	73.581,72	-98.946,66
CJEN13	7.092.426,75	108.552,16	91.445,62	0,09%	43.798,54	-32.850,49	16.052,50	-16.183,90
CMIG4	247.204,17	13.814,82	9.119,56	0,01%	18.263,96	-18.263,96	5.354,99	-5.398,83
CMIN3	73.710,16	4.902,11	1.874,80	0,00%	440.640,00	-440.640,00	322.989,12	-325.632,96
CNES11	426.739,50	22.797,37	9.523,18	0,01%	100.			

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2023



Data: 31/08/2023

## Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS  
 CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais		Limite Fundo:		0,00%		Duração DC:		1,772,54	
PL:	4.486.939,781,74	VAR / PL:	2,1727%	Status:	ENQUADRADO	Duração DU:			
VAR:	97.487.976,27	ETL / PL:	2,7247%	Benchmark:					1,218,57
ETL:	122.253.855,26	VAR / CDI:	0,0243%						

### Cenários de STRESS

Cenário Alta - 09999 (+):	181.176.479,95	Cenário Baixa - 10000 (+):	303.665.030,66	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	378.092.187,86	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	49.365.244,66
Cenário Alta - 09999 (-):	(220.428.640,41)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(189.676.865,99)	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	(69.763.869,28)	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(392.468.612,66)
Cenário Alta - 09999:	(39.252.160,47)	Cenário Baixa - 10000:	113.988.164,67	CENÁRIO BRADESCO 1:	308.328.318,58	CENÁRIO BRADESCO 2:	(343.103.367,90)

### Parâmetros do Cálculo

Modelo:	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiança:	Lâmbda:	0,94
Horizonte:		

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
COGN3	241.968,72	69.678,05	65.086,79	0,07%	-562.717,38	599.547,57	3.151.972,98	-3.159.880,45
COMPROMISSADA_PRE	1.060.583.979,33	19.263,57	-14.735,71	-0,02%	97.467,03	-96.735,72	-233.630,16	225.696,67
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-37.795.456,81	0,00	0,00	0,00%	-415.762,13	710.543,34	11.181.342,07	-11.264.842,39
CONX12	9.989.940,98	69.556,60	49.723,87	0,05%	-1.637.563,94	1.752.926,24	10.967.299,15	-11.015.988,71
CPFES3	2.843.875,40	226.942,92	117.609,97	0,12%	357.281,21	-350.777,85	-1.510.678,72	1.508.486,42
CPGT16	145.711,10	17,35	-8,96	0,00%	323.794,53	-317.746,66	-1.055.217,40	1.045.625,30
CPLES3	2.130.186,60	179.567,73	106.937,74	0,11%	6.608,76	-8.440,59	-24.119,29	23.657,22
CPL66	3.067.718,40	188.122,15	-60.792,60	-0,06%	-112,39	96,24	198,26	-295,53
CPMU23CO99250	29,80	45,42	36,79	0,00%	86.466,86	-83.010,18	-208.862,76	314.065,66
CPMU23C100000	-7,95	6,92	4,08	0,00%	-763.770,21	608.309,72	939.376,57	-1.369.794,61
CPMU23CO99250	47,02	24,70	6,94	0,00%	-9.457.536,50	7.662.817,98	10.725.756,43	-15.162.310,44
CPT121	1.974.698,71	1.421,88	1.270,40	0,00%	-64.995,29	54.537,75	75.655,52	-103.846,71
CREDEMZ4	423.129,56	83.399,09	72.038,46	0,07%	-61.805,23	54.531,32	78.176,95	-99.883,99
CRFB3	197.710,20	49.002,76	39.145,16	0,04%	-14.945,58	14.104,21	21.423,17	-23.777,04
CRMG15	8.397.270,33	56.342,38	50.650,76	0,05%	-1.784,74	1.522,51	3.074,53	-4.885,35
CSAN23	1.111.423,49	1.731,73	1.528,77	0,00%	802.976,12	-639.022,19	-955.967,81	1.384.106,83
CSAN3	335.262,72	68.082,07	60.243,36	0,06%	-2.841,90	2.309,76	4.143,61	-6.132,46
CSMG3	863.744,00	140.886,99	81.318,42	0,08%	2.396.887,01	-1.924.550,22	-2.782.617,93	4.000.496,36
CSMG7	2.150.477,37	873,99	795,12	0,00%	1.954.795,12	-1.616.752,57	-2.237.020,86	3.117.047,11
CSNA3	109.498,62	13.496,81	8.836,93	0,01%	-6.870,84	5.000,93	7.000,16	-9.427,14
CVGB3	36.527,92	10.946,25	8.510,86	0,01%	838,31	-854,88	-3.761,39	5.724,79
CXSE3	2.203.200,00	102.939,36	50.914,07	0,05%	-55,33	59,23	257,87	-391,25
CYRE3	313.800,96	50.661,03	42.370,02	0,04%	-2.006,15	1.585,33	2.575,42	-3.782,87
DAPK25	-74.771,67	335.898,91	-153.283,06	-0,16%	-3.797,43	3.072,68	4.333,14	-6.181,03
DAPK27	-84.010,52	155.839,86	-23.964,16	0,02%	147.305,03	-147.403,89	178.805,89	-180.365,75
DAPK35	8.366,72	28.680,78	-28.021,71	-0,03%	-910.459,98	925.502,54	-1.168.444,44	1.175.654,90
DAPQ24	-33.439,59	373.024,36	-199.399,53	-0,20%	16.558,79	-19.870,55	9.710,07	-9.789,56
DAPQ26	-244.940,39	547.672,42	-102.656,77	-0,11%	416.193,75	-416.193,75	244.056,02	-246.053,75
DAPQ28	50.289,95	80.059,04	-55.295,14	-0,06%	346.883,95	-346.888,53	282.521,43	-284.834,02
DAPQ30	41.351,67	79.435,56	-74.517,26	-0,08%	-1.734,26	1.400,59	2.183,24	-3.167,50
DAPQ32	1.105,49	2.454,16	-2.378,28	0,00%	4.740.255,67	-4.740.255,67	2.316.404,94	-2.335.365,96
DASAA2	2.631.327,43	10,51	2,24	0,00%	-988.280,30	225.186,38	401.755,38	-525.685,50
DHF24	1.510,56	15.508,60	10.480,46	0,01%	1.156.981,72	-1.156.981,72	565.378,40	-570.006,33
DHF25	-31.332,17	97.399,05	85.465,29	0,09%	98.551,19	-98.551,19	57.790,42	-58.263,46
DHF26	-656.756,74	1.996.899,93	1.637.833,77	1,89%	131.246,85	-131.249,24	54.973,68	-55.423,67
DHF27	-5.593,55	17.160,66	15.531,73	0,02%	2.700.267,40	-3.721.990,20	1.069.889,73	-1.078.647,36
DHF29	-5.276,30	19.712,87	16.928,46	0,02%	639.154,37	-827.140,95	551.176,65	-555.688,33
DHF33	-1.211,19	5.816,65	4.746,58	0,00%	-86.807,19	5.768,31	21.764,26	-29.007,51
DHJ24	-34,56	167,23	-32,01	0,00%	80.180,10	-48.108,06	26.120,90	-26.334,71
DHJ25	38.735,28	118.981,21	-107.461,37	-0,11%	-56.316,80	-3.613,54	14.183,15	-18.896,42
DHN24	-75,71	237,08	102,90	0,00%	-2.362.923,36	541.169,90	984.756,61	-1.280.499,44
DHN25	133.939,86	403.890,49	-369.433,73	-0,38%	-87,75	75,68	164,94	-246,58
DHN26	155.493,48	476.410,17	-437.004,98	-0,45%	5.700.819,91	-5.700.819,91	4.212.900,99	-4.212.900,91
DHN27	-514,19	1.628,99	1.452,83	0,00%	-244.963,56	-31.991,85	52.648,26	-70.757,98
DHU23	9,87	544,63	416,61	0,00%	-466.893,69	-60.975,58	100.346,11	-134.862,72
DHV23	-0,44	23,25	-15,68	0,00%	-7,99	8,10	30,39	-46,05
DHV24	-66,94	203,37	189,51	0,00%	-99.879,12	-19.056,30	19.230,57	-25.916,24
DHV25	-242,35	715,84	657,32	0,00%	-321.401,86	-50.506,98	66.193,76	-88.550,02
DOLU23	13.803,75	0,00	0,00	0,00%	-0,92	0,94	4,09	-6,22
DOLV23	-137.322,18	416.736,61	309.646,52	0,32%	14.814,95	-22.222,93	10.859,61	-10.948,50
EXOC3	66.235,16	11.678,25	5.846,24	0,01%	418.794,34	-418.794,34	306.976,25	-309.489,01
ECO23	1.684.775,00	342.369,27	165.249,70	0,17%	668.761,80	-668.761,80	196.000,96	-197.685,99
EGES3	1.927.158,48	170.648,25	118.848,90	0,12%	945.018,96	-945.018,96	277.079,56	-279.347,61
ELET13	2.126.576,77	236,49	214,92	0,00%	-1.855.305,80	2.226.426,91	1.469.120,45	-1.930.796,31
ELET3	15.800.852,24	2.118.829,84	1.709.288,09	1,75%	-993.265,60	363.391,68	544.116,59	-659.648,44
ELET6	3.856.605,74	615.430,21	540.611,60	0,55%	238.757,06	-238.757,06	140.007,14	-141.153,18
EMBR3	394.204,74	34.667,16	-13.554,24	-0,01%	3.552.817,17	-3.552.817,17	1.157.428,88	-1.166.903,06
ENAT3	374.991,00	37.092,85	-9.692,11	-0,01%	-1.339,62	1.090,23	1.822,74	-2.666,90
ENEV3	7.298.020,00	813.859,30	674.808,20	0,69%	1.513.032,54	-1.344.917,82	1.232.280,95	-1.242.367,83
ENH11	3.759.731,60	440.404,27	364.444,48	0,37%	973.997,65	-811.664,63	475.960,14	-479.856,13
ENHJ3	178.178,00	49.216,37	41.269,00	0,04%	0,00	0,00	0,00	0,00
EQ113	1.487.995,52	9,25	2,86	0,00%	14.349,64	-8.370,62	3.506,09	-3.534,79
EQTL3	28.504.099,54	3.756.798,85	3.011.040,72	3,09%	-342,11	277,72	437,85	-635,79
ERDV17	6.665.034,02	24.289,20	-2.385,57	0,00%	-577.369,29	150.707,61	243.080,86	-317.856,31
ERDV18	1.400.814,86	2,61	-1,89	0,00%	-1.095.841,56	286.041,64	461.365,21	-603.288,33
ERDV38	5.845.712,38	23.576,10	7.633,13	0,01%	-3.436,17	2.804,86	4.288,06	-6.159,04
ETEN13	1.368.772,03	0,42	-0,31	0,00%	1.775.137,31	-1.775.259,87	765.397,44	-771.662,63
EZTC3	74.076,44	7.681,82	2.414,94	0,00%	-995.207,56	357.327,01	508.874,13	-638.840,01
FLRY3	2.093.971,68	182.458,44	154.078,52	0,16%	3.609.743,46	-3.609.743,46	529.188,39	-533.520,08
FVFPQ11	1.337.523,60	69.812,12	-5.434,27	-0,01%	-694.360,95	187.994,22	312.824,43	-402.393,30
GALG11	1.890.037,92	82.701,98	60.345,26	0,06%	0,00	0,00	0,00	0,00
GBSP11	7.982.336,81	265.238,76	171.297,37	0,18%	-1.075.106,23	381.261,32	540.427,63	-685.479,62
GGBR4	955.028,25	158.842,17	119.811,99	0,12%	158.853,84	-145.040,46	101.252,06	-102.080,86
GGPS3	7.895.149,26	667.224,86	479.755,08	0,49%	-214.286,53	63.408,02	100.604,10	-127.987,34
GGSH12	2.494.338,98	145,43	125,60	0,00%	567.671,79	-9.604,58	-9.604,58	2.765.651,94
GMAT3	8.405.736,35	1.983.603,56	1.867.072,69	1,92%	115.970,86	7.961,07	7.961,07	-2.713.986,63
GOAU4	3.246.658,50	588.340,42	474.893,53	0,49%	-415.699,18	5.919,44	5.919,51	-2.609.410,56
GOLL14	449,18	3.021,50	2.718,80	0,00%	369.357,08	-5.262,93	-5.263,09	2.556.758,17
GOLL4	23.916,06	11.744,12	10.161,03	0,01%	457.840,00	-6.657,59	-6.658,02	3.506.432,18
GRRB14	1.065.771,80	45,11	40,90	0,00%	-401.908,70	5.478,66	5.478,16	-3.432.959,73
GRRB34	8.273.517,69	66.598,66	50.575,05	0,05%	-1.136.768,92	13.197,21	13.200,66	-15.522.392,95
GUAR15	2.727.035,59	549,53	598,70	0,00%	1.242.603,62	-14.133,06	-14.137,62	19.171.488,96
HAPV3	5.220.992,10	1.110.657,51	997.431,85	1,02%	-223.975,04	2.535,68	2.536,68	-3.893.973,28
HARG11	10.846.643,49	213.237,93	165.145,82	0,17%	-184,20	773.566,32	3.119.104,70	-184,20
HBRH11	3.609.743,46	119.817,91	75.647,14	0,08%	589,44	-891.014,18	-3.538.074,66	589,44
HBSA21	7.824.384,40	109.889,05	98.075,64	0,10%	-24.758,53	753.475,44	1.922.221,31	-24.758,53
HSLG11	931.443,87	0,00	0,00	0,00%	128.245,37	-1.535.497,60	-3.933.618,60	128.245,37
HVRD15	10.944.176,43	211.914,82	177.554,99	0,18%	254.300,26	-1.776.786,16	-4.527.785,33	25

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2023



Data: 31/08/2023

## Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS  
 CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais		Limite Fundo:		0,00%		Duration DC:		1,772,54	
PL:	4.486.939.781,74	VAR / PL:	2,1727%	Status:	ENQUADRADO	Duration DU:			1,218,57
VAR:	97.487.976,27	ETL / PL:	2,7247%	Benchmark:					
ETL:	122.253.855,26	VAR / CDI:	0,0243%						

Cenários de STRESS										
Cenário Alta - 09999 (+):	181.176.479,95	Cenário Baixa - 10000 (+):	303.665.030,66	CENARIO BRADESCO 1 (+):	378.092.187,86	CENARIO BRADESCO 2 (+):	49.365.244,66			
Cenário Alta - 09999 (-):	(220.428.640,41)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(189.676.865,99)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(69.763.869,28)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(392.468.612,66)			
Cenário Alta - 09999:	(39.252.160,47)	Cenário Baixa - 10000:	113.988.164,67	CENARIO BRADESCO 1:	308.328.318,58	CENARIO BRADESCO 2:	(343.103.367,90)			

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
HYPE3	690.668,86	113.427,59	105.123,36	0,11%	-529.424,85	2.563.635,80	6.515.246,40	-529.425,17
HZTC14	2.503.061,43	37.353,70	31.625,84	0,01%	-2.312.004,34	6.746.315,11	14.650.790,54	-2.316.802,72
IDIF24C381500	9.604,58	15.037,61	10.162,18	0,01%	2.683.111,04	-5.758.334,79	-14.663.124,81	2.700.028,34
IDIF24C381600	-7.961,07	11.886,68	-8.032,83	-0,01%	2.410.351,27	-4.570.103,89	-11.650.415,01	2.445.486,61
IDIF24C381800	-5.919,51	8.033,94	-5.429,21	-0,01%	-2.677.519,78	4.475.073,44	11.557.212,33	-2.752.195,01
IDIF24C381900	5.263,09	6.817,82	4.607,37	0,00%	1.040.184,89	-1.287.508,84	-3.245.066,78	1.200.475,29
IDIF24C382000	6.658,02	8.241,85	5.569,71	0,01%	-1.081.705,77	1.288.451,75	3.246.521,59	-1.286.802,09
IDIF24C382100	-5.479,16	6.685,72	-4.518,10	0,00%	361.996,40	-2.819.909,36	-6.236.136,42	362.023,03
IDIF24C382500	-13.200,66	15.246,16	-10.303,11	-0,01%	-410.446,96	2.877.874,86	6.295.171,16	-410.486,46
IDIF24C382600	14.137,62	16.114,54	10.889,94	0,01%	-2.177,64	959.505,87	5.411.443,65	-2.177,64
IDIF24C382700	-2.536,69	2.847,08	-1.924,01	0,00%	236.455,41	-1.324.366,54	-8.777.505,93	236.455,41
IDIF24P300200	184,20	616,06	-416,32	0,00%	830.461,84	-1.328.041,43	-5.732.302,42	831.910,97
IDIF24P380300	-589,44	1.794,95	1.213,00	0,00%	-1.202.787,07	1.328.389,36	5.783.931,96	-1.430.709,48
IDIF24P381000	24.758,53	64.348,67	-43.485,79	-0,04%	-222.594,56	59.060,42	100.594,50	-128.582,49
IDIF24P381100	-128.245,37	194.281,17	131.292,09	0,13%	3.816,78	-2.989,95	-4.891,23	7.317,15
IDIF24P381200	-254.300,26	262.339,17	177.284,59	0,18%	1.516.650,28	-1.516.650,28	1.111.704,66	-1.120.804,56
IDIF24P381300	529.425,17	407.872,62	-275.633,76	-0,28%	681.452,13	-680.061,92	534.267,23	-536.461,29
IDIF24P381600	2.316.802,72	998.642,99	-674.866,87	-0,69%	0,00	0,00	0,00	0,00
IDIF24P381700	-2.700.028,34	1.015.053,50	685.956,82	0,70%	-715.043,68	186.778,85	318.581,15	-407.090,22
IDIF24P381800	-2.445.486,61	814.051,04	500.122,60	0,56%	-690.490,97	-45.270,10	173.223,25	-230.618,34
IDIF24P381900	2.752.195,01	821.252,07	-554.986,94	-0,57%	35.044,62	-29.663,27	7.903,91	-7.968,61
IDIF24P382400	-1.200.475,29	236.946,46	160.124,61	0,16%	-228.537,11	89.518,85	127.988,58	-155.769,61
IDIF24P382500	1.286.802,09	237.756,61	-160.672,09	-0,16%	-880.044,22	339.404,06	464.069,01	-882.842,63
IDU24P390700	-362.023,02	161.748,35	30.955,01	0,03%	0,00	0,00	0,00	0,00
IDU24P390800	410.486,46	175.729,27	-33.633,90	-0,03%	1.151.136,39	-1.151.136,39	888.192,60	-895.462,94
IDV23P370500	2.177,64	15.224,88	-10.268,92	-0,01%	7.762.559,47	-7.374.565,92	5.690.059,81	-5.736.636,02
IDV23P370600	-236.455,41	493.092,99	332.582,85	0,34%	-158,00	130,95	244,31	-361,64
IDV23P370700	-831.918,97	521.371,78	351.656,41	0,36%	112.030,24	-112.030,24	46.924,67	-47.308,77
IDV23P370800	1.430.709,48	521.485,84	-351.733,34	-0,36%	-284.926,92	74.150,20	126.228,18	-162.605,25
IGTA37	2.200.055,61	373,75	-283,61	0,00%	65.912,96	-52.730,37	38.651,36	-38.967,74
IGTH11	7.583.251,40	601.806,00	567.054,20	0,58%	-777.544,89	196.576,63	340.946,19	-438.794,99
INDV23	-59.264,00	322.305,53	297.875,27	0,31%	-1.074,48	875,62	1.454,76	-2.130,15
INSSSN11	1.567.068,24	40.703,98	16.378,89	0,02%	-5.073,31	4.147,90	6.107,90	-8.888,95
IPIL11	9.218.037,00	105.618,92	92.299,57	0,09%	-1.131.453,51	302.100,79	506.157,46	-651.613,86
IRBR12	11.546.701,73	60.089,58	21.381,36	0,02%	-305.363,06	109.556,49	143.193,33	-187.061,89
IRBR3	53.914,80	17.093,51	3.731,33	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
IRJS14	1.672.347,49	63.819,38	41.982,76	0,04%	0,00	0,00	0,00	0,00
ITPO14	8.348.119,68	202.482,27	157.892,01	0,16%	0,00	0,00	0,00	0,00
ITSA2	8.393,10	2.721,26	2.436,04	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ITSA4	6.058.612,56	538.778,41	493.447,01	0,51%	0,00	0,00	0,00	0,00
ITUB4	38.813.504,86	3.472.295,68	2.788.578,96	2,86%	0,00	0,00	0,00	0,00
IVAS4	1.333.434,90	12,29	6,05	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
JBSS3	320.086,40	24.147,13	13.623,81	0,01%	0,00	0,00	0,00	0,00
JSMLB5	3.350.150,90	42.547,78	38.416,31	0,04%	0,00	0,00	0,00	0,00
KLBN11	263.651,84	18.133,69	7.531,79	0,01%	0,00	0,00	0,00	0,00
LAMEA6	9.106.756,11	117.467,51	105.265,42	0,11%	2.093,73	-1.691,22	-3.092,97	4.728,82
LCAMA9	1.906.951,30	112,95	95,32	0,00%	3.194,06	-2.577,85	-4.705,57	7.194,47
LCAMC3	3.118.138,37	948,17	878,34	0,00%	2.187,99	-1.759,23	-3.181,65	4.865,00
LCAMD1	13.005.913,17	174.024,81	156.401,41	0,16%	-11.928,64	9.760,46	14.190,82	-20.098,65
LF001800FAU	4.357.236,40	40.305,56	28.889,44	0,03%	-696.685,60	-168.391,38	115.257,46	-154.964,93
LF002100SG1	2.386.871,79	0,00	0,00	0,00%	-263.626,22	-50.131,78	50.064,07	-67.139,74
LF002100SS0	1.286.802,27	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002100E1F	1.286.802,27	0,00	0,00	0,00%	-752,92	791,12	40,60	-61,81
LF002100HDP	1.489.129,67	0,00	0,00	0,00%	-13.988,29	15.951,48	0,00	0,00
LF002100HDQ	2.712.806,09	0,00	0,00	0,00%	-3.337,65	4.226,35	-0,59	0,90
LF002100ISJ	2.781.173,84	0,00	0,00	0,00%	-639,28	895,26	3,70	-6,63
LF00220018H	1.256.898,23	0,00	0,00	0,00%	-228.675,13	396.825,94	9.598,89	-14.609,07
LF002200IO9	2.371.957,01	0,00	0,00	0,00%	-12.533,43	25.855,48	968,48	-1.473,49
LF002306J15	10.160.218,84	0,00	0,00	0,00%	-52.035,80	121.379,02	8.586,83	-13.037,15
LFSC1900089	3.561.675,23	0,00	0,00	0,00%	-18,15	18,40	69,02	-104,57
LFSC190054B	866.359,91	0,00	0,00	0,00%	-2.305,40	1.917,98	2.772,56	-3.855,19
LFSC190059S	1.312.238,84	0,00	0,00	0,00%	576.023,21	155.071,67	258.206,00	-332.421,07
LFSC19005L1	868.070,83	0,00	0,00	0,00%	1.609.412,00	-1.609.412,00	1.179.699,00	-1.189.355,47
LFSC22002X	5.220.744,93	2.342,34	2.168,52	0,00%	-128,46	105,59	193,49	-286,76
LFNSN210029N	4.274.207,18	0,00	0,00	0,00%	-802.094,46	655.634,74	968.571,27	-1.402.171,70
LFT20230901 - 210100	88.466.045,55	42,25	-20,10	0,00%	-650.753,75	545.951,94	773.446,09	-1.111.682,18
LFT20240301 - 210100	13.048.112,71	740,80	-497,15	0,00%	-2.137.853,89	1.946.352,33	2.577.754,31	-3.588.614,04
LFT20240901 - 210100	1.153.730,16	132,23	-59,34	0,00%	70.383,26	-70.383,26	25.795,47	-26.006,62
LFT20250901 - 210100	109.864,40	43,35	5,89	0,00%	2.242.967,20	-2.242.967,20	657.637,98	-683.021,10
LFT20260301 - 210100	35.755.508,41	14.329,07	2.635,72	0,00%	443.076,86	-443.076,86	216.516,89	-218.289,20
LFT20260901 - 210100	1.822.946,27	969,84	170,06	0,00%	696.229,00	-696.229,00	204.194,34	-205.805,29
LFT20290301 - 210100	3.921.975,94	3.848,85	3.030,68	0,00%	205.626,34	-178.116,95	58.027,19	-58.502,18
LIGHB4	2.297.499,17	5,92	-4,29	0,00%	-5.554,33	4.657,37	6.708,69	-9.219,82
LIGHD3	907.811,28	511,12	467,07	0,00%	-757.108,16	198.145,45	336.127,26	-432.934,32
LORTA7	6.479.335,32	90.393,58	80.927,44	0,08%	0,00	0,00	0,00	0,00
LTREN3	8.047.060,00	1.656.691,44	1.447.573,24	1,48%	17.264,72	-12.949,56	6.327,73	-6.379,53
LTREN81	1.355.195,45	10,26	3,75	0,00%	660.664,66	-660.684,04	332.844,80	-325.487,45
LTN20250401 - 100000	23.784.454,83	123.906,28	111.268,85	0,11%	-836.023,14	160.257,02	333.002,98	-432.351,43
LTN20250701 - 100000	16.865.709,26	112.950,34	102.477,55	0,11%	-445.438,75	-371.198,96	217.671,07	-219.452,83
LTN20260701 - 100000	34.993.631,44	547.182,66	500.344,61	0,51%	-509.810,40	-128.199,33	212.614,80	-277.921,27
LWSA3	175.955,16	47.744,08	24.865,09	0,03%	731.908,80	-731.908,80	214.595,86	-216.352,24
MALL11	4.465.934,40	242.306,72	126.517,53	0,13%	891.768,00	-891.768,00	130.733,19	-131.803,31
MATD3	1.476.922,85	253.530,62	216.878,45	0,22%	222.600,00	-222.600,00	54.388,60	-54.833,80
MAXR11	1.392.458,00	67.422,02	41.509,99	0,04%	747.649,16	-747.649,16	438.421,46	-442.010,18
MGLU3	395.819,88	53.623,44	17.980,14	0,02%	-238.037,88	32.466,75	85.884,09	-112.409,77
MOVIZ7	1.232.731,02	1.302,39	1.180,57	0,00%	-175.016,72	174.691,94	117.888,25	-158.242,47
MOVIZ37	8.858.693,61	113.791,19	102.640,24	0,11%				

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2023



Data: 31/08/2023

## Relatório de Risco de Mercado

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

Dados Gerais		Limite Fundo:		0,00%		Dutação DC:		1.772,54	
PL:	4.486.939.781,74	VAR / PL:	2,1272%	Status:	ENQUADRADO	Dutação DU:			
VAR:	97.487.976,27	ETL / PL:	2,7247%	Benchmark:					
ETL:	122.253.855,26	VAR / CDI:	0,0243%						1.218,57

### Cenários de STRESS

Cenário Alta - 09999 (+):	181.176.479,95	Cenário Baixa - 10000 (+):	303.665.030,66	CENARIO BRADESCO 1 (+):	378.092.187,86	CENARIO BRADESCO 2 (+):	49.365.244,66
Cenário Alta - 09999 (-):	(220.428.640,41)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(189.676.865,99)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(69.763.869,28)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(392.468.612,66)
Cenário Alta - 09999:	(39.252.160,47)	Cenário Baixa - 10000:	113.988.164,67	CENARIO BRADESCO 1:	308.328.318,58	CENARIO BRADESCO 2:	(343.103.367,90)

### Parâmetros do Cálculo

Modelo:	Var paramétrico	Modelo Volatilidade:	EWMA
Int. Confiância:	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
MIRFG3	43.163,25	3.707,98	2.772,37	0,00%	-648.229,75	702.039,77	467.462,18	-618.325,31
MIRVE3	2.202.215,52	764.469,93	656.924,22	0,71%	-1.245.637,49	1.349.039,77	896.274,76	-1.166.173,15
MITR19	12.361.408,04	88.190,43	80.506,50	0,08%	-200.480,74	232.845,95	155.910,21	-204.906,85
MULT3	1.484.795,84	89.533,62	66.974,43	0,07%	-724.409,01	863.611,96	600.171,64	-780.543,32
NEWL11	1.463.817,60	80.478,01	60.705,03	0,06%	-1.434.904,99	1.702.240,28	1.213.634,90	-1.553.391,88
NEWU11	891.768,00	26.709,64	15.895,68	0,02%	-17.382.459,77	23.677.458,94	17.116.931,34	-21.091.275,50
NINJ3	371.000,00	52.628,78	1.546,67	0,00%	-2.645.839,14	3.920.690,30	2.813.005,62	-3.335.366,62
NTCO3	2.990.596,62	844.428,45	817.546,89	0,84%	-19.962.009,73	38.791.852,00	25.287.026,64	-29.014.839,49
NTEN11	3.628.146,86	22.225,46	17.412,89	0,02%	-691.895,51	1.271.949,05	864.148,35	-961.896,37
NTNB20240815 - 760199_NEGOCIACAO	12.776.214,79	68.934,25	-47.611,59	-0,05%	-72.366.276,25	133.034.851,77	90.382.431,54	-100.606.027,65
NTNB20250515 - 760199_NEGOCIACAO	12.124.589,85	82.045,70	-39.868,60	-0,04%	-24.910.697,39	44.278.397,58	30.782.586,19	-33.509.846,69
NTNB20260815 - 760199_NEGOCIACAO	22.023.593,70	191.509,47	-47.058,31	-0,05%	-11.714,16	10.146,96	14.714,90	-19.169,55
NTNB20270515 - 760199_NEGOCIACAO	22.023.593,70	191.509,47	-47.058,31	-0,05%	-7.940,81	6.828,99	9.598,47	-13.285,82
NTNB20280815 - 760199_NEGOCIACAO	17.527.394,36	45.030,79	98.124,79	0,10%	-737.748,22	-103.082,44	158.113,08	-211.291,38
NTNB20280815 - 760199_NEGOCIACAO	6.945.061,19	246.766,13	233.277,19	0,24%	529.375,00	-529.375,00	221.732,50	-223.547,50
NTSD35	1.967.977,91	3.338,55	2.919,69	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
OMGE13	3.254.759,55	1.777,99	1.620,05	0,00%	-1.583,96	1.287,26	2.048,91	-2.979,20
ONCO3	1.512.500,00	190.213,94	41.242,43	0,04%	-5.757,34	4.805,68	6.940,53	-9.619,02
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-637.025,14	77.951,08	225.133,51	-295.011,48
OVSA10	1.838.271,46	201,46	181,62	0,00%	3.087.702,75	-3.087.702,75	905.314,45	-912.724,93
PALFA1	2.487.212,87	1.299,93	1.184,56	0,00%	9.946,69	-9.946,69	5.832,74	-5.890,48
PASN12	10.615.347,58	55.876,83	40.530,19	0,04%	3.010.705,01	-3.612.880,87	1.755.477,42	-1.779.928,80
PATC11	6.175.405,50	514.625,04	101.176,09	0,10%	5.923.808,00	-7.108.569,59	5.473.721,01	-3.502.155,29
PCAR3	39.786,76	50.200,12	42.572,48	0,04%	-321.169,49	-73.803,42	54.923,91	-74.007,90
PETR3	12.042.820,02	1.315.299,32	538.890,52	0,55%	10.347,61	-10.347,61	6.067,84	-6.117,51
PETR4	23.695.231,98	2.424.019,25	689.582,61	0,71%	9.538.613,70	-9.538.613,70	2.330.601,28	-2.349.678,51
PETZ3	41.390,44	9.964,35	8.418,30	0,01%	-11,40	11,40	29,45	-44,34
PRIO3	15.897.689,50	2.129.566,56	918.390,58	0,94%	2.820.474,96	-2.820.474,96	826.963,26	-833.732,40
PRLG14	1.143.022,82	2,44	-1,80	0,00%	-220.720,77	-33.156,57	46.173,70	-61.789,53
QAGR11	5.640.949,92	158.087,69	43.489,59	0,04%	1.040.491,73	-1.040.491,73	762.680,44	-768.923,39
QUAT12	4.019.156,54	17.065,86	4.522,26	0,00%	-1.623.732,77	564.190,22	632.788,66	-1.034.483,69
RAD11	5.202.458,54	498.568,95	420.840,69	0,43%	7.469.345,22	-6.073.399,73	2.698.061,82	-3.354.318,86
RAHD11	16.336.984,77	360.030,68	263.124,98	0,27%	77.630,09	-77.630,09	32.515,92	-32.782,06
RAI13	18.404.241,60	1.607.258,37	1.370.035,86	1,41%	0,00	0,00	0,00	0,00
RAIZ4	221.800,26	55.349,51	46.474,08	0,05%	3.254.325,97	-3.254.325,97	477.084,19	-480.989,38
RBCAPMZ	632.240,90	3.517,00	1.066,90	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
RBRL11	3.254.325,97	415.723,24	379.654,15	0,39%	-3.720,96	3.036,54	4.747,68	-6.863,11
RCRB11	5.826.367,74	538.302,83	439.411,14	0,45%	1.063.744,56	-1.063.756,93	519.816,51	-524.071,49
RDCO10	3.855.016,63	530,20	487,30	0,00%	-6.039,89	5.187,45	7.492,41	-9.911,22
RDO3	3.545.815,20	1.143.262,36	1.064.591,27	1,09%	-685.746,63	205.335,34	327.028,02	-412.137,50
RDO3V9	1.100.841,27	1.646,15	1.453,05	0,00%	1.801.741,46	-1.801.741,46	440.225,50	-443.826,96
RCB11	7.526.093,18	126.985,18	101.701,53	0,10%	8.251.905,72	-6.073.399,73	3.327.084,87	-3.354.318,86
RCB29	3.002.902,44	340.382,25	85.468,29	0,09%	-285.690,00	75.428,26	120.853,21	-154.167,79
RENT3	22.694.985,50	3.148.346,30	2.533.062,89	2,60%	-374,73	305,84	526,48	-775,05
RIS412	2.731.822,49	47.748,77	40.497,17	0,04%	-1.498.471,78	583.320,22	833.934,41	-1.018.020,83
RLOG11	1.001.641,59	33,47	24,20	0,00%	18.978,42	-18.978,42	5.564,47	-5.610,02
RMSA12	11.249.639,77	414.939,70	276.258,64	0,28%	72.529,34	-72.529,34	17.721,34	-17.866,40
RNGO11	37.956,84	1.960,07	1.134,48	0,00%	-310,91	252,15	410,65	-600,16
RRRP3	120.882,24	22.736,28	14.920,42	0,02%	-576.042,39	84.950,57	213.622,34	-278.510,97
RSAN24	778.006,30	34,31	29,56	0,00%	71.910,66	-71.910,99	52.711,49	-53.142,96
RSAN44	1.959.927,83	56.709,85	50.481,28	0,05%	965.277,12	-965.277,12	577.186,50	-592.495,83
SANB11	359.559,93	39.472,02	30.993,07	0,03%	-521.143,90	-500.696,23	212.040,48	-213.776,15
SBSF3	3.941.108,48	272.416,74	41.558,19	0,04%	-5.360,71	4.410,77	101.448,96	-9.146,86
SBSF7	2.431.283,28	1.047,30	966,69	0,00%	85.730,40	-85.730,40	20.946,79	-21.118,26
SCAR3	142.884,00	25.036,91	19.462,54	0,02%	55.527,73	-55.528,19	27.134,65	-27.356,66
SLCE3	185.092,44	28.384,98	19.787,44	0,02%	-10.090,37	8.386,20	12.184,48	-16.991,29
SMFT16	3.359.726,28	2.174,17	1.989,76	0,00%	1.234.352,00	-1.234.352,00	452.390,01	-456.093,06
SMFT3	3.085.880,00	553.869,90	497.125,29	0,51%	79.146,38	-79.146,38	38.676,20	-38.992,78
SMT03	263.821,26	32.498,86	-10.915,32	-0,01%	-638,80	521,99	899,59	-1.322,38
SNGO18	1.909.062,71	59,38	46,08	0,00%	-1.175,94	969,96	1.421,93	-2.002,44
SNGO41	2.050.930,90	294,23	215,76	0,00%	89.037,98	-89.041,34	43.509,60	-43.865,75
SOMA3	296.781,25	119.221,31	114.076,67	0,12%	596.235,80	-596.235,80	212.040,48	-213.776,15
STBP3	1.446.388,00	201.058,94	177.459,99	0,18%	3.072.966,33	-2.458.373,06	1.801.987,45	-1.816.737,69
SUZB3	12.291.865,30	1.211.722,25	-176.787,04	-0,18%	30.557,70	-30.557,70	17.919,04	-18.065,71
TAE111	122.230,80	4.778,54	3.272,13	0,00%	-178.201,40	-36.719,69	32.991,36	-44.464,27
TBSP11	2.675.450,00	835,65	771,76	0,00%	-4.428,95	3.648,72	5.426,64	-7.678,02
TCI11	14.058.000,64	345.811,37	245.000,89	0,25%	-1.503.122,75	522.147,19	783.115,42	-966.909,34
TEPP11	5.383.243,80	323.073,08	270.624,61	0,28%	2.691.621,90	-2.691.621,90	789.183,54	-795.643,43
TERMO_RF_PRE	43.426.140,12	788,76	-603,36	0,00%	-1.214,09	1.238,07	5.447,43	-8.290,92
TIMS3	1.468.854,53	80.534,17	3.117,44	0,00%	470.033,45	-337.836,64	215.334,07	-217.096,70
TOT33	2.788.341,04	255.355,95	205.952,57	0,21%	553.856,21	-553.859,21	405.838,90	-409.160,81
TRXF11	7.652.609,20	300.383,67	123.629,62	0,13%	3.831.304,60	-3.831.304,60	1.123.338,51	-1.132.533,64
UGEL11	1.119.920,69	178,41	165,17	0,00%	-1.138,03	926,22	1.418,47	-2.039,86
UGPA3	11.065.505,44	1.201.819,39	882.531,80	0,91%	2.766.376,36	-2.213.101,09	1.622.203,10	-1.635.481,70
UNEG11	10.240.750,91	307.251,54	215.788,77	0,22%	-1.155.533,10	477.025,19	642.399,83	-793.758,56
USIM5	54.640,96	4.052,77	2.329,10	0,00%	21.309,97	-12.021,01	8.010,37	-8.075,93
UTPS21	6.897.813,73	149.700,45	116.432,09	0,12%	-660.653,23	246.237,52	343.790,40	-432.270,91
UTPS22	7.589.000,49	181.613,42	139.808,56	0,14%	-771.544,59	297.090,62	407.696,58	-511.883,53
VALES	38.372.795,00	3.252.613,25	1.003.270,58	1,03%	9.993.198,75	-9.993.198,75	6.625.451,75	-5.671.499,10
VAMO22	1.061.121,57	83,91	76,17	0,00%	-639,81	619,75	819,34	-1.169,17
VAMO33	11.441.191,46	144.050,82	131.410,63	0,13%	-91.599,87	268.398,78	439.356,38	-556.814,26
VAMO34	7.306.515,30	96.571,79	86.696,15	0,09%	-631.673,80	166.230,83	281.450,40	-362.307,43
VBBR3	12.015.835,52	1.555.995,12	232.384,81	0,24%	3.003.958,88	-3.003.958,88	1.761.521,49	-1.775.940,49
VCCS11	1.012.420,44	1.060,39	952,63	0,00%	-4.258,57	3.602,29	5.178,67	-7.036,01
VECS11	3.548.395,52	99,28	75,27	0,00%	-1.058,31	861,30	1.471,35	-



# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2023

## Relatório de Risco de Mercado



Data: 31/08/2023

FUNDO: EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS  
CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais			
PL:	4.486.939.781,74	VAR / PL:	2,1727%
VAR:	97.487.976,27	ETL / PL:	2,7247%
ETL:	122.253.855,26	VAR / CDI:	0,0243%
Limite Fundo:		Status:	ENQUADRADO
Benchmark:		0,00% Dutation DC:	1,772,54
		Dutation DU:	1,218,57

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	181.176.479,95	Cenário Baixa - 10000 (+):	303.665.030,66	CENARIO BRADESCO 1 (+):	378.092.187,86	CENARIO BRADESCO 2 (+):	49.365.244,66
Cenário Alta - 09999 (-):	(220.428.640,41)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(189.676.865,99)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(69.763.869,28)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(392.468.612,56)
Cenário Alta - 09999:	(39.252.160,47)	Cenário Baixa - 10000:	113.988.164,67	CENARIO BRADESCO 1:	308.328.318,58	CENARIO BRADESCO 2:	(343.103.367,90)

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
VMT13	7.235.350,06	137.495,05	109.422,22	0,11%	-664.568,73	232.170,41	335.134,12	-422.638,00
VVF3	629.222,95	34.130,61	13.517,51	0,01%	94.381,92	-94.383,44	92.244,08	-92.999,15
VXL14	1.252.471,91	66,53	58,12	0,00%	-587,05	475,18	772,10	-1.127,42
VRDN12	5.025.719,72	75.929,26	65.065,14	0,07%	-436.965,64	129.437,82	205.167,14	-261.563,61
VVEO15	1.593.811,96	377,81	349,67	0,00%	-2.092,71	1.711,68	2.535,53	-3.613,07
VVEO16	1.101.014,37	309,40	285,99	0,00%	-1.619,89	1.329,23	1.956,64	-2.774,14
WDOU23	-13.803,75	0,00	0,00	0,00%	-147.305,03	147.403,89	-178.805,89	180.365,75
WDOV23	-17.477,37	53.039,20	39.409,56	0,04%	-115.876,73	117.791,23	-148.711,24	149.628,81
WEGE3	4.578.000,96	681.391,66	355.115,93	0,36%	1.144.500,24	-1.144.500,24	671.134,94	-676.628,54
WINV23	5.556,00	30.216,14	-27.907,15	-0,03%	-63.886,14	63.755,81	-50.087,55	50.293,25
XPNV11	3.557.144,85	155.733,31	100.134,70	0,10%	1.778.572,43	-1.778.572,43	521.477,44	-526.746,01
XPL011	906,64	62,07	55,58	0,00%	453,32	-453,32	132,91	-134,00
XPR11	2.015.108,76	60.494,46	-25.007,48	-0,03%	1.007.554,38	-1.007.554,38	295.414,94	-297.833,08
YDUQ3	2.481.066,00	805.588,87	747.209,50	0,77%	967.615,74	-620.266,50	363.724,28	-366.701,56
Total Var:	4.692.883.559,54	139.208.198,47	97.487.976,27	99,90%	-39.252.160,46	113.988.164,67	308.328.318,57	-343.103.367,90



## Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/08/2023

FUNDO: EMBRAERPREV RENDA FIXA  
CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais			
PL:	3.285.822.632,70	VAR / PL:	1,7248%
VAR:	56.674.812,47	ETL / PL:	2,1630%
ETL:	71.072.501,30	VAR / CDI:	0,0193%
Limite Fundo:		Status:	ENQUADRADO
Benchmark:		0,00% Dutation DC:	2,320,28
		Dutation DU:	1,595,08

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (+):	264.989.755,89	CENARIO BRADESCO 1 (+):	221.441.131,66	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
Cenário Alta - 09999 (-):	(191.247.917,78)	Cenário Baixa - 10000 (-):	-	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(249.851.237,96)
Cenário Alta - 09999:	(191.247.917,78)	Cenário Baixa - 10000:	264.989.755,89	CENARIO BRADESCO 1:	221.441.131,66	CENARIO BRADESCO 2:	(249.851.237,96)

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
CAIXA	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
FI RF EMB II	2.774.557.670,38	52.366.197,75	52.261.408,46	92,21%	-146.889.195,16	250.736.202,81	172.240.551,85	-195.264.844,70
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	144.142.978,84	644.620,82	187.860,59	0,33%	-6.715.675,61	363.665,39	2.088.857,52	-2.755.974,20
FIM EMB VI A CRED PRIV	259.377.515,79	1.074.570,90	524.193,33	0,92%	-7.512.292,19	5.364.976,25	33.118.374,89	-34.091.068,18
FIM EMB VII A CRED PRIV	349.874.859,24	5.142.517,24	3.701.350,08	6,53%	-30.130.754,82	8.522.909,44	13.993.347,40	-17.739.350,87
Total Var:	3.527.953.024,25	59.227.906,71	56.674.812,47	99,99%	-191.247.917,78	264.989.755,89	221.441.131,66	-249.851.237,96

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2023



## Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/08/2023

FUNDO: EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL  
CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais		Limite Fundo:		0,00% Dutation DC:	
PL:	567.142.757,42	VAR / PL:	8,4268%	Status:	ENQUADRADO
VAR:	47.792.157,69	ETL / PL:	10,5676%	Benchmark:	Dutation DU:
ETL:	59.933.293,86	VAR / CDI:	0,0944%		1,21

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	139.900.552,35	Cenário Baixa - 10000 (+):	0,58	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	73.523.793,25
Cenário Alta - 09999 (-):	(0,56)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(137.833.422,29)	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	-
Cenário Alta - 09999:	139.900.551,78	Cenário Baixa - 10000:	(137.833.421,71)	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	-
				CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(74.126.651,04)
				CENÁRIO BRADESCO 1:	73.523.793,25
				CENÁRIO BRADESCO 2:	(74.126.651,04)

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	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
CAIXA	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	15.000.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
FIA RVA EMB II	234.570.247,26	18.508.952,44	18.480.900,11	38,67%	55.805.395,16	-56.342.545,07	31.166.685,27	-31.421.971,15
FIA RVA EMB III	102.717.431,90	9.126.493,69	9.066.519,53	18,97%	27.817.282,65	-27.316.088,87	13.498.112,79	-13.610.983,66
FIA RVA EMB IV	97.963.601,18	9.129.272,70	8.988.615,60	18,81%	28.715.134,61	-26.261.171,03	13.454.484,21	-13.565.011,33
FIC FIA EMB VIII ETF	26.102.334,87	2.217.814,16	2.210.120,38	4,82%	-0,57	0,58	2,53	-3,86
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA E	105.928.515,77	9.070.943,86	9.046.002,07	18,93%	27.562.739,92	-27.913.617,32	15.404.508,45	-15.528.681,05
Total Var:	582.282.130,99	48.053.476,85	47.792.157,69	100,00%	139.900.551,78	-137.833.421,71	73.523.793,25	-74.126.651,04



## Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/08/2023

FUNDO: FI RF EMB II  
CNPJ: 11005764000196

Dados Gerais		Limite Fundo:		0,00% Dutation DC:	
PL:	2.611.952.742,14	VAR / PL:	2,0049%	Status:	ENQUADRADO
VAR:	52.366.196,61	ETL / PL:	2,5142%	Benchmark:	Dutation DU:
ETL:	65.659.323,19	VAR / CDI:	0,0225%		2.577,70

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (+):	250.926.214,85	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	172.240.548,11
Cenário Alta - 09999 (-):	(146.889.191,96)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(188.017,48)	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	-
Cenário Alta - 09999:	(146.889.191,96)	Cenário Baixa - 10000:	250.738.197,37	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	-
				CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(195.264.840,46)
				CENÁRIO BRADESCO 1:	172.240.548,11
				CENÁRIO BRADESCO 2:	(195.264.840,46)

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	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
CSMGC3	10.722.292,58	39.517,97	-6.491,05	-0,01%	0,00	0,00	0,00	0,00
ELET42	14.431.103,79	109.453,09	99.123,04	0,19%	0,00	0,00	0,00	0,00
ENTV12	14.101.786,95	114.301,73	106.567,18	0,20%	-18.834,91	19.207,06	84.509,53	-128.622,49
GASP17	50.213.844,15	1.331.477,00	-418.209,10	-0,80%	0,00	0,00	0,00	0,00
IGSN15	2.866.915,41	35.955,40	25.928,32	0,05%	-388.317,23	-57.492,40	73.581,72	-98.946,66
NEOF16	7.214.785,88	57.931,72	53.391,15	0,10%	0,00	0,00	0,00	0,00
NTNB20240815 - 760199_VENCIMENTO	121.219.539,40	654.041,76	-355.570,32	-0,68%	-988.280,80	229.186,38	401.755,38	-525.685,50
NTNB20260815 - 760199_VENCIMENTO	42.320.510,58	368.003,79	23.814,34	0,05%	-1.029.625,84	233.817,42	425.457,40	-553.230,65
NTNB20300815 - 760199_VENCIMENTO	26.619.522,36	321.067,27	312.841,44	0,60%	-1.537.253,37	1.844.753,72	1.217.271,23	-1.599.802,66
NTNB20350515 - 760199_VENCIMENTO	243.997.221,25	5.083.320,93	4.867.204,57	9,29%	-222.594,56	59.060,42	100.594,50	-128.582,49
NTNB20400815 - 760199_VENCIMENTO	30.030.392,17	829.388,11	822.581,73	1,57%	-509.810,40	128.199,33	212.614,80	-277.921,27
NTNB20450515 - 760199_VENCIMENTO	232.221.961,20	7.330.182,45	7.312.364,11	13,96%	-1.660.542,37	1.657.460,86	1.118.512,77	-1.501.389,82
NTNB20500815 - 760199_VENCIMENTO	726.393.235,70	25.809.599,72	25.786.161,60	49,24%	-1.245.637,49	1.349.038,77	898.274,76	-1.188.173,15
NTNB20550515 - 760199_VENCIMENTO	232.627.547,75	8.740.208,78	8.729.669,56	16,67%	-1.434.904,99	1.702.240,28	1.213.634,90	-1.553.991,88
PETR45	9.095.756,15	58.386,09	-21.444,63	-0,04%	-17.382.459,77	23.677.458,94	17.116.931,34	-21.091.275,50
SBSPC2	9.716.528,65	33.221,59	-6.223,40	-0,01%	-2.845.839,14	3.920.690,30	2.813.005,62	-3.335.366,62
SBTOPIND	327.335.654,66	5.071.156,67	5.041.134,16	9,63%	-19.862.009,73	38.791.852,00	25.287.026,64	-29.014.839,49
CAIXA	5.000,00	0,00	0,00	0,00%	-72.366.276,25	133.034.851,77	90.382.431,54	-100.606.027,65
COMPROMISSADA_PRE	673.698.504,07	12.236,50	-6.646,11	-0,01%	-24.910.697,39	44.278.397,58	30.782.588,19	-33.509.646,69
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-73.505,60	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-321.169,49	-73.803,42	54.923,91	-74.007,90
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-295.038,23	-56.721,67	57.433,89	-77.330,05
Total Var:	2.774.557.610,09	55.999.462,58	52.366.196,61	100,00%	-146.889.191,96	250.738.197,37	172.240.548,10	-195.264.840,46



# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2023



## Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/08/2023

FUNDO: FI RF EMB V CREDITO PRIVADO  
CNPJ: 20726178000121

Dados Gerais					
PL:	138.396.197,22	VAR / PL:	0,4658%	Limite Fundo:	0,00%
VAR:	644.620,82	ETL / PL:	0,5841%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	808.380,51	VAR / CDI:	0,0052%	Benchmark:	
				Dutacion DC:	819,91
				Dutacion DU:	562,41

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (+):	975.108,69	CENARIO BRADESCO 1 (+):	2.088.857,52
Cenário Alta - 09999 (-):	(6.715.675,61)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(611.443,30)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-
Cenário Alta - 09999:	(6.715.675,61)	Cenário Baixa - 10000:	363.665,38	CENARIO BRADESCO 1:	2.088.857,52
				CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	(2.755.974,20)
				CENARIO BRADESCO 2:	(2.755.974,20)

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
17H0164854	8.169.897,68	34.350,12	32.825,52	5,09%	-390.004,99	-18.879,84	101.320,70	-134.828,50
AEGP23	14.520.792,42	55.756,69	48.482,34	7,52%	-556.663,13	-65.315,69	122.324,11	-164.306,93
CCRDD1	6.322.923,58	27.279,27	18.855,99	2,93%	0,00	0,00	0,00	0,00
CMDT33	1.397.962,89	4.774,05	3.763,50	0,58%	-146.893,20	-27.850,90	28.345,66	-38.199,45
ENJG21	1.882.275,90	7.615,59	7.363,07	1,14%	-42.537,92	-8.188,71	8.274,23	-11.140,48
ENMI21	1.181.054,96	4.892,29	4.708,01	0,73%	-20,96	21,38	94,06	-143,15
ENTV12	18.537.974,10	150.259,16	46.648,03	7,24%	0,00	0,00	0,00	0,00
ERDV17_VENCIMENTO	12.703.368,53	46.294,53	36.364,33	5,64%	0,00	0,00	0,00	0,00
ERDV36	4.336.624,94	18.777,83	12.916,83	2,00%	-86.807,19	-5.788,31	21.764,26	-29.007,51
GASP17	10.389.071,20	275.478,00	204.795,46	31,77%	-56.316,80	-3.613,54	14.183,15	-18.896,42
GRRB24_VENCIMENTO	15.703.059,85	126.399,85	73.849,22	11,46%	-1.353.397,52	307.372,48	559.299,21	-727.267,79
LFSN16000GM	14.560.785,02	45.475,59	41.302,77	6,41%	-466.893,69	-60.975,58	100.346,11	-134.862,72
LFSN18000DC5	4.792.760,86	19.482,90	16.117,80	2,50%	-99.879,12	-19.056,30	19.230,57	-25.916,24
OMGE31	12.900.778,20	56.890,88	51.681,12	8,02%	-318.052,42	381.673,18	251.849,22	-330.993,65
SBSPC2	7.446.364,62	25.459,72	20.050,24	3,11%	-1.095.841,56	286.041,64	461.365,21	-603.288,33
TAE33	8.571.751,66	38.335,76	24.891,64	3,86%	-696.685,60	-168.391,38	115.257,46	-154.964,93
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	-263.626,22	-50.131,78	50.084,07	-67.139,74
COMPROMISSADA_PRE	749.801,34	13,62	4,95	0,00%	-737.748,22	-103.082,44	158.113,08	-211.291,38
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-25.268,91	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-226.105,67	-43.469,25	44.015,07	-59.262,71
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-178.201,40	-36.719,59	32.991,36	-44.464,27
<b>Total Var:</b>	<b>144.142.978,81</b>	<b>937.535,84</b>	<b>644.620,82</b>	<b>100,00%</b>	<b>-6.715.675,61</b>	<b>363.665,38</b>	<b>2.088.857,52</b>	<b>-2.755.974,20</b>

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2023



## Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/08/2023

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

Dados Gerais		Limite Fundo:		ENQUADRADO		0,00% Dutation DC:		715,12	
PL:	246.701.373,43	VAR / PL:	0,4356%	Status:		Dutation DU:			491,07
VAR:	1.074.570,82	ETL / PL:	0,5462%	Benchmark:					
ETL:	1.347.555,16	VAR / CDI:	0,0049%						

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	798.594,54	Cenário Baixa - 10000 (+):	6.779.525,72	CENARIO BRADESCO 1 (+):	38.750.537,87	CENARIO BRADESCO 2 (+):	2.827.722,58
Cenário Alta - 09999 (-):	(8.310.886,12)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(1.414.547,90)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(5.632.165,66)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(36.918.788,01)
Cenário Alta - 09999:	(7.512.291,58)	Cenário Baixa - 10000:	5.364.977,82	CENARIO BRADESCO 1:	33.118.372,21	CENARIO BRADESCO 2:	(34.091.065,43)

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
020913	2.177.294,53	256.728,54	14.726,81	1,37%	0,00	0,00	0,00	0,00
AEGP11	1.999.677,88	1.781,24	231,78	0,02%	-7.625,20	6.391,12	9.199,47	-12.650,02
AMBPF13	2.587.150,50	797,48	172,69	0,02%	-4.450,03	3.658,26	5.481,99	-7.798,00
APRB28	1.246.774,39	87,26	21,53	0,00%	-529,46	433,25	658,14	-943,30
BCBF15	3.118.016,22	94,19	48,62	0,00%	-988,01	806,95	1.393,33	-2.047,46
BKBR18	1.086.067,77	7,50	4,20	0,00%	-74,44	64,11	138,14	-206,39
BRELETRO	2.631.581,86	56.847,65	-3.479,80	-0,32%	0,00	0,00	0,00	0,00
BRKPA0	3.449.081,86	1.335,87	278,19	0,03%	-7.147,76	5.843,95	8.605,39	-12.241,83
CAIXA	10.000,22	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CART13	979.193,60	15.215,67	3.739,36	0,35%	-86.080,96	26.062,23	40.726,68	-61.855,15
CBAN22	4.178.314,70	27.591,11	-49,99	0,00%	-65.049,05	59.621,71	80.882,57	-98.986,22
CCPRA3	43.058,27	0,04	0,01	0,00%	-0,10	0,10	0,42	-0,64
CEA892	556.379,89	189,04	37,20	0,00%	-999,95	823,33	1.224,47	-1.732,42
CELG12	3.232.937,68	229,63	86,53	0,01%	-1.869,89	1.512,77	2.404,26	-3.503,20
COMPROMISSADA_PRE	96.108.561,12	1.745,64	-56,13	-0,01%	-2.686,95	2.740,04	12.055,97	-18.349,04
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-82.917,72	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPMU23C099250	29,80	45,42	16,55	0,00%	-0,01	0,01	0,05	-0,08
CSAN23	1.111.423,49	1.731,73	147,90	0,01%	-6.357,97	5.460,15	7.887,00	-10.435,99
CSMG7	2.150.477,37	873,99	122,90	0,01%	-3.894,07	3.254,67	4.723,99	-6.528,53
DAPK25	-74.771,67	335.898,91	216.320,05	20,13%	-624.223,23	783.365,70	7.598.264,42	-7.648.502,38
DAPK27	-84.010,52	155.839,86	113.826,24	10,59%	-582.717,38	599.547,57	3.151.972,98	-3.159.880,45
DAPK35	8.366,72	28.680,78	-8.956,20	-0,83%	97.467,03	-96.735,72	-233.638,16	225.695,87
DAPQ24	-33.439,59	373.024,36	207.399,40	19,30%	-415.782,13	710.543,34	11.181.342,07	-11.264.842,39
DAPQ26	-244.940,39	547.672,42	371.532,70	34,57%	-1.637.563,94	1.752.926,24	10.967.299,15	-11.015.988,71
DAPQ28	50.289,95	80.059,04	-56.255,14	-5,24%	357.281,21	-350.777,65	-1.510.678,72	1.508.486,42
DAPQ30	41.351,67	79.435,56	-37.838,91	-3,52%	323.794,53	-317.746,66	-1.055.217,40	1.045.625,30
DAPQ32	1.105,49	2.454,16	-827,47	-0,08%	8.608,76	-8.440,59	-24.119,29	23.657,22
DASAA2	2.691.327,43	10,51	6,03	0,00%	-112,39	96,24	198,26	-295,53
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DHF26	-9.303,33	28.287,21	4.909,55	0,46%	-133.971,33	108.831,42	151.936,37	-215.065,93
DHF29	-3.517,53	13.141,91	569,06	0,05%	-41.203,49	36.354,21	52.117,96	-66.589,32
DHN25	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DHN26	-20.783,78	63.678,59	8.802,49	0,82%	-261.284,50	216.100,59	299.007,74	-416.635,01
GBSP11	2.778.875,51	92.337,06	3.585,81	0,33%	-345.783,64	126.506,85	189.422,26	-2.924,14
GGSH12	2.494.338,98	148,43	63,60	0,01%	-1.339,62	1.090,23	1.622,74	-2.866,90
GUAR15	2.727.033,59	549,53	142,58	0,01%	-3.435,17	2.894,86	4.285,05	-6.159,04
IJZTC14	2.503.861,43	37.353,70	9.172,83	0,85%	-214.286,53	63.405,82	100.694,10	-127.987,34
IDIF24P380200	-150,45	503,18	-136,60	-0,01%	150,45	-631.829,82	-2.792.640,07	150,45
IDIF24P380300	481,44	1.466,07	398,00	0,04%	-481,44	727.758,33	2.889.811,80	-481,44
IGT437	2.200.055,61	373,75	-195,89	-0,02%	3.816,78	-2.988,95	-4.891,23	7.317,15
INSSSN1	1.567.068,24	40.703,98	2.632,62	0,24%	0,00	0,00	0,00	0,00
IRJS14	1.672.347,49	63.819,38	2.370,64	0,22%	-228.537,11	89.518,85	127.988,58	-155.769,81
JSMILB5	3.350.150,90	42.547,78	14.646,86	1,36%	-284.926,92	74.150,20	126.228,18	-162.605,25
LCAMA9	1.906.951,30	112,95	51,50	0,00%	-1.074,48	875,62	1.454,76	-2.130,15
LCAMD1	5.182.154,86	69.339,50	22.851,59	2,13%	-450.823,19	120.370,87	201.676,45	-259.632,97
LF001800FAU	4.357.236,40	40.305,66	26.512,53	2,47%	-305.363,06	109.556,49	143.193,33	-187.061,89
LF002100SQ1	2.386.871,79	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF00210001F	1.256.802,27	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002200019	2.371.957,01	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFSC190054B	866.359,91	0,00	0,00	0,00%	2.093,73	-1.691,22	-3.092,97	4.728,82
LFSC190059S	1.312.238,84	0,00	0,00	0,00%	3.194,06	-2.577,85	-4.705,57	7.194,47
LFSC19005L1	868.070,83	0,00	0,00	0,00%	2.187,99	-1.759,23	-3.181,65	4.865,00
LFSC22002IX	5.220.744,93	2.342,34	453,43	0,04%	-11.928,64	9.760,46	14.190,82	-20.098,65
LFSN210029N	4.274.207,18	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20240301 - 210100	10.740.656,99	609,80	-45,48	0,00%	-11.514,58	13.130,59	0,00	0,00
LFT20240901 - 210100	1.153.730,16	132,23	-36,76	0,00%	-3.337,65	4.226,35	-0,99	0,90
LIGHB4	2.297.499,17	5,92	1,00	0,00%	-18,15	18,40	69,02	-104,57
LIGHD3	907.811,28	511,12	75,56	0,01%	-2.305,40	1.917,98	2.772,56	-3.855,19
LRN81	1.355.195,45	10,26	6,89	0,00%	-128,46	105,59	193,49	-286,76
MOV27	1.232.731,02	1.302,39	167,83	0,02%	-5.554,33	4.637,37	6.705,69	-9.219,62
MTRJ19	3.358.176,04	23.919,65	13.408,28	1,25%	-226.752,31	43.466,08	90.319,50	-117.265,52
NTEN11	3.628.146,86	22.225,46	15.756,81	1,47%	-238.037,88	32.466,75	85.884,09	-112.409,77
NTNB20240815 - 760199_NEGOCIACAO	103.000,76	555,74	230,37	0,02%	-1.410,97	1.408,35	950,41	-1.275,74
NTNB20250515 - 760199_NEGOCIACAO	592.268,87	4.007,82	2.492,50	0,23%	-11.991,67	11.813,90	7.962,34	-10.631,57
NTNB20260815 - 760199_NEGOCIACAO	2.395.340,90	20.829,01	13.304,17	1,24%	-70.503,08	76.355,59	50.842,35	-67.250,60
NTNB20270515 - 760199_NEGOCIACAO	706.736,66	5.806,99	4.036,58	0,38%	-23.535,32	27.334,81	18.302,99	-24.054,92
NTNB20280815 - 760199_NEGOCIACAO	572.846,47	50.668,60	37.556,55	3,50%	-236.758,07	282.253,66	196.153,66	-255.104,40
NTNB20500815 - 760199_NEGOCIACAO	431.613,97	15.335,75	6.827,72	0,64%	-42.999,16	79.047,68	53.704,14	-59.778,87
NTSD35	1.967.977,91	3.338,55	248,75	0,02%	-11.714,16	10.146,56	14.714,90	-19.169,56
OMG313	2.236.640,15	1.221,82	173,78	0,02%	-5.456,85	4.555,38	6.595,98	-9.129,89
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
OVS410	1.838.271,46	201,46	71,59	0,01%	-1.593,96	1.287,26	2.045,81	-2.979,20
PASN12	3.857.901,59	20.307,14	15.332,10	1,43%	-231.511,99	28.329,51	81.819,55	-107.215,07
RAHD11	3.469.766,16	76.465,90	8.950,91	0,83%	-344.860,03	117.700,78	176.873,64	-219.711,08
RBCAPMZ	632.240,90	3.517,00	-361,36	-0,03%	0,00	0,00	0,00	0,00
RDCO10	3.855.016,63	530,20	160,80	0,01%	-3.720,96	3.036,54	4.747,68	-6.863,11
RDORB9	1.100.841,27	1.646,15	140,34	0,01%	-6.039,89	5.187,45	7.492,41	-9.911,22
RIS412	2.731.822,49	47.748,77	10.777,49	1,00%	-255.690,00	75.426,26	120.853,21	-154.167,79
RLOG11	1.001.641,59	33,47	18,91	0,00%	-374,73	305,84	526,48	-775,05
RSAN24	778.006,30	34,31	14,79	0,00%	-310,91	252,15	410,65	-600,16
RSAN44	869.490,61	6.042,68	3.762,26	0,35%	-61.380,87	9.052,01	22.762,78	-29.677,06
SNGO18	1.909.062,71	59,38	31,47	0,00%	-638,80	521,99	899,59	-1.322,38
SNGO41	520.030,90	234,23	42,50	0,00%	-1.175,94	969,98	1.421,93	-2.902,44
TBSP11	2.675.450,00	835,65	165,61	0,02%	-4.428,95	3.648,72	5.426,64	-7.678,02



## Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/08/2023

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

Dados Gerais							
PL:	246.701.373,43	VAR / PL:	0,4356%	Limite Fundo:	0,00%	Dutation DC:	715,12
VAR:	1.074.570,82	ETL / PL:	0,5462%	Status:	ENQUADRADO	Dutation DU:	491,07
ETL:	1.347.555,16	VAR / CDI:	0,0049%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	798.594,54	Cenário Baixa - 10000 (+):	6.779.525,72	CENARIO BRADESCO 1 (+):	38.750.537,87	CENARIO BRADESCO 2 (+):	2.827.722,58
Cenário Alta - 09999 (-):	(8.310.886,12)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(1.414.547,90)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(5.632.165,66)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(36.918.788,01)
Cenário Alta - 09999:	(7.512.291,58)	Cenário Baixa - 10000:	5.364.977,82	CENARIO BRADESCO 1:	33.118.372,21	CENARIO BRADESCO 2:	(34.091.065,43)

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
UGEL11	1.119.520,69	175,41	47,92	0,00%	-1.135,05	925,22	1.415,47	-2.039,86
UNEG11	4.635.842,10	139.086,40	9.860,14	0,92%	-523.093,38	215.942,51	290.805,25	-359.323,20
VAMQ33	2.805.646,61	35.324,62	12.932,37	1,20%	-240.711,15	65.815,16	107.740,42	-138.947,01
VCCS11	1.012.420,44	1.060,39	116,17	0,01%	-4.258,57	3.602,29	5.178,67	-7.036,01
VECS11	3.548.395,52	99,28	53,16	0,00%	-1.058,31	861,30	1.471,35	-2.164,20
VERDECS2	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
VIXL14	1.252.471,91	66,53	27,71	0,00%	-587,05	475,18	772,10	-1.127,42
VVEO15	1.593.811,96	377,81	82,26	0,01%	-2.092,71	1.711,68	2.535,53	-3.613,07
VVEO16	1.101.014,37	309,40	61,33	0,01%	-1.619,89	1.329,23	1.956,64	-2.774,14
<b>Total Var:</b>	<b>259.377.494,82</b>	<b>2.950.027,80</b>	<b>1.074.570,82</b>	<b>99,99%</b>	<b>-7.512.291,58</b>	<b>5.364.977,82</b>	<b>33.118.372,22</b>	<b>-34.091.065,43</b>

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2023



## Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/08/2023

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

Dados Gerais		Limite Fundo:		0,00% Dutation DC:	
PL:	288.772.319,91	VAR / PL:	1,7783%	Status:	ENQUADRADO
VAR:	5.135.197,84	ETL / PL:	2,2300%	Benchmark:	
ETL:	6.439.745,27	VAR / CDI:	0,0199%	Dutation DU:	2.086,76
					1.433,95

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (+):	8.671.704,20	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	13.973.430,54
Cenário Alta - 09999 (-):	(30.087.869,43)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(160.925,50)	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	-
Cenário Alta - 09999:	(30.087.869,43)	Cenário Baixa - 10000:	8.510.778,70	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	-
				CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(17.714.102,29)
				CENÁRIO BRADESCO 2:	(17.714.102,29)

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	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
ANEM11	10.868.816,73	241.202,56	236.504,93	4,61%	-1.071.787,19	380.940,33	554.251,89	-690.613,17
ANET11	2.451.179,62	11.217,11	1.258,16	0,02%	-124.810,12	6.966,86	39.397,19	-51.960,53
ASAB11	6.579.945,61	65.615,44	64.286,54	1,25%	-486.319,15	113.006,00	289.096,11	-269.065,98
BRKP28	9.354.775,06	224.462,43	221.906,06	4,32%	-962.981,66	314.342,44	482.433,09	-609.989,66
BTOW15	5.303.904,10	110.084,27	109.894,11	2,14%	-566.979,21	167.736,89	266.408,39	-341.269,50
CAEC21	9.050.881,17	64.322,19	23.286,13	0,45%	-595.496,43	106.225,17	224.712,80	-294.938,29
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CART13	9.982.687,98	155.120,77	155.070,61	3,02%	-877.578,63	265.699,33	415.200,56	-528.653,19
CBAN32	9.989.107,06	159.939,06	159.724,79	3,11%	-900.957,52	278.841,35	428.428,74	-548.201,02
CBAN72	4.695.949,34	81.926,18	81.867,31	1,59%	-436.365,63	139.153,68	211.186,21	-269.079,99
CJEN13	7.092.426,75	108.552,16	108.533,88	2,11%	-613.217,72	186.211,37	290.479,90	-369.185,20
CNRD11	10.342.203,03	203.234,06	202.310,72	3,94%	-976.677,33	338.709,66	490.803,85	-620.112,61
COMPROMISSADA_PRE	2.169.383,16	39,40	-31,31	0,00%	-60,65	61,85	272,13	-414,18
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-156.318,79	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CONX12	9.989.940,98	69.556,60	32.052,49	0,62%	-577.483,05	113.997,83	253.625,08	-332.332,71
CREDEM24	423.129,56	83.399,09	67.414,48	1,31%	0,00	0,00	0,00	0,00
CRMG15	8.397.275,33	58.342,38	46.228,13	0,90%	-566.704,58	94.065,92	216.677,57	-282.002,50
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ERDV17	6.665.034,02	24.289,20	-6.071,58	-0,12%	-244.963,56	-31.991,85	52.648,26	-70.757,98
ERDV38	5.845.712,38	23.576,10	253,88	0,00%	-321.401,86	-50.506,98	66.193,76	-88.550,02
GBSP11	5.203.461,30	172.901,70	163.138,42	3,18%	-647.481,96	236.884,84	354.694,33	-430.006,30
GRRB24	8.273.517,69	66.596,66	34.375,56	0,67%	-577.369,29	150.707,61	243.080,86	-317.856,31
HARG11	10.846.643,49	213.237,93	211.027,73	4,11%	-995.207,56	357.327,01	508.874,13	-638.840,01
HBSA21	7.824.384,40	109.889,05	108.882,57	2,12%	-694.360,95	187.994,22	312.824,43	-402.393,30
HVRD15	10.944.176,43	211.914,82	211.700,93	4,12%	-1.075.106,23	381.261,32	540.427,63	-685.479,62
IPIL11	9.218.037,00	105.618,92	105.041,93	2,05%	-715.043,68	186.778,85	318.581,15	-407.090,22
IRBR12	11.546.701,73	60.069,58	1.713,26	0,03%	-690.490,97	-45.270,10	173.223,25	-230.618,34
ITPO14	6.348.119,68	202.482,27	200.349,94	3,90%	-890.044,22	339.404,06	464.069,01	-582.842,63
LAMEA6	9.106.756,11	117.467,51	116.103,44	2,26%	-777.544,89	195.576,33	340.546,19	-438.794,99
LCAMD1	7.823.758,31	104.685,31	103.337,21	2,01%	-680.630,32	181.729,92	304.481,01	-391.980,88
LORTA7	6.479.335,32	90.393,58	89.428,51	1,74%	-576.022,21	155.071,67	258.206,00	-332.421,07
MOVIS7	8.858.693,61	113.791,19	112.040,64	2,18%	-757.108,16	198.145,45	326.127,26	-432.934,32
MTRJ19	9.023.232,01	64.270,78	55.925,40	1,09%	-609.270,83	116.790,94	242.683,47	-315.085,91
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PASN12	6.757.446,00	35.569,69	18.057,80	0,35%	-405.513,14	49.621,57	143.313,96	-187.796,41
QUAT12	4.019.156,54	17.085,86	-256,81	-0,01%	-220.720,77	-33.156,57	46.173,70	-61.789,53
RAHD11	12.867.218,61	283.564,78	277.332,38	5,40%	-1.278.872,74	436.479,45	655.915,02	-814.772,61
RDVE11	7.526.093,18	126.986,78	126.532,85	2,46%	-685.746,63	205.335,34	327.028,02	-412.137,50
RMSA12	11.249.639,77	414.939,70	394.421,65	7,68%	-1.498.471,78	583.320,22	833.934,41	-1.018.020,83
RSAN44	7.290.437,22	50.666,18	39.109,54	0,76%	-514.661,53	75.898,56	190.859,56	-248.833,91
TGI11	14.059.000,64	345.811,37	335.572,23	6,53%	-1.503.122,75	522.147,19	783.115,42	-956.909,34
UNEG11	5.604.908,81	168.163,14	162.269,96	3,16%	-632.439,72	261.082,68	351.594,57	-434.435,37
UTPS21	6.697.813,73	149.700,45	148.068,72	2,88%	-660.653,23	246.237,52	343.790,40	-432.270,91
UTPS22	7.589.000,49	181.613,42	179.178,97	3,49%	-771.544,59	297.090,62	407.696,58	-511.883,53
VAMO33	8.635.544,85	108.726,20	106.081,22	2,07%	-740.888,72	202.573,60	331.615,97	-427.667,25
VAMO34	7.306.515,30	96.571,79	95.388,59	1,86%	-631.673,80	166.230,83	281.450,40	-362.307,43
VERDECS2	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
VERO12	4.970.588,98	35.966,47	23.323,19	0,45%	-342.560,14	70.447,01	136.005,02	-177.585,65
VIMT13	7.235.350,06	137.495,05	136.686,91	2,66%	-664.568,73	232.170,41	335.134,12	-422.638,00
VRDN12	5.025.719,72	75.929,26	75.875,82	1,48%	-436.965,64	129.437,82	205.167,14	-261.563,61
<b>Total Var:</b>	<b>349.376.879,04</b>	<b>5.545.008,45</b>	<b>5.135.197,84</b>	<b>99,95%</b>	<b>-30.087.869,44</b>	<b>8.510.778,70</b>	<b>13.973.430,54</b>	<b>-17.714.102,28</b>

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2023



## Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/08/2023

FUNDO: FIM EMB I A  
CNPJ: 20725946000122

Dados Gerais			
PL:	414.335.769,42	VAR / PL:	0,6371%
VAR:	2.639.724,98	ETL / PL:	0,7989%
ETL:	3.310.321,62	VAR / CDI:	0,0074%
Limite Fundo:		Status:	ENQUADRADO
Benchmark:		Dutacion DC:	0,00%
		Dutacion DU:	
			302,31
			207,95

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	12.223.854,31	Cenário Baixa - 10000 (-):	32.117.654,93	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	73.859.027,13
Cenário Alta - 09999 (-):	(23.152.897,56)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(22.947.224,84)	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	(62.993.562,47)
Cenário Alta - 09999:	(10.929.043,26)	Cenário Baixa - 10000:	9.170.430,08	CENÁRIO BRADESCO 1:	10.865.464,66
				CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	39.225.465,31
				CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(56.926.042,99)
				CENÁRIO BRADESCO 2:	(16.700.577,68)

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	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
ANHB10	661.053,79	25,27	23,90	0,00%	-193,54	157,26	251,46	-365,23
BCBF14	274.185,54	6,68	4,83	0,00%	-72,74	59,18	102,40	-150,67
CAIXA	9.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CBAN22	4.486.660,91	29.627,25	28.207,98	1,07%	-69.849,46	64.021,60	86.851,44	-106.301,82
CEEBA3	1.957.326,60	286,26	281,76	0,01%	-1.746,07	1.416,92	2.131,27	-3.062,24
CGBP13	2.236.456,01	1.126,04	1.122,54	0,04%	-5.029,63	4.204,39	6.122,51	-8.465,21
COMPROMISSADA_PRE	266.447.151,22	4.839,53	-4.031,63	-0,15%	-7.449,19	7.596,37	33.423,44	-50.870,08
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-31.442,32	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPMU23C100000	-7,95	0,92	2,51	0,00%	0,00	0,00	0,00	-0,01
CPMX23C099250	47,02	24,70	-13,35	0,00%	-0,07	0,07	0,25	-0,38
CPTX12	1.974.698,71	1.421,88	1.410,35	0,05%	-5.652,40	4.804,68	6.976,23	-9.397,10
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DHF24	1.544,58	15.857,89	12.932,72	0,49%	88.414,31	-84.879,78	-213.566,88	321.139,21
DHF25	-21.800,70	67.769,57	61.396,23	2,33%	-531.425,87	423.257,57	653.611,53	-953.093,34
DHF26	-613.728,85	1.866.071,60	1.861.926,26	70,53%	-8.837.921,11	7.179.472,67	10.023.052,69	-14.187.630,52
DHF27	-4.661,29	14.300,55	14.205,26	0,54%	-54.162,74	45.448,15	63.046,26	-86.372,25
DHF28	118.159,65	362.024,56	-360.967,78	-13,67%	1.485.450,74	-1.228.571,88	-1.699.914,36	2.368.647,19
DHF29	9,87	544,63	453,71	0,02%	838,31	-854,88	-3.761,39	5.724,79
DOLU23	13.305,75	0,00	0,00	0,00%	147.305,03	-147.403,89	178.805,89	-180.365,75
DOLV23	-16.645,11	50.513,53	41.709,26	1,58%	-110.358,79	112.182,13	-141.629,75	142.503,63
ELET13	2.126.576,77	236,49	225,02	0,01%	-1.734,26	1.400,59	2.183,24	-3.167,50
EQT13	1.497.998,52	9,25	-4,60	0,00%	-87,75	75,68	164,94	-246,58
ETEN13	1.368.772,03	0,42	-0,37	0,00%	-0,92	0,94	4,09	-6,22
GRRB14	1.065.771,80	45,11	42,64	0,00%	-342,11	277,72	437,85	-635,79
IDIF24C381500	9.604,58	15.037,61	12.263,76	0,46%	567.671,79	-9.604,58	-9.604,58	2.765.651,94
IDIF24C381600	-7.961,07	11.886,68	-9.694,05	-0,37%	-515.970,86	7.961,07	7.961,07	-2.713.986,63
IDIF24C381800	-5.919,51	8.033,94	-6.551,99	-0,25%	-415.699,18	5.919,44	5.919,51	-2.609.410,56
IDIF24C381900	5.263,09	6.817,82	5.560,20	0,21%	369.357,08	-5.262,93	-5.263,09	2.556.758,17
IDIF24C382000	6.658,02	8.241,85	6.721,54	0,26%	457.540,00	-6.657,59	-6.658,02	3.506.432,18
IDIF24C382100	-5.479,16	6.655,72	-5.452,46	-0,21%	-401.900,70	5.478,66	5.479,16	-3.432.959,73
IDIF24C382200	-13.200,66	15.246,16	-12.433,83	-0,47%	-1.136.766,92	13.197,21	13.200,66	-15.522.392,95
IDIF24C382600	14.137,62	16.114,54	13.142,03	0,50%	1.242.603,62	-14.133,06	-14.137,62	19.171.488,96
IDIF24C382700	-2.536,69	2.847,08	-2.321,90	-0,09%	-223.975,04	2.536,69	2.536,69	-3.899.973,28
IDIF24P380200	334,65	1.119,24	-91,79	-0,03%	-334,65	1.405.396,15	6.211.744,77	-334,65
IDIF24P380300	-1.070,88	3.261,02	2.659,48	0,10%	1.070,88	-1.618.772,51	-6.427.886,46	1.070,88
IDIF24P381000	24.758,53	64.348,67	-52.478,83	-1,99%	-24.758,53	753.475,44	1.952.221,31	-24.758,53
IDIF24P381100	-128.245,37	194.281,17	158.443,83	6,00%	128.245,37	-1.535.497,60	-3.933.618,60	128.245,37
IDIF24P381200	-172.796,33	178.258,74	145.376,92	5,51%	172.796,33	-1.207.321,31	-3.076.617,69	172.796,33
IDIF24P381300	411.260,25	316.837,59	-288.393,35	-9,79%	-411.260,25	1.991.601,12	5.061.077,62	-411.260,25
IDIF24P381600	2.316.802,72	998.642,99	-814.432,11	-30,85%	-2.312.004,34	5.748.315,11	14.550.798,54	-2.316.802,72
IDIF24P381700	-2.700.028,34	1.015.053,50	827.815,51	31,36%	2.683.111,04	-5.758.334,79	-14.563.124,81	2.700.028,34
IDIF24P381800	-2.445.456,51	814.051,04	663.690,21	25,15%	2.410.351,27	-4.570.103,89	-11.550.415,01	2.445.456,51
IDIF24P381900	2.752.195,01	821.252,07	-669.762,93	-25,37%	-2.677.519,78	4.575.073,44	11.557.212,33	-2.752.195,01
IDIF24P382400	-1.200.475,29	236.946,46	193.239,04	7,32%	1.040.184,89	-1.287.508,84	-3.245.066,78	1.200.475,29
IDIF24P382500	1.886.802,09	237.756,61	-193.899,74	-7,35%	-1.081.705,77	1.288.451,75	3.246.521,59	-1.886.802,09
IDU24P390700	-362.023,02	161.748,35	59.098,72	2,24%	361.996,40	-2.819.909,36	-6.236.136,42	362.023,02
IDU24P390800	410.486,46	175.729,27	-64.206,99	-2,43%	-410.446,96	2.877.874,86	6.295.171,16	-410.486,46
IDV23P370500	2.177,64	15.224,88	-13.260,27	-0,50%	-2.177,64	959.505,87	5.411.443,65	-2.177,64
IDV23P370600	-236.455,41	493.092,99	429.464,80	16,27%	236.455,41	-1.324.366,54	-5.777.505,93	236.455,41
IDV23P370700	-831.918,97	521.371,78	454.094,52	17,20%	830.461,84	-1.328.041,43	-5.782.382,42	831.918,97
IDV23P370800	1.430.709,48	521.485,84	-454.193,86	-17,21%	-1.202.787,07	1.328.389,36	5.783.931,96	-1.430.709,48
IWA35	1.333.434,90	12,29	4,94	0,00%	-158,00	130,95	241,31	-361,64
LCAM03	3.118.138,37	946,17	943,08	0,04%	-5.073,31	4.147,90	6.107,90	-8.858,95
LF002100ES0	1.250.384,66	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002100HDP	1.489.129,67	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002100HDQ	2.712.806,09	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002100ISJ	2.781.173,84	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF00220018H	1.256.898,23	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFSC1900089	3.551.675,23	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20230901 - 210100	43.951.458,74	20,99	-9,37	0,00%	-374,06	393,04	20,17	-30,71
LFT20260301 - 210100	22.035.052,38	8.830,58	4.147,69	0,16%	-140.925,66	244.551,98	5.915,51	-9.003,13
LFT20290301 - 210100	3.921.975,94	3.848,85	2.402,98	0,09%	-52.035,80	121.379,02	8.586,83	-13.037,15
LTM20260701 - 100000	23.255.089,71	363.600,09	362.706,83	13,74%	-1.420.593,01	1.293.341,20	1.712.904,60	-2.384.615,74
NTNB20260815 - 760199_NEGOCIACAO	5.793.877,90	50.379,72	-25.161,06	-0,95%	-170.527,77	184.683,41	122.973,81	-162.660,90
NTNB20260815 - 760199_NEGOCIACAO	6.513.447,21	231.430,38	179.307,78	6,79%	-648.896,35	1.192.801,37	810.444,22	-902.117,50
OMGE13	1.018.119,40	556,17	554,55	0,02%	-2.483,96	2.073,61	3.002,49	-4.155,93
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PALFA1	2.487.212,87	1.299,93	1.296,06	0,05%	-5.757,34	4.805,68	6.940,53	-9.619,02
PRLG14	1.143.022,82	2,44	-2,10	0,00%	-11,40	11,19	29,45	-44,34
SBSPC7	2.431.283,28	1.043,30	1.043,92	0,04%	-5.360,71	4.410,77	6.467,97	-9.146,86
SMFT16	3.359.726,28	2.174,17	2.169,31	0,08%	-10.090,37	8.386,20	12.184,48	-16.991,29
VAMO22	1.061.121,57	83,91	79,34	0,00%	-639,81	519,75	819,34	-1.189,17
WDOU23	-13.803,75	0,00	0,00	0,00%	-147.305,03	147.403,89	-178.805,89	180.365,75
WDOU23	-14.980,60	45.462,18	37.538,33	1,42%	-99.322,91	100.963,91	-127.466,78	128.253,26
Total Var:	418.542.568,13	9.985.808,88	2.639.724,98	99,99%	-10.929.043,26	9.170.430,08	10.865.464,66	-16.700.577,68

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2023



## Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/08/2023

FUNDO: FIM EMB II A  
CNPJ: 20725957000102

Dados Gerais							
PL:	193.156.671,24	VAR / PL:	0,2017%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	484,37
VAR:	389.525,86	ETL / PL:	0,2529%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	332,62
ETL:	488.481,15	VAR / CDI:	0,0023%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	4.076.088,04	Cenário Baixa - 10000 (+):	4.940.987,41	CENARIO BRADESCO 1 (+):	6.152.178,25	CENARIO BRADESCO 2 (+):	6.681.870,39
Cenário Alta - 09999 (-):	(4.718.194,52)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(3.801.239,10)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(6.076.244,73)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(6.670.111,22)
Cenário Alta - 09999:	(642.106,48)	Cenário Baixa - 10000:	1.139.748,31	CENARIO BRADESCO 1:	75.933,52	CENARIO BRADESCO 2:	11.759,18

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
CAXA	9.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CD3323RSITI	6.117.310,39	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	7.474.544,50	136,76	96,16	0,03%	-208,97	213,10	937,62	-1.427,04
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-43.451.715,07	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPGT16	-145.711,10	17,35	-3,04	0,00%	205,97	-164,76	-289,55	435,09
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DHF24	-34,02	349,29	310,59	0,08%	-1.947,45	1.869,60	4.704,12	-7.073,55
DHF25	-9.531,47	29.629,49	-12.762,73	-3,28%	-232.344,33	185.052,15	285.765,04	-416.701,27
DHF26	-33.724,56	102.541,12	-68.258,90	-17,53%	-485.646,07	394.513,89	550.769,36	-779.613,99
DHF27	-932,26	2.860,11	-2.055,22	-0,53%	-10.832,55	9.089,63	12.609,25	-17.274,45
DHF29	-1.758,77	6.570,96	-5.092,34	-1,31%	-20.601,74	18.177,11	26.058,98	-33.294,66
DHF33	-1.211,19	5.816,65	-4.639,65	-1,19%	-14.945,58	14.104,21	21.423,17	-23.777,04
DHJ24	-34,56	167,23	128,58	0,03%	-1.784,74	1.522,51	3.074,53	-4.585,35
DHJ25	38.735,28	119.991,21	62.733,29	16,11%	802.976,12	-639.022,19	-955.957,81	1.384.106,83
DHN24	-75,71	237,08	64,10	0,02%	-2.841,90	2.309,76	4.143,61	-6.132,46
DHN25	133.939,86	403.890,49	239.696,37	61,54%	2.396.897,01	-1.924.550,22	-2.782.617,93	4.000.496,36
DHN26	58.117,61	178.064,20	123.582,59	31,73%	730.628,87	-604.281,28	-836.114,23	1.165.034,94
DHN27	-514,19	1.628,99	-1.200,32	-0,31%	-5.870,84	5.000,93	7.000,16	-9.427,14
DHV23	-0,44	23,25	20,64	0,01%	-58,33	59,23	257,87	-391,25
DHV24	-66,94	203,37	-43,85	-0,01%	-2.006,15	1.585,33	2.575,42	-3.782,87
DHV25	-242,35	715,84	-455,13	-0,12%	-3.797,43	3.072,68	4.333,14	-6.181,03
ERDV18	1.400.814,86	2,61	2,31	0,00%	-7,99	8,10	30,39	-46,05
IDIF24P381200	-81.503,93	84.080,42	-74.765,10	-19,19%	81.503,93	-569.464,85	-1.451.167,65	81.503,93
IDIF24P381300	118.164,92	91.035,03	80.949,19	20,78%	-118.164,85	572.234,69	1.454.168,78	-118.164,92
INDV23	-5.556,00	30.216,14	-20.538,88	-5,27%	63.886,14	-63.755,81	50.087,55	-50.293,25
LF002306J15	10.160.218,84	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20230901 - 210100	43.498.209,33	20,77	6,12	0,00%	-370,20	388,89	19,86	-30,39
LFT20240301 - 210100	1.620.712,95	92,02	48,11	0,01%	-1.737,49	1.981,34	0,00	0,00
LFT20250901 - 210100	109.864,40	43,35	-34,59	-0,01%	-639,28	895,26	3,70	-5,63
LFT20260301 - 210100	13.720.456,03	5.498,49	-4.421,98	-1,14%	-87.749,47	152.273,96	3.683,38	-5.605,94
LFT20260901 - 210100	1.822.948,27	969,94	-597,78	-0,15%	-12.533,43	25.855,48	968,48	-1.473,49
LTN20250401 - 100000	23.784.454,83	123.906,28	-68.249,32	-17,52%	-802.094,46	655.634,74	968.571,27	-1.402.171,70
LTN20250701 - 100000	16.565.709,26	112.950,34	-68.770,71	-17,65%	-650.753,75	545.951,94	773.446,09	-1.111.682,18
LTN20260701 - 100000	11.740.541,73	183.582,57	-127.896,40	-32,83%	-717.260,88	653.011,13	864.849,71	-1.203.998,31
NTNB20240815 - 760199_NEGOCIACAO	12.673.214,03	68.378,51	56.359,87	14,47%	-173.605,75	173.283,58	116.937,85	-156.966,73
NTNB20250515 - 760199_NEGOCIACAO	11.532.320,98	78.037,89	73.406,14	18,84%	-233.494,93	230.033,51	155.038,06	-207.011,75
NTNB20260815 - 760199_NEGOCIACAO	13.834.574,91	120.300,44	115.111,50	29,55%	-407.198,90	441.000,77	293.646,02	-388.413,80
NTNB20270515 - 760199_NEGOCIACAO	5.313.453,03	43.650,68	36.730,39	9,43%	-176.945,42	205.511,14	137.607,23	-180.851,93
NTNB20280815 - 760199_NEGOCIACAO	11.798.928,88	104.362,19	38.951,30	10,01%	-487.650,94	581.355,29	404.017,98	-525.435,92
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
TERMO_RF_PRE	43.443.037,17	789,06	570,64	0,15%	-1.214,56	1.238,56	5.449,55	-8.294,14
WINV23	5.556,00	30.216,14	20.538,88	5,27%	-63.886,14	63.755,81	-50.087,55	50.293,25
Total Var:	193.533.637,68	1.929.973,27	389.525,86	100,02%	-642.106,48	1.139.748,31	75.933,52	11.759,17



# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2023



## Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/08/2023

FUNDO: FIM EMB III A IMOBILIÁRIO  
CNPJ: 32711990000162

Dados Gerais								
PL:	67.584.285,95	VAR / PL:	4,0345%	Limite Fundo:		0,00%	Dutacion DC:	1,00
VAR:	2.726.712,86	ETL / PL:	5,0695%	Status:	ENQUADRADO		Dutacion DU:	1,00
ETL:	3.419.407,93	VAR / CDI:	0,0452%	Benchmark:				

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	34.870.765,16	Cenário Baixa - 10000 (-):	4,95	CENARIO BRADESCO 1 (+):	8.386.734,30	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
Cenário Alta - 09999 (-):	(4,85)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(34.870.765,16)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(8.455.395,43)
Cenário Alta - 09999:	34.870.760,31	Cenário Baixa - 10000:	(34.870.760,21)	CENARIO BRADESCO 1:	8.386.734,30	CENARIO BRADESCO 2:	(8.455.395,43)

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	2.470.139,95	214.325,59	194.508,40	7,13%	1.235.069,98	-1.235.069,98	362.122,52	-365.086,69
BMLC11	3.327.866,34	167.144,09	-106.829,04	-3,92%	3.327.866,34	-3.327.866,34	487.865,21	-491.856,65
EPML11	1.449.692,00	79.434,90	30.789,12	1,13%	1.449.692,00	-1.449.692,00	212.524,95	-214.264,48
BTLG11	3.042.640,07	5.168,09	1.142,19	0,04%	0,00	0,00	0,00	0,00
BTLG13	10.377,00	617,76	524,20	0,02%	0,00	0,00	0,00	0,00
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CEOC11	734.762,30	200.732,88	162.900,08	5,97%	367.381,15	-367.381,15	107.716,15	-108.597,87
CNES11	426.739,50	22.797,37	3.420,39	0,13%	213.369,75	-213.369,75	62.560,01	-63.072,10
COMPROMISSADA_PRE	173.576,87	3,15	-2,92	0,00%	-4,85	4,95	21,77	-33,14
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	548.995,71	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
FVPQ11	1.337.523,60	69.812,12	23.318,10	0,86%	668.761,80	-668.761,80	196.090,96	-197.685,99
GALG11	1.890.037,92	82.701,98	76.703,05	2,81%	945.018,96	-945.018,96	277.079,56	-279.347,61
HBRH11	3.609.743,46	119.817,91	76.495,63	2,81%	3.609.743,46	-3.609.743,46	529.188,39	-533.520,08
HSLG11	931.443,87	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
MALL11	4.485.934,40	242.306,72	210.178,55	7,71%	2.242.967,20	-2.242.967,20	657.637,98	-663.021,10
MAXR11	1.392.458,00	67.422,02	45.357,25	1,66%	696.229,00	-696.229,00	204.134,34	-205.805,29
NEWL11	1.463.817,60	80.478,01	39.335,96	1,44%	731.908,80	-731.908,80	214.595,66	-216.352,24
NEWU11	891.768,00	26.709,64	15.545,95	0,57%	891.768,00	-891.768,00	130.733,19	-131.803,31
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PATC11	6.175.405,50	514.625,04	346.238,71	12,70%	3.087.702,75	-3.087.702,75	905.314,45	-912.724,93
QAGR11	5.640.949,92	158.087,69	110.602,69	4,06%	2.820.474,96	-2.820.474,96	826.963,26	-833.732,40
RBRL11	3.254.325,97	415.723,24	387.354,69	14,21%	3.254.325,97	-3.254.325,97	477.084,19	-480.989,38
RCRB11	5.826.367,74	538.302,83	490.764,39	18,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
RNGO11	37.956,84	1.756,07	1.756,91	0,06%	18.978,42	-18.978,42	5.564,47	-5.810,02
TEPP11	5.383.243,90	323.073,08	293.727,97	10,96%	2.691.621,90	-2.691.621,90	789.183,54	-795.643,43
TRXF11	7.662.609,20	300.393,67	170.649,10	6,26%	3.831.304,60	-3.831.304,60	1.123.338,51	-1.132.533,64
XPN11	3.557.144,85	155.733,31	139.970,49	5,13%	1.778.572,43	-1.778.572,43	521.477,44	-525.746,01
XPGL11	906,64	62,07	57,94	0,00%	453,32	-453,32	132,91	-134,00
XPPR11	2.015.108,76	60.494,46	7.201,72	0,26%	1.007.554,38	-1.007.554,38	295.414,94	-297.833,08
<b>Total Var:</b>	<b>67.742.535,81</b>	<b>3.847.917,62</b>	<b>2.726.712,86</b>	<b>100,00%</b>	<b>34.870.760,31</b>	<b>-34.870.760,21</b>	<b>8.386.734,30</b>	<b>-8.455.395,43</b>

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2023



## Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/08/2023

<b>FUNDO:</b>	<b>FIA RVA EMB II</b>
<b>CNPJ:</b>	<b>13294268000125</b>

Dados Gerais					
PL:	219.430.923,09	VAR / PL:	8,4350%	Limite Fundo:	0,00%
VAR:	18.508.952,43	ETL / PL:	10,5778%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	23.210.973,06	VAR / CDI:	0,0945%	Benchmark:	Dutacion DU:

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	55.805.468,78	Cenário Baixa - 10000 (+):	75,09	CENARIO BRADESCO 1 (+):	31.166.685,26
Cenário Alta - 09999 (-):	(73,64)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(56.342.620,14)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-
Cenário Alta - 09999:	55.805.395,14	Cenário Baixa - 10000:	(56.342.545,05)	CENARIO BRADESCO 1:	31.166.685,26

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
ABEV3	5.351.397,20	370.753,74	348.843,37	1,89%	749.279,51	-1.605.837,93	784.602,79	-791.025,19
ARZZ	1.074.184,00	172.999,16	153.707,15	0,83%	322.255,20	-322.255,20	157.475,37	-158.764,40
B3SA3	8.956.985,97	1.518.860,58	1.464.884,60	7,91%	2.239.246,49	-2.239.246,49	1.313.094,14	-1.323.842,53
BBAS3	6.523.350,00	625.922,26	353.549,32	1,91%	1.630.837,50	-1.630.837,50	956.323,11	-964.151,13
BBDC4	7.812.571,00	1.175.886,62	1.146.481,08	6,19%	1.953.142,75	-1.953.142,75	1.145.322,91	-1.154.697,99
BBS3	1.522.038,00	118.918,80	-95.092,65	-0,51%	304.402,59	-304.402,60	223.130,77	-224.957,22
BPAC11	7.205.093,00	1.170.087,37	1.107.449,44	5,98%	2.161.527,90	-2.521.782,55	1.056.266,63	-1.064.912,75
BRFS3	4.276.869,20	719.298,61	337.576,43	1,82%	1.069.217,30	-1.069.217,30	626.989,03	-632.121,27
BRKM5	616.048,00	135.414,52	116.475,42	0,63%	338.826,40	-184.814,40	90.312,64	-91.051,89
CAIXA	10.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	2.633.941,52	47,84	-42,11	0,00%	-73,64	75,09	330,41	-502,87
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	19.331.798,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPFE3	2.687.605,00	214.472,45	177.857,18	0,64%	537.513,13	-537.521,00	394.002,89	-397.228,02
CPL3	1.628.080,00	99.838,99	-56.237,87	-0,30%	358.177,60	-358.177,60	238.676,53	-240.630,22
CSMG3	863.744,00	140.886,99	106.714,14	0,58%	190.023,68	-233.210,88	126.624,87	-127.661,36
CXSE3	2.203.200,00	102.899,36	37.912,59	0,20%	440.640,00	-440.640,00	322.989,12	-325.632,96
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ECOR3	1.664.775,00	342.369,27	111.332,95	0,60%	416.193,75	-416.193,75	244.056,02	-246.053,75
EGIE3	1.752.192,00	155.155,12	136.936,00	0,74%	315.390,40	-315.394,56	256.871,35	-258.973,98
ELET3	4.538.737,72	608.626,22	568.774,03	3,07%	1.361.621,32	-1.361.621,32	665.378,95	-670.825,44
ELET6	3.192.176,00	509.401,70	496.524,86	2,68%	957.652,80	-957.652,80	467.973,00	-471.803,61
ENEV3	1.566.288,00	174.669,03	119.899,76	0,65%	579.526,56	-798.806,88	229.617,62	-231.497,37
EQTLL3	6.411.150,00	844.980,24	786.560,61	4,10%	1.282.230,00	-1.282.230,00	938.874,59	-947.567,97
GMAT3	2.049.958,00	483.753,45	469.860,89	2,54%	368.992,44	-327.993,28	300.523,84	-302.983,79
GOAU4	2.845.074,00	515.567,63	434.029,85	2,34%	853.522,20	-711.268,50	417.087,85	-420.501,94
HAPV3	1.483.706,88	315.627,79	243.125,58	1,31%	504.460,34	-504.495,17	217.511,43	-219.291,88
INDV23	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ITSA4	4.044.736,08	359.689,03	347.657,32	1,88%	768.499,86	-768.499,86	592.958,31	-597.811,99
ITUB4	17.874.402,91	1.599.062,39	1.499.781,84	8,10%	3.574.815,42	-3.396.136,55	2.620.387,47	-2.641.836,75
IREN3	3.533.813,50	727.525,16	621.215,37	3,36%	706.762,70	-706.762,70	518.057,06	-522.297,64
MRVE3	2.134.475,84	740.955,00	687.116,68	3,71%	640.342,75	-640.361,54	312.914,16	-315.475,53
MULT3	1.284.006,00	77.425,93	47.702,38	0,26%	385.201,80	-321.001,50	188.235,28	-189.776,09
ONCO3	719.950,00	90.541,84	5.597,77	0,03%	251.982,50	-251.982,50	105.544,67	-106.408,61
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PETR3	8.413.344,00	918.958,75	513.039,63	2,77%	2.103.496,00	-2.524.207,56	1.233.484,19	-1.243.580,92
PETRA	19.874.952,46	2.033.205,13	851.535,48	4,60%	4.968.738,12	-5.962.485,74	2.913.668,03	-2.937.517,97
PRIO3	5.872.130,00	786.598,06	280.223,40	1,51%	3.523.278,00	-3.523.278,00	860.854,26	-867.900,81
RADL3	4.047.694,08	386.347,94	365.672,71	1,98%	809.538,82	-809.538,82	593.391,95	-598.249,19
RAIL3	3.598.350,00	314.247,02	278.313,91	1,50%	1.619.257,50	-1.187.455,50	527.518,11	-531.836,13
RDOR3	2.739.896,00	883.413,21	831.173,76	4,49%	821.968,80	-821.978,36	401.668,75	-404.956,63
RENT3	8.968.850,00	1.244.197,57	1.142.636,13	6,17%	2.959.720,50	-2.331.901,00	1.314.833,41	-1.325.596,03
SBS3	3.110.304,00	214.989,99	46.811,31	0,25%	777.576,00	-777.576,00	455.970,57	-459.702,93
STBP3	1.446.388,00	201.058,94	183.975,07	0,99%	506.235,80	-506.235,80	212.040,48	-213.776,15
SUZB3	4.613.800,00	454.824,71	-146.971,14	-0,79%	1.153.450,00	-922.760,00	676.383,08	-681.919,64
TMS3	1.175.856,00	64.466,68	-7.837,49	-0,04%	376.273,92	-270.446,88	172.380,49	-173.791,52
TOTS3	2.188.214,42	201.844,20	186.083,76	1,01%	437.642,88	-437.642,88	320.732,23	-323.416,09
UGPA3	1.518.176,00	164.888,39	141.557,52	0,76%	379.544,00	-303.635,20	222.564,60	-224.385,41
VALE3	30.834.578,60	2.613.647,48	1.201.540,33	6,49%	7.708.644,65	-7.708.644,65	4.520.349,22	-4.557.350,72
VBBR3	2.314.884,00	299.766,77	98.114,51	0,53%	578.721,00	-578.721,00	339.361,99	-342.139,86
WEGE3	3.885.804,00	578.364,76	199.289,97	1,08%	971.451,00	-971.451,00	569.658,87	-574.321,83
YDUQ3	2.173.479,00	705.717,02	655.599,59	3,54%	847.656,81	-543.369,75	318.632,02	-321.240,20
<b>Total Var:</b>	<b>234.570.247,18</b>	<b>26.178.176,71</b>	<b>18.508.952,43</b>	<b>99,97%</b>	<b>55.805.395,14</b>	<b>-56.342.545,05</b>	<b>31.166.685,26</b>	<b>-31.421.971,13</b>

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2023



## Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/08/2023

<b>FUNDO:</b>	<b>FIA RVA EMB III</b>
<b>CNPJ:</b>	<b>38452593000108</b>

Dados Gerais					
PL:	102.716.517,79	VAR / PL:	8,8851%	Limite Fundo:	0,00%
VAR:	9.126.493,69	ETL / PL:	11,1423%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	11.444.991,29	VAR / CDI:	0,0995%	Benchmark:	Dutacion DU:
					1,00

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	28.634.054,47	Cenário Baixa - 10000 (+):	830.266,85	CENARIO BRADESCO 1 (+):	14.546.172,94
Cenário Alta - 09999 (-):	(816.771,82)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(28.146.355,72)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(1.048.060,15)
Cenário Alta - 09999:	27.817.282,65	Cenário Baixa - 10000:	(27.316.088,87)	CENARIO BRADESCO 1:	13.498.112,79
				CENARIO BRADESCO 2 (+):	1.054.526,82
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	(14.665.510,48)
				CENARIO BRADESCO 2:	(13.610.983,66)

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
ALSO3	2.460.399,58	399.879,20	376.047,15	4,12%	961.136,35	-615.097,40	360.693,11	-363.645,59
ASAJ3	2.503.116,00	393.860,23	256.963,81	2,82%	700.872,48	-650.810,16	366.956,81	-369.960,55
AURE3	3.746.737,73	174.603,44	124.460,25	1,36%	936.684,43	-1.161.516,23	549.271,75	-553.767,84
BBAS3	3.708.936,60	355.876,35	189.485,20	2,08%	927.234,15	-927.234,15	543.730,11	-548.180,83
BBSE3	2.870.910,00	224.307,92	-174.777,72	-1,92%	574.172,55	-574.182,00	420.875,41	-424.320,50
BPAC11	3.450.132,32	560.292,04	528.458,02	5,79%	1.035.039,70	-1.207.546,31	505.789,40	-509.929,56
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CIEL3	2.821.248,00	467.923,26	331.114,27	3,63%	846.374,40	-705.312,00	413.594,96	-416.980,45
COMPROMISSADA_PRE	4.177.963,33	75,89	-66,93	0,00%	-116,81	119,11	524,09	-797,66
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-558.336,13	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
DOLV23	-120.677,06	366.223,06	316.748,46	3,47%	-800.101,19	813.320,42	-1.026.815,69	1.033.151,28
ELET3	7.956.895,30	1.066.946,98	967.279,02	10,82%	2.386.978,69	-2.386.978,69	1.166.436,87	-1.175.984,79
ENAT3	374.991,00	37.092,85	-7.462,84	-0,08%	131.246,85	-131.249,24	54.973,68	-55.423,67
ENEV3	4.979.723,04	555.327,87	415.958,73	4,56%	1.842.497,53	-2.539.658,75	730.027,40	-736.003,07
ENJ3	178.178,00	49.216,37	39.101,49	0,43%	80.180,10	-48.108,06	26.120,90	-26.334,71
EQLT3	10.100.964,70	1.331.292,45	1.202.166,55	13,17%	2.020.192,94	-2.020.192,94	1.480.801,43	-1.492.922,58
FLRY3	1.775.628,00	154.719,53	135.342,27	1,48%	355.125,60	-355.125,60	260.307,07	-262.437,82
HAPV3	701.754,06	149.283,58	120.864,31	1,32%	238.596,38	-238.612,85	102.877,15	-103.719,25
IGTI11	6.406.744,20	508.440,21	466.010,91	5,11%	1.281.348,84	-1.281.348,84	939.228,70	-946.916,79
ITUB4	10.025.747,29	896.913,62	831.449,49	9,11%	2.005.112,91	-1.904.891,99	1.469.774,55	-1.481.805,45
IRENS3	3.755.460,31	773.156,77	662.803,07	7,26%	751.092,06	-751.092,06	550.550,48	-555.057,03
LWSA3	126.626,73	34.413,41	21.419,81	0,23%	50.731,49	-50.731,49	18.999,09	-18.745,29
NINJ3	371.000,00	52.626,78	9.482,03	0,10%	222.600,00	-222.600,00	54.388,60	-54.833,80
NTCO3	2.356.178,88	665.293,49	623.646,02	6,83%	589.044,72	-589.044,72	345.415,82	-348.243,24
ONCO3	792.550,00	99.672,11	9.449,93	0,10%	277.392,50	-277.392,50	116.187,83	-117.138,89
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PETRA	779.336,00	79.725,97	28.539,64	0,31%	194.834,00	-233.800,80	114.250,66	-115.185,86
PRIQ3	3.026.584,00	405.424,45	159.907,85	1,75%	1.815.950,40	-1.815.950,40	443.697,21	-447.329,12
RAIL3	2.333.340,00	203.772,60	179.461,87	1,97%	1.050.003,00	-770.002,20	342.067,64	-344.867,65
RECV3	3.002.902,44	340.382,25	59.967,42	0,66%	1.801.741,46	-1.801.741,46	440.225,50	-443.828,98
RENT3	6.031.077,25	836.657,06	766.106,40	8,39%	1.990.255,49	-1.568.080,09	884.155,93	-891.393,22
SCAR3	142.884,00	25.036,91	17.551,88	0,19%	85.730,40	-85.730,40	20.946,79	-21.118,26
SMFT3	3.065.860,00	553.869,90	511.629,55	5,61%	1.234.352,00	-1.234.352,00	452.390,01	-456.093,06
SOIM3	179.857,37	72.248,96	70.521,75	0,77%	53.957,21	-53.959,61	26.367,09	-26.582,92
SUZB3	6.991.261,05	689.192,92	-215.382,02	-2,36%	1.747.815,26	-1.398.252,21	1.024.918,87	-1.033.308,38
YBBR3	2.183.042,68	282.693,93	75.492,65	0,83%	545.760,67	-545.760,67	320.034,06	-322.653,71
WDOV23	-2.496,77	7.577,03	6.553,42	0,07%	-16.553,82	16.827,32	-21.244,46	21.375,54
<b>Total Var:</b>	<b>102.717.431,90</b>	<b>12.813.821,34</b>	<b>9.126.493,69</b>	<b>99,98%</b>	<b>27.817.282,65</b>	<b>-27.316.088,87</b>	<b>13.498.112,79</b>	<b>-13.610.983,66</b>

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2023



## Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/08/2023

<b>FUNDO:</b>	<b>FIA RVA EMB IV</b>
<b>CNPJ:</b>	<b>38452613000132</b>

Dados Gerais								
PL:	97.963.603,32	VAR / PL:	9,3190%	Limite Fundo:		0,00%	Dutation DC:	1,00
VAR:	9.129.272,70	ETL / PL:	11,6865%	Status:	ENQUADRADO		Dutation DU:	
ETL:	11.448.476,28	VAR / CDI:	0,1044%	Benchmark:				

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	28.715.305,91	Cenário Baixa - 10000 (-):	174,69	CENARIO BRADESCO 1 (+):	13.454.484,21	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
Cenário Alta - 09999 (-):	(171,30)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(26.261.345,72)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(13.565.011,33)
Cenário Alta - 09999:	28.715.134,61	Cenário Baixa - 10000:	(26.261.171,03)	CENARIO BRADESCO 1:	13.454.484,21	CENARIO BRADESCO 2:	(13.565.011,33)

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

Produto	MiM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
ALSO3	2.879.835,75	467.816,34	447.897,86	4,91%	1.007.942,51	-719.958,94	422.183,92	-425.639,72
AURES	3.959.271,49	184.507,82	140.204,82	1,54%	909.817,67	-1.227.403,25	580.429,20	-585.180,33
CAKA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	6.127.224,72	111,29	-102,58	0,00%	-171,30	174,69	768,61	-1.169,81
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	63.782,97	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPL3	2.130.186,60	179.567,73	57.846,28	0,63%	468.641,05	-468.667,35	312.285,36	-314.841,58
CPL6	749.029,38	45.932,84	-28.342,75	-0,31%	164.786,46	-164.786,46	109.807,71	-110.706,54
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ELET3	2.216.055,74	297.164,04	280.433,07	3,07%	664.816,72	-664.816,72	324.873,77	-327.533,04
ELET6	388.562,20	62.006,06	60.100,77	0,66%	116.568,66	-116.568,66	56.963,22	-57.429,49
ENGH1	3.177.350,30	372.185,78	339.191,10	3,72%	540.149,55	-699.017,07	465.799,55	-469.612,37
EQTL3	10.189.802,66	1.343.001,17	1.260.764,44	13,81%	2.037.960,53	-2.037.960,53	1.493.825,07	-1.506.052,83
GGPS3	7.895.149,26	667.224,86	604.396,20	6,62%	3.652.817,17	-3.652.817,17	1.157.428,88	-1.166.903,06
GMAT3	6.355.778,35	1.499.850,11	1.446.212,40	15,84%	1.144.040,10	-1.016.924,54	931.757,11	-939.384,04
MAPV3	2.095.911,48	445.661,59	322.212,72	3,53%	712.609,90	-712.609,90	307.260,62	-309.775,72
IGTI1	1.039.496,60	82.494,61	70.998,28	0,78%	207.899,32	-207.899,32	152.390,20	-153.637,60
ITUB4	6.372.565,03	570.096,19	543.079,86	5,95%	1.274.489,77	-1.210.787,36	934.218,03	-941.865,11
MATD3	1.476.922,85	253.530,62	240.377,45	2,63%	443.076,86	-443.076,86	216.516,89	-218.289,20
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PRIO3	6.399.832,56	857.286,18	306.299,26	3,36%	3.839.899,54	-3.839.899,54	938.215,45	-945.895,25
RAIL3	12.026.088,00	1.050.248,69	921.091,83	10,09%	5.411.739,60	-3.968.609,04	1.763.024,50	-1.777.455,81
RENT3	6.663.893,50	924.444,06	890.987,55	9,76%	2.199.084,86	-1.732.612,31	976.926,79	-984.923,46
UGPA3	9.241.678,48	1.003.734,39	926.117,09	10,14%	2.310.419,62	-1.848.335,70	1.354.830,07	-1.365.920,08
VBR3	6.514.183,26	843.556,60	299.507,06	3,28%	1.628.545,82	-1.628.545,82	954.979,27	-962.796,29
<b>Total Var:</b>	<b>97.963.601,18</b>	<b>11.150.620,96</b>	<b>9.129.272,70</b>	<b>100,01%</b>	<b>28.715.134,61</b>	<b>-26.261.171,03</b>	<b>13.454.484,21</b>	<b>-13.565.011,32</b>

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO - AGOSTO 2023



## Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/08/2023

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

Dados Gerais		Limite Fundo:		0,00% Dutation DC:		2,18	
PL:	105.929.378,23	VAR / PL:	8,5632%	Status:	ENQUADRADO	Dutation DU:	1,79
VAR:	9.070.943,86	ETL / PL:	10,7386%	Benchmark:			
ETL:	11.375.329,55	VAR / CDI:	0,0959%				

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	27.563.507,82	Cenário Baixa - 10000 (-):	872,11	CENARIO BRADESCO 1 (+):	15.404.508,45	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
Cenário Alta - 09999 (-):	(767,89)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(27.914.489,43)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(15.528.681,05)
Cenário Alta - 09999:	27.562.739,92	Cenário Baixa - 10000:	(27.913.617,32)	CENARIO BRADESCO 1:	15.404.508,45	CENARIO BRADESCO 2:	(15.528.681,05)

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
ABEV3	3.096.893,76	214.533,92	202.981,19	2,24%	433.555,13	-929.090,50	454.004,83	-457.720,90
ALPA4	86.639,82	15.929,47	5.929,38	0,07%	21.659,96	-21.659,96	12.701,40	-12.805,37
ALSO3	618.342,12	100.446,89	93.347,17	1,03%	216.419,74	-154.585,53	90.649,96	-91.390,97
ARZ2	219.006,33	35.271,34	31.284,15	0,34%	65.701,90	-65.701,90	32.106,33	-32.369,14
ASA3	705.237,84	110.967,75	67.894,84	0,75%	197.466,60	-183.361,84	103.387,87	-104.234,15
AZUL4	242.171,37	95.042,68	85.979,59	0,95%	145.302,82	-84.759,98	35.502,32	-35.792,93
B3SA3	3.781.520,73	641.242,80	617.612,19	6,81%	945.380,18	-945.380,18	554.370,94	-558.906,76
BBAS3	3.413.431,20	327.522,29	183.666,39	2,02%	853.357,80	-853.357,80	500.409,01	-504.505,13
BBDC4	1.013.482,28	159.773,35	155.944,75	1,72%	253.370,57	-253.370,57	148.576,50	-149.792,68
BBDC4	3.924.808,55	590.731,26	573.264,14	6,32%	981.202,14	-981.202,14	575.376,93	-580.086,70
BBSB3	1.040.909,94	81.327,64	-64.357,18	-0,71%	208.178,56	-208.181,99	152.597,40	-153.846,49
BEEF3	111.552,00	21.047,38	3.356,29	0,04%	27.888,00	-27.888,00	16.353,52	-16.487,39
BPA11	2.029.732,17	329.622,95	309.327,20	3,41%	605.919,65	-710.406,26	297.558,74	-299.994,42
BRAP4	288.090,00	25.523,49	17.377,39	0,19%	72.022,50	-72.022,50	42.233,99	-42.579,70
BRFS3	773.091,76	130.021,24	61.575,10	0,68%	193.272,94	-193.272,94	113.335,25	-114.262,96
BRKM5	300.884,96	66.138,02	56.877,52	0,63%	165.486,73	-90.265,49	44.109,74	-44.470,80
CAIXA	30.042,49	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CASH3	23.708,16	7.597,37	4.000,80	0,04%	9.483,26	-9.483,26	3.475,62	-3.504,07
CCRO3	634.612,72	36.857,91	32.135,16	0,35%	158.653,18	-158.653,18	93.034,23	-93.795,76
CIEL3	207.862,44	34.475,41	24.131,06	0,27%	62.358,73	-51.965,61	30.472,63	-30.722,07
CMIG4	907.019,46	50.688,09	41.136,28	0,45%	226.754,87	-272.105,84	132.969,05	-134.057,48
CMIN3	242.457,72	16.124,70	7.127,09	0,08%	84.860,20	-84.860,20	35.544,30	-35.835,25
COGN3	270.421,20	77.869,08	75.581,83	0,83%	67.605,30	-84.647,42	39.543,75	-39.966,25
COMPROMISSADA_PRE	923.327,68	14,95	-13,05	0,00%	-23,02	23,47	103,28	-157,19
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	1.639.471,05	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPFE3	327.020,40	26.096,42	14.326,60	0,16%	65.403,12	-65.404,08	47.941,19	-48.333,62
CPLE6	690.609,02	42.350,32	-22.798,22	-0,25%	151.933,98	-151.933,98	101.243,28	-102.072,01
CRFB3	276.722,46	68.586,06	47.287,59	0,52%	69.180,62	-69.180,62	40.567,51	-40.899,58
CSAN3	1.046.574,72	212.528,77	198.309,81	2,19%	261.643,68	-261.643,68	153.427,85	-154.683,74
CSNA3	364.268,80	44.899,81	29.511,98	0,33%	145.704,51	-109.283,65	53.401,81	-53.838,93
CVCB3	55.995,92	16.780,19	14.756,51	0,16%	27.997,96	-27.997,96	8.209,00	-8.276,20
CYRE3	313.800,96	50.661,03	36.996,04	0,41%	100.416,31	-91.002,28	46.003,22	-46.379,78
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DXCO3	111.607,16	19.676,01	7.406,48	0,08%	27.901,79	-33.482,15	16.361,61	-16.495,54
EGE3	548.318,16	48.553,11	42.326,15	0,47%	96.995,97	-98.597,27	80.383,44	-81.041,42
ELT3	3.631.427,40	486.959,60	451.747,80	4,98%	1.089.428,22	-1.089.428,22	532.367,26	-536.724,97
ELTE6	544.490,70	86.888,85	84.312,09	0,93%	163.347,21	-163.347,21	79.822,34	-80.475,73
EMBR3	730.368,26	64.230,05	-25.015,26	-0,28%	182.592,07	-182.592,07	107.071,99	-107.948,43
ENEV3	959.416,96	106.992,09	74.795,87	0,82%	354.984,28	-489.302,65	140.650,53	-141.801,83
ENGH1	584.317,50	68.445,29	58.479,52	0,64%	99.333,98	-128.549,85	85.660,95	-86.362,13
EQT13	1.802.182,18	237.524,99	212.303,23	2,34%	360.436,44	-360.436,44	264.199,91	-266.362,53
EZTC3	106.034,44	10.995,90	1.421,20	0,02%	21.206,41	-31.810,33	15.544,65	-15.671,89
FLRY3	318.343,68	27.738,91	23.392,08	0,26%	63.668,74	-63.668,74	46.669,18	-47.051,20
GGBR4	1.441.396,00	239.735,81	195.492,09	2,16%	360.349,00	-360.349,00	211.308,65	-213.038,33
GOAU4	402.281,88	72.899,16	61.757,46	0,68%	120.684,56	-100.570,47	58.974,52	-59.457,26
GOL14	503,44	3.395,49	2.652,51	0,03%	0,00	0,00	0,00	0,00
GOLLA	78.257,96	38.429,02	35.228,47	0,38%	46.954,78	-27,00	11.472,62	-11.566,53
HAPV3	939.619,68	199.884,55	155.059,75	1,71%	319.470,69	-319.492,75	137.748,25	-138.875,79
HYPE3	797.228,53	130.927,73	126.681,14	1,40%	183.362,56	-167.417,99	116.873,70	-117.830,38
IGTI1	226.703,00	17.991,19	15.903,85	0,18%	45.340,60	-45.340,60	33.234,66	-33.506,70
INDV23	-53.708,00	292.089,39	291.986,89	3,22%	617.565,99	-616.306,12	484.179,68	-486.168,05
IRBR3	178.498,80	56.592,47	23.591,44	0,26%	116.024,22	-98.174,76	26.167,92	-26.382,12
ITSA2	9.847,35	3.192,77	2.580,91	0,03%	0,00	0,00	0,00	0,00
ITSA4	2.363.379,48	210.169,88	203.239,04	2,24%	449.042,10	-449.042,10	346.471,43	-349.307,49
ITUB4	6.718.484,76	601.042,53	560.159,65	6,18%	1.343.672,46	-1.276.512,10	984.929,87	-992.992,05
JBS3	1.065.286,40	80.364,59	37.015,96	0,41%	372.850,24	-372.850,24	156.170,99	-157.449,33
KLBN1	814.889,04	56.047,89	17.610,31	0,20%	203.724,76	-162.979,51	119.464,20	-120.442,06
LFT20230901 - 210100	1.016.377,48	0,49	-0,26	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,47
LFT20240301 - 210100	686.742,77	38,99	-30,46	0,00%	-736,23	839,55	0,00	0,00
LEN3	777.374,85	160.042,33	137.232,17	1,51%	155.474,97	-155.474,97	113.963,15	-114.896,00
LWSA3	155.349,11	42.152,07	27.098,00	0,30%	62.139,64	-62.139,64	22.774,18	-22.960,60
MGLU3	404.651,88	54.819,95	11.758,64	0,13%	210.418,98	-182.093,35	59.321,97	-59.807,55
MRFG1	843,12	2.219,32	-1.752,51	-0,02%	0,00	0,00	0,00	0,00
MRFG3	110.594,25	9.500,69	6.721,40	0,07%	44.236,21	-33.179,77	16.213,12	-16.345,83
MRVE3	222.235,68	77.146,17	71.336,89	0,79%	66.670,70	-66.672,66	32.579,75	-32.846,43
MULT3	336.859,84	20.312,75	12.675,60	0,14%	101.057,95	-84.214,96	49.383,65	-49.787,88
NTCO3	649.597,74	183.421,20	169.402,71	1,87%	162.399,44	-162.399,44	95.231,03	-96.010,55
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PCAR3	39.786,76	50.200,12	36.879,40	0,41%	9.946,69	-9.946,69	5.833,74	-5.880,48
PETR3	5.269.595,10	575.537,53	319.475,55	3,52%	1.317.398,78	-1.580.893,79	772.522,64	-778.846,16
PETRA	7.440.039,72	761.115,13	317.995,58	3,51%	1.860.009,93	-2.232.011,92	1.090.709,82	-1.099.637,87
PETZ3	93.888,84	22.602,83	19.258,92	0,21%	23.472,21	-23.472,21	13.764,10	-13.876,77
PRIO3	1.987.054,52	266.174,83	96.167,66	1,06%	1.192.232,71	-1.192.232,71	291.302,19	-293.686,66
RADL3	1.631.570,04	155.731,56	146.224,19	1,61%	326.314,01	-326.314,01	239.188,17	-241.146,05
RAIL3	1.385.923,50	121.033,90	107.099,40	1,18%	623.665,58	-457.354,76	203.176,39	-204.839,49
RAIZ4	222.290,31	55.471,80	51.716,66	0,57%	77.801,61	-77.801,61	32.587,76	-32.854,51
RDR3	1.601.090,90	516.233,04	487.659,48	5,38%	480.327,27	-480.332,86	234.719,93	-236.641,24
RENT3	2.713.614,75	376.444,35	340.713,58	3,76%	895.492,87	-705.539,84	397.815,92	-401.072,26
RRRP3	394.118,24	74.128,20	48.676,19	0,54%	236.470,94	-236.470,94	57.777,73	-58.250,68
SANB1	491.302,51	53.989,44	48.099,96	0,53%	98.356,69	-98.360,50	72.096,25	-72.895,41
SBSB3	1.004.564,48	68.437,36	14.639,63	0,15%	251.141,12	-251.141,12	147.259,15	-148.474,63
SLEC3	217.268,44	33.319,35	22.657,15	0,25%	65.180,53	-65.181,07	31.851,55	-32.112,28
SMT03	264.074,17	32.530,02	-8.238,32	-0,09%	79.222,25	-79.222,25	38.713,27	-39.030,16



## Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/08/2023

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

Dados Gerais					
PL:	105.929.378,23	VAR / PL:	8,5632%	Limite Fundo:	0,00% Dutation DC:
VAR:	9.070.943,86	ETL / PL:	10,7386%	Status:	ENQUADRADO Dutation DU:
ETL:	11.375.329,55	VAR / CD:	0,0959%	Benchmark:	

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	27.563.507,82	Cenário Baixa - 10000 (+):	872,11	CENARIO BRADESCO 1 (+):	15.404.508,45
Cenário Alta - 09999 (-):	(767,89)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(27.914.489,43)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-
Cenário Alta - 09999:	27.562.739,92	Cenário Baixa - 10000:	(27.913.617,32)	CENARIO BRADESCO 1:	15.404.508,45
				CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	(15.528.681,05)
				CENARIO BRADESCO 2:	(15.528.681,05)

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

Produto	MM	VAR Tct.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
SOMA3	187.489,68	75.314,77	72.433,22	0,80%	56.246,90	-56.249,41	27.485,99	-27.710,95
SUZB3	1.859.311,25	183.289,42	-55.802,67	-0,62%	464.827,81	-371.862,25	272.575,03	-274.806,20
TAEF11	381.295,80	14.906,55	11.236,45	0,12%	95.323,95	-95.323,95	55.897,96	-56.355,52
TIMS3	594.239,58	32.580,89	-3.289,41	-0,04%	190.156,67	-136.675,10	87.115,52	-87.828,61
TOTS3	727.148,62	67.073,28	61.397,80	0,68%	145.429,72	-145.429,72	106.599,99	-107.472,57
UGPA3	1.007.752,88	109.451,57	92.753,29	1,02%	251.938,22	-201.550,58	147.736,57	-148.945,88
USIM5	180.744,48	13.406,00	9.930,99	0,11%	70.490,35	-39.763,79	26.497,14	-26.714,03
VALE3	13.395.416,40	1.135.442,67	528.836,46	5,83%	3.348.854,10	-3.348.854,10	1.963.768,04	-1.979.842,54
VBBR3	1.049.414,08	135.894,27	42.263,98	0,47%	262.353,52	-262.353,52	153.844,10	-155.103,40
VIAA3	102.161,34	38.733,09	33.766,61	0,37%	45.972,60	-45.972,60	14.976,85	-15.099,45
VIVT3	892.415,70	48.407,12	12.669,60	0,14%	133.860,20	-133.862,36	130.828,14	-131.899,04
WESE3	2.307.335,16	343.424,77	123.735,59	1,36%	576.833,79	-576.833,79	338.255,33	-341.024,14
YDUQ3	307.597,00	99.871,86	92.544,55	1,02%	119.958,93	-76.896,75	45.092,25	-45.461,36
<b>Total Var:</b>	<b>105.928.515,77</b>	<b>12.802.832,51</b>	<b>9.070.943,86</b>	<b>100,03%</b>	<b>27.562.739,92</b>	<b>-27.913.617,31</b>	<b>15.404.508,45</b>	<b>-15.528.681,05</b>

### 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 – AGOSTO 2023



## RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/08/2023

Fundo	INFORMAÇÕES DOS ATIVOS					INFORMAÇÕES DE RATING		
	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	18/05/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	1.306.460,01	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	483.244,69	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	289.946,81	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	20/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	965.987,24	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	25/08/17	25/08/17	15/08/24	PETR	8.978.453,42	AAA	Aaa.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	18/12/17	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	3.362.726,50	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	21/12/17	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	981.526,83	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/01/18	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	3.490.521,41	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB II	19/02/18	19/02/18	15/02/25	SABESP	9.583.007,26	brAAA	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/02/18	19/02/18	15/02/25	SABESP	5.947.302,86	brAAA	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	13/03/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	12.968.720,41	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB II	23/05/18	23/05/18	15/05/28	COMGAS	25.773.893,58	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	638.419,54	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	638.419,54	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	638.419,54	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	637.131,78	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	638.419,54	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	04/07/18	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	12.159.387,18	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/07/18	26/07/18	15/07/25	AEGEA SA	14.020.585,07	brA	Aa1.br	AA(bra)
FI RF EMB II	26/07/18	26/07/18	15/07/25	CSMG	10.485.787,69	-	Aa3.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/02/13	15/02/25	CEMIG	1.349.632,59	brA+	A1.br	AA-(bra)
FIM EMB I A	12/02/19	09/01/19	15/01/25	ITAUUBB	2.690.921,39	-	AAA.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	557.144,99	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	3.527.692,11	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	2.008.936,28	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	6.073.684,02	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	702.561,30	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	5.684.359,67	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	8.430.735,68	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	868.621,25	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	609.377,33	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	30/09/20	28/09/20	22/09/25	HAPVIDA	270.300,40	-	-	AAA(bra)
FIM EMB II A	08/01/21	22/05/19	15/04/24	ECORODOV	1.389.564,12	-	-	AA(bra)
FIM EMB II A	05/02/21	07/08/19	15/07/24	COPEL GT	144.691,36	-	-	AA+(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	6.306.250,91	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	6.319.252,84	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	4.271.762,86	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/07/19	15/06/29	NEOENERG	603.774,43	brAA+	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/07/19	15/06/29	NEOENERG	6.001.819,13	brAA+	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	1.768.918,50	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	3.390.367,48	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	3.627.354,65	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	31/07/20	15/07/34	IGUA SAN	2.612.436,80	brAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	23/05/18	15/05/28	COMGAS	22.448.229,89	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	487.699,04	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	858.350,31	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	975.398,08	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	487.699,04	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	596.943,63	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	502.861,12	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	1.458.978,10	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	26/10/16	27/01/25	BRADESCO	13.971.316,45	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	12/12/17	15/11/24	CCR	6.251.432,73	brAAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	14/12/17	15/11/24	ECORODOV	4.286.711,98	brAA	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	19/02/18	15/02/25	SABESP	1.396.736,23	brAAA	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	23/05/18	15/05/28	COMGAS	9.976.991,06	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	28/06/18	15/06/27	JAGUARA	1.796.725,79	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	28/06/18	15/06/27	ENERGMIR	1.124.933,62	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	31/07/18	01/08/25	BRADESCO	4.517.923,19	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIM EMB I A	28/05/21	28/05/21	28/11/23	B.ALFA	1.248.870,09	-	Aa1.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	177.888,98	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	212.420,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	22/12/20	15/12/26	IRB	2.621.734,25	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	104.000,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	1.066.916,53	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	48.750,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	10/02/21	15/12/31	METRRORIO	1.437.850,00	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	07/04/21	15/03/31	LOCALIZA	5.436.658,69	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	1.608.640,24	-	-	AA-(bra)

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2023



## RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/08/2023

Fundo	INFORMAÇÕES DOS ATIVOS					INFORMAÇÕES DE RATING		
	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/06/21	06/01/21	15/11/25	QUATA	1.106.148,33	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	718.792,80	-	A.br	0
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	18.866,29	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	438.256,39	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	509.389,88	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	514.916,13	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	514.916,13	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	373.961,43	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	760.084,21	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	748.682,95	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	1.779.963,32	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	444.472,80	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	127.347,47	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	318.705,57	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	1.543.688,89	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	14/06/21	19/06/19	19/06/24	BNBBM	600.166,35	brAAA	AAbr	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	14/06/21	12/06/19	12/06/24	BNBBM	910.000,56	brAAA	AAbr	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	15/06/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	52.780,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	16/06/21	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	403.241,44	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	17/06/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	794.242,99	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	17/06/21	18/03/21	15/02/26	CORSAN	758.245,51	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	18/06/21	18/06/21	15/12/30	MG050	541.437,96	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	31.850,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	1.568.852,62	-	A.br	0
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	165.100,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	85.747,01	-	A.br	0
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	25/06/21	25/06/21	20/06/26	OURO VER	1.454.979,22	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	3.175.815,02	-	A.br	0
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	01/07/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	2.777.779,53	-	A.br	0
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/07/21	01/03/21	18/02/25	RENNER	1.106.316,53	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/07/21	01/03/21	18/02/25	RENNER	233.970,31	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/07/21	07/04/21	15/03/29	CAGECE	1.269.570,22	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	08/07/21	08/07/21	15/06/31	VAMOS	266.369,73	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/07/21	07/04/21	15/03/29	CAGECE	2.893.412,10	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/07/21	08/07/21	15/06/31	VAMOS	5.285.113,69	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	12/07/21	12/07/21	12/07/26	BRADESCO	4.057.066,53	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	2.059.261,64	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	221.542,72	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	1.000.212,80	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	190.060,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	520.110,65	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	167.700,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	245.960,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	122.980,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	1.864.014,60	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	291.388,70	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	4.118.523,29	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	392.027,44	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	392.027,44	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	1.397.663,04	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	878.273,69	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/07/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	2.927.667,92	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	19/07/21	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	610.909,71	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	210.340,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/07/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	2.061.208,79	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/07/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	755.292,39	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	11/06/18	15/05/25	INTERVIA	1.312.607,18	-	Aa2.br	-
FIM EMB I A	21/07/21	17/03/21	05/03/24	ENERG TR	1.361.250,67	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.120.595,32	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	950.296,26	-	-	AA-(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	20/09/19	20/08/26	VAMOS	1.028.363,05	brAA+	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	23/07/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.624.313,87	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/07/21	07/11/19	15/10/24	BKBR	1.045.380,39	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/07/21	23/12/20	15/12/26	RD COLIN	2.125.925,32	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	04/08/21	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	376.390,37	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	06/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	952.307,37	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	11/08/21	11/08/21	15/08/31	CSAN	1.012.697,90	-	-	AAA(bra)

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2023



## RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/08/2023

Fundo	INFORMAÇÕES DOS ATIVOS					INFORMAÇÕES DE RATING		
	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	11/08/21	19/11/19	15/06/27	AUTOPIST	1.206.627,82	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	17/08/21	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	3.102.949,00	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	18/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	1.251.412,36	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	18/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	971.085,26	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	27/08/21	27/08/21	20/08/31	S LUIZ A	998.693,54	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	662.361,48	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	59.315,95	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	296.579,77	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/06/19	15/06/24	PROLAGOS	1.126.622,13	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	12/05/21	15/04/26	ELETROB	2.059.348,65	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/09/21	22/10/19	21/10/26	AUTOBAN	650.290,92	brAAA	-	-
FIM EMB I A	17/09/21	04/10/18	01/10/24	EQUATENE	1.480.859,83	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/09/21	20/09/21	15/09/29	MOV_PART	1.108.854,79	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.082.875,91	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.082.875,91	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	1.133.673,08	brAA+	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	816.305,30	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	816.305,30	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	271.366,36	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	271.366,36	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	765.453,19	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	765.453,19	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	983.613,65	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	382.096,07	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	382.096,07	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	23/09/21	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	4.280.829,06	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	23/09/21	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	4.338.311,69	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	24/09/21	05/04/21	15/03/24	CCPR	42.707,43	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	24/09/21	09/09/21	11/09/23	PANAMERI	1.282.196,43	brAAA	AAAb	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	27/09/21	28/12/20	15/01/26	LOCAMERI	1.850.360,95	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	27/09/21	29/03/21	01/04/24	CNH	2.378.342,09	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	30/09/21	30/09/21	15/09/31	SIMPAN	890.600,75	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/10/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	662.591,32	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/10/21	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	5.961.556,16	-	-	AA-(bra)
FIM EMB I A	20/10/21	20/10/21	20/10/25	DAYCOVAL	2.645.284,17	brAA+	AA.br	AA(bra)
FIM EMB I A	20/10/21	20/10/21	20/10/24	DAYCOVAL	1.472.544,49	brAA+	AA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/10/21	22/10/21	15/12/35	CART	2.355.742,22	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	22/10/21	22/10/21	15/12/35	CART	884.839,76	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	25/10/21	22/04/21	15/03/26	VIX LOGI	179.377,47	-	-	A+(bra)
FIM EMB I A	27/10/21	27/10/21	15/10/29	CONT GLO	2.102.270,82	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/10/21	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	1.286.544,31	brAAA	-	-
FIM EMB I A	28/10/21	28/10/21	07/11/23	TOYOTA	2.777.613,19	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	04/11/21	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	3.405.436,69	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/11/21	10/11/21	15/10/28	LIGHT	348.348,78	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	12/11/21	12/11/21	15/10/31	VAMOS	2.211.165,47	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	18/11/21	18/11/21	15/10/31	HIDRO BR	4.171.910,18	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/11/21	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	11.981,79	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/11/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	2.179.082,55	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/11/21	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	2.331.656,37	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	03/12/21	11/06/19	11/06/24	BNBBM	600.660,43	brAAA	AAbr	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/12/21	06/12/21	15/12/35	TESC	2.726.015,24	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/12/21	06/01/21	15/11/25	QUATA	2.529.745,23	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/12/21	20/12/21	15/11/35	ORIZON	2.174.670,72	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/01/22	22/04/21	15/03/26	VIX LOGI	1.032.226,05	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/01/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.237.069,74	brAA	-	-
FIM EMB I A	19/01/22	19/01/22	19/01/24	BES INV	1.252.512,28	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/01/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	360.855,46	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/01/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	2.140.398,50	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	367.725,62	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	356.234,19	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	4.075.444,11	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	850.365,49	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	758.434,08	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	25/03/22	25/03/22	15/03/44	GBS PART	2.306.019,48	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/03/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	1.069.973,86	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	12/04/22	12/04/22	08/04/27	UNIGEL P	536.393,49	BB-	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	19/04/22	19/04/22	16/04/29	VERT-10	945.808,23	-	-	AAAs(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/04/22	26/04/22	15/04/24	LIGHT	945.451,85	-	-	D



## RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/08/2023

Fundo	INFORMAÇÕES DOS ATIVOS					INFORMAÇÕES DE RATING		
	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	2.248.075,97	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.263.982,06	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	12/05/22	12/05/22	15/04/27	BRKA	1.954.005,82	-	A+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	12/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.515.163,73	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	19/05/22	19/05/22	13/05/28	CEA MODA	494.711,74	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/05/22	26/05/22	10/05/27	GUAR	2.421.887,07	-	-	A
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	2.561.328,62	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	574.329,78	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.165.303,54	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	03/03/22	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	3.177.509,43	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/03/22	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	2.466.754,47	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/03/22	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	1.016.666,70	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/03/22	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	3.285.124,67	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/03/22	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	2.629.507,50	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/06/22	06/12/21	15/12/35	TESC	848.378,89	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	459.463,82	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	06/12/21	15/12/35	TESC	532.133,11	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	273.184,82	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	30/09/21	15/09/31	SIMPAR	1.917.135,30	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	08/07/21	15/06/31	VAMOS	906.925,51	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	08/07/21	15/06/31	VAMOS	73.991,59	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	790.503,61	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	893.898,86	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/06/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	1.317.122,42	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	27/06/22	27/06/22	07/07/24	LAGE	2.355.655,07	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	3.229.656,35	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	12/11/21	15/10/31	VAMOS	2.138.197,01	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	12/11/21	15/10/31	VAMOS	1.603.094,97	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	25/07/22	25/07/22	22/07/27	CM HOSPI	1.466.670,80	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/07/22	10/01/22	10/01/28	AMBIFAR	2.352.179,93	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/07/22	03/05/21	26/04/26	GGSH PAR	2.393.115,22	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	27/07/22	25/03/22	15/03/44	GBS PART	1.417.276,21	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/07/22	28/07/22	18/07/25	1V11	1.654.906,74	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	29/07/22	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	1.752.697,51	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/08/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	1.230,42	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	514.511,60	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	07/04/21	15/03/29	CAGECE	1.569.249,20	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	07/04/21	15/03/29	CAGECE	2.614.640,97	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/08/22	30/08/22	15/08/29	TRBR	8.283.733,80	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/09/22	02/09/22	02/09/29	AEGEA SA	1.819.530,37	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	27/09/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	52.908,10	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/09/22	28/09/22	28/09/27	B.BRASIL	4.899.596,63	-	AAA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	06/10/22	06/10/22	13/09/32	NTRASSUD	1.810.667,39	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/10/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	36.912,63	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	03/11/22	06/04/21	15/03/29	ANET	2.162.245,19	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	08/11/22	08/11/22	27/10/27	CM HOSPI	1.010.876,85	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/11/22	08/11/22	15/06/42	BRK AMBI	5.283.868,80	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/11/22	02/05/22	15/04/38	RDVE	1.739.853,90	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/11/22	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	1.607.500,54	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	11/11/22	11/11/22	15/10/40	RAHOLD	2.850.362,28	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	11/11/22	11/11/22	15/10/40	RAHOLD	10.570.232,38	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	3.784.518,67	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	1.703.605,08	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	1.394.898,12	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.448.838,63	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.763.656,37	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.444.325,11	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	01/12/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	1.694.225,13	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	2.197.634,41	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	2.331.343,83	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	1.700.509,62	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	16/11/20	15/10/36	PAMPASUL	2.470.596,70	brAAA	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/12/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	3.171.449,03	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/12/22	20/12/22	16/12/29	CSMG	2.055.739,63	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	15/12/21	15/11/36	ITAPOA T	1.193.661,70	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	02/05/22	15/04/38	RDVE	2.013.445,63	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	3.183.561,66	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/01/23	26/01/23	20/01/26	CELG	3.130.889,50	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/03/23	26/01/23	20/01/26	HAPVIDA	481.012,19	-	-	AAA(bra)



# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2023



## RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/08/2023

Fundo	INFORMAÇÕES DOS ATIVOS					INFORMAÇÕES DE RATING		
	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	26/01/23	20/01/26	AESTUCAN	1.169.657,32	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	26/01/23	20/01/26	ITAPOA T	3.624.157,60	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	26/01/23	20/01/26	BRV_VDR	8.578.549,55	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/03/23	26/01/23	20/01/26	PARANAGU	987.682,22	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	14/04/23	26/01/23	20/01/26	PARANAGU	699.720,37	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	17/04/23	26/01/23	20/01/26	VERO	2.938.744,32	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/04/23	26/01/23	20/01/26	BRKA	1.160.416,99	-	A+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/04/23	26/01/23	20/01/26	BRKA	32.032,88	-	A+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/04/23	26/01/23	20/01/26	HOLDARAG	2.289.672,55	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	26/01/23	20/01/26	PAMPASUL	1.894.833,19	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	26/01/23	20/01/26	LOCAMERI	2.268.937,01	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	26/01/23	20/01/26	MG050	3.284.362,64	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	26/01/23	20/01/26	BRK AMBI	1.314.434,79	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	26/01/23	20/01/26	VAMOS	1.771.570,11	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	26/01/23	20/01/26	HOLDARAG	794.976,19	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	26/01/23	20/01/26	CART	1.516.868,16	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	26/01/23	20/01/26	HOLDARAG	2.444.904,59	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	26/01/23	20/01/26	BRKA	300.148,81	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	26/01/23	20/01/26	BRKA	2.864.954,27	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	26/01/23	20/01/26	CORSAN	1.556.495,64	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	26/01/23	20/01/26	CART	655.011,25	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	26/01/23	20/01/26	METROARIO	5.292.682,93	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	26/01/23	20/01/26	HIDRO BR	2.647.558,38	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/05/23	26/01/23	20/01/26	HOLDARAG	225.792,05	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/05/23	26/01/23	20/01/26	BRK AMBI	2.299.408,82	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/05/23	26/01/23	20/01/26	CART	2.160.387,99	brAA+	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	26/01/23	20/01/26	RT BANDE	1.163.826,40	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	16/05/23	26/01/23	20/01/26	SABESP	2.330.283,07	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	26/01/23	20/01/26	CPFL	2.364.467,19	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	16/05/23	26/01/23	20/01/26	CACHOEIR	1.870.783,17	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	26/01/23	20/01/26	COELBA	1.880.647,86	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	26/01/23	20/01/26	LOCAMERI	2.955.933,36	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	26/01/23	20/01/26	SMARTIFI	3.166.411,68	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	18/05/23	26/01/23	20/01/26	UNIGEL P	134.929,22	BB-	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/05/23	26/01/23	20/01/26	UTE GNA	60.491,31	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/06/23	26/01/23	20/01/26	OURO VER	291.817,87	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/06/23	26/01/23	20/01/26	GBS PART	2.900.759,30	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/06/23	26/01/23	20/01/26	ASA BRAN	2.906.499,11	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	23/06/23	26/01/23	20/01/26	IGUA RJ	1.294.709,63	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/06/23	26/01/23	20/01/26	VAMOS	1.045.395,49	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/06/23	26/01/23	20/01/26	1V11	375.517,06	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/07/23	26/01/23	20/01/26	UTE GNA	1.519.004,00	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/07/23	26/01/23	20/01/26	RT BANDE	986.199,19	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/07/23	26/01/23	20/01/26	RT BANDE	986.199,19	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/07/23	26/01/23	20/01/26	PAMPASUL	3.051.981,30	brAAA	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/07/23	26/01/23	20/01/26	UTE GNA	1.519.004,00	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/07/23	26/01/23	20/01/26	1V11	1.138.697,30	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/07/23	26/01/23	20/01/26	1V11	278.348,23	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/07/23	26/01/23	20/01/26	RD COLIN	1.584.002,31	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	26/01/23	20/01/26	ECORODOV	1.416.644,79	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	26/01/23	20/01/26	ECORODOV	1.416.644,79	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	26/01/23	20/01/26	ITAPOA T	2.345.317,70	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	26/01/23	20/01/26	ASA BRAN	2.860.852,49	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	01/08/23	26/01/23	20/01/26	TIMS A	2.550.965,09	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/23	26/01/23	20/01/26	PAMPASUL	995.836,98	brAAA	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/23	26/01/23	20/01/26	VERO	1.297.322,04	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/23	26/01/23	20/01/26	TESC	1.991.998,30	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/23	26/01/23	20/01/26	RDVE	2.994.112,09	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/08/23	26/01/23	20/01/26	RT BANDE	1.249.150,92	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/08/23	26/01/23	20/01/26	BRADESCO	4.043.720,38	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/08/23	26/01/23	20/01/26	SPERIO4	2.382.917,00	brAA+	-	-
FIM EMB II A	29/08/23	26/01/23	20/01/26	BRADESCO	10.000.358,85	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	31/08/23	26/01/23	20/01/26	SANEAMEN	488.000,00	-	AA+.br	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	-	FIDC VERDECARD SN3	1.234.359,04	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	-	FIDC CREDZ SN4	2.320,22	-	-	AAAsf(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	-	FIDC CREDZ SN6	2.512.922,41	brAA (sf)	-	A+sf(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	FIDC VERDECARD SN5	262.795,74	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	VERDECARD FIDC SN6	1.284.829,11	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	FIDC VERDECARD SN8	1.376.543,75	brAAA(sf)	-	-



## RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/08/2023

Fundo	INFORMAÇÕES DOS ATIVOS					INFORMAÇÕES DE RATING		
	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	RB CAP CREDIT AL SN3	757.615,15	brAA-(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	BR ELETRO FIDC S1	2.631.581,93	-	-	Aasf(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	INSS CONS PDL I FIDC	1.566.177,13	-	-	AAAsf(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	-	-	-	DRIVER SIX FIDC SN	1.566.177,13	-	AAA.br	-

Observação: Em agosto 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** **4.545.326.680,07**

Tópico do Enquadramento	Limite	Aplicação Atual	Valor Limite	% Aplicado	Status
% do Segmento RF/PL PLANO	100,00%	3.936.499.743,95	4.545.326.680,07	86,61%	Enquadrado
% do PL em Títulos de Emissão do Tesouro Nacional e/ou do BACEN	100,00%	3.220.550.596,40	4.545.326.680,07	70,85%	Enquadrado
% do PL em Títulos RF1, exceto títulos do Tesouro Nacional	80,00%	715.949.147,54	3.636.261.398,24	15,75%	Enquadrado
% do PL em FIDC	20,00%	Verificar Rel. de Diversificação de FIDC's	909.065.349,56	0,00%	Enquadrado
% do PL em uma mesma pessoa jurídica não-financeira	10,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Não Financ.	454.532.674,78	0,00%	Enquadrado
% do PL em Instituições Financeiras	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Financ.	1.136.331.670,02	0,00%	Enquadrado
% de uma mesma Série de Debêntures	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Debêntures	1.136.331.670,02	0,00%	Enquadrado
% do PL em RV	70,00%	531.448.755,17	3.181.728.621,86	11,69%	Enquadrado
% do capital votante de uma empresa	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação RV	1.136.331.670,02	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Imobiliários	20,00%	75.527.353,11	909.065.349,56	1,66%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Empréstimos	15,00%	25.239.766,61	681.799.029,10	0,56%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Estruturados	20,00%	0,00	909.065.349,56	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos no Exterior	10,00%	0,00	454.532.674,78	0,00%	Enquadrado

(\*) O Relatório Completo de Enquadramentos Legais está disponível no portal da EMBRAER PREV ([www.embraerprev.com.br](http://www.embraerprev.com.br))

## 6.2. Relatório de Túnel de Preços

### RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE AGOSTO DE 2023 À 31 DE AGOSTO DE 2023



#### FIM EMB I A

DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	FUNTE ANBIMA			DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
								TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.		
01/08/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	5,4500%	5,4443%	5,2787%	5,5827%	0,0057%	NÃO
02/08/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	5,4450%	5,4177%	5,2809%	5,5849%	0,0273%	NÃO
03/08/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Venda	5,2510%	5,0874%	4,9716%	5,4839%	0,1636%	NÃO
03/08/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Venda	5,2500%	5,0874%	4,9716%	5,4839%	0,1626%	NÃO
04/08/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Compra	5,1190%	5,0255%	4,8083%	5,3206%	0,0935%	NÃO
11/08/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	5,3655%	5,3444%	5,1887%	5,4921%	0,0211%	NÃO
21/08/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Compra	5,0090%	5,1118%	4,7550%	5,2687%	-0,1028%	NÃO
24/08/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	5,5100%	5,5200%	5,3474%	5,6507%	-0,0100%	NÃO

### RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE AGOSTO DE 2023 À 31 DE AGOSTO DE 2023



#### FIM EMB II A

DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	FUNTE ANBIMA			DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
								TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.		
16/08/2023	FIM EMB II A	BNP	XP CCTVM	NTN-B	15/08/2024	Venda	6,6611%	6,6287%	6,3361%	7,0742%	0,0324%	NÃO
16/08/2023	FIM EMB II A	BNP	XP CCTVM	NTN-B	15/08/2024	Venda	6,6611%	6,6287%	6,3361%	7,0742%	0,0324%	NÃO
16/08/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2025	Compra	5,5176%	5,4924%	5,2316%	5,8021%	0,0252%	NÃO
16/08/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2026	Venda	4,9731%	4,9746%	4,6944%	5,2078%	-0,0015%	NÃO
16/08/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2026	Venda	4,9731%	4,9746%	4,6944%	5,2078%	-0,0015%	NÃO
16/08/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2026	Venda	4,9731%	4,9746%	4,6944%	5,2078%	-0,0015%	NÃO
16/08/2023	FIM EMB II A	BNP	LIQUIDEZ	NTN-B	15/05/2027	Venda	4,9507%	4,9867%	4,6927%	5,1824%	-0,0360%	NÃO
16/08/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2028	Compra	4,9790%	5,0131%	4,7262%	5,1936%	-0,0341%	NÃO
17/08/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	LFT	01/09/2024	Venda	0,5126%	0,0011%	-0,0300%	0,8200%	-0,0474%	NÃO
17/08/2023	FIM EMB II A	BNP	LIQUIDEZ	LTN	01/04/2025	Compra	10,3821%	10,4244%	10,0407%	10,7777%	-0,0423%	NÃO
25/08/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	LTN	01/04/2025	Compra	10,3568%	10,3875%	9,9345%	10,6665%	-0,0307%	NÃO
29/08/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	LFT	01/03/2024	Venda	0,0006%	0,0000%	-0,0397%	0,0303%	0,0006%	NÃO
30/08/2023	FIM EMB II A	BNP	RENASCEN	LFT	01/09/2025	Venda	0,0161%	0,0110%	-0,0077%	0,0612%	0,0051%	NÃO
31/08/2023	FIM EMB II A	BNP	LIQUIDEZ	LTN	01/07/2025	Compra	10,2754%	10,3106%	9,8259%	10,5989%	-0,0352%	NÃO

### RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE AGOSTO DE 2023 À 31 DE AGOSTO DE 2023



#### FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI

DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	FUNTE ANBIMA			DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
								TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.		
22/08/2023	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	BNP	RENASCEN	LFT	01/03/2024	Compra	-0,0002%	0,0000%	-0,0378%	0,0309%	-0,0002%	NÃO

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2023

## RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE AGOSTO DE 2023 À 31 DE AGOSTO DE 2023



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
01-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	13,54	16.000,00	216.657,37	13,19	13,54	13,73	29.480,00
01-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	14,25	7.800,00	111.150,00	13,96	14,18	14,30	7.889,00
01-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	32,84	2.000,00	65.681,93	32,65	32,87	33,66	22.451,00
01-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	32,81	3.300,00	108.273,00	32,65	32,87	33,66	22.451,00
01-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	18,26	7.100,00	129.634,01	17,97	18,24	18,41	15.338,00
01-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	12,19	3.200,00	38.999,43	11,94	12,18	12,35	15.629,00
01-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	12,25	2.100,00	25.727,10	11,94	12,18	12,35	15.629,00
01-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	45,83	1.400,00	64.160,19	44,93	45,48	46,16	26.586,00
01-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	11,44	1.000,00	11.440,00	11,05	11,40	11,55	18.762,00
01-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	11,45	3.800,00	43.500,28	11,05	11,40	11,55	18.762,00
01-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	48,54	2.600,00	126.193,60	47,93	48,48	48,88	15.134,00
01-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	29,64	4.400,00	130.429,46	29,09	29,64	29,78	7.374,00
01-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	29,69	2.900,00	86.101,88	29,09	29,64	29,78	7.374,00
02-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	13,58	8.400,00	114.054,66	13,30	13,59	13,84	23.565,00
02-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	13,49	7.800,00	105.221,02	13,30	13,59	13,84	23.565,00
02-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	CIEL3	4,36	123.600,00	538.735,42	4,26	4,36	4,58	42.620,00
02-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	CIEL3	4,40	9.900,00	43.560,00	4,26	4,36	4,58	42.620,00
02-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	13,47	13.100,00	176.505,96	13,29	13,41	13,64	17.373,00
02-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	13,38	1.200,00	16.056,00	13,29	13,41	13,64	17.373,00
02-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	13,58	900,00	12.220,04	13,29	13,41	13,64	17.373,00
02-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	15,68	6.100,00	95.669,78	15,50	15,69	15,85	10.564,00
02-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	18,09	6.000,00	108.537,47	17,95	18,10	18,41	22.043,00
02-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	23,44	2.100,00	49.220,61	22,96	23,39	23,70	7.619,00
02-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	30,30	1.100,00	33.330,00	29,71	30,11	30,66	10.676,00
02-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	30,24	1.100,00	33.263,88	29,71	30,11	30,66	10.676,00
02-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	30,02	2.300,00	69.042,87	29,71	30,11	30,66	10.676,00
02-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	30,29	5.200,00	157.524,58	29,71	30,11	30,66	10.676,00
03-08-23	FIA RVA EMB II	Compra	MOVI3	12,28	19.500,00	239.396,81	12,06	12,30	12,52	10.667,00
03-08-23	FIA RVA EMB II	Compra	MOVI3	12,24	46.100,00	564.034,27	12,06	12,30	12,52	10.667,00
03-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	36,91	8.500,00	313.756,92	36,44	37,01	38,39	42.481,00
03-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	13,33	4.900,00	65.325,45	13,21	13,30	13,67	12.983,00
03-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	NINJ3	3,87	500,00	1.936,45	3,66	3,81	3,95	735,00
03-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	17,90	10.700,00	191.510,71	17,66	17,91	18,38	17.231,00
03-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	47,14	4.500,00	212.113,65	46,22	47,01	47,40	34.115,00
03-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	23,07	3.700,00	85.358,51	22,70	23,00	23,40	10.827,00
03-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	50,00	6.500,00	325.000,42	48,07	49,65	50,47	33.782,00
03-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	29,86	3.800,00	113.456,32	29,51	29,82	30,64	12.501,00
03-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	30,00	600,00	18.000,00	29,51	29,82	30,64	12.501,00
03-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	29,80	1.900,00	56.620,00	29,51	29,82	30,64	12.501,00
03-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	29,89	1.600,00	47.824,42	29,51	29,82	30,64	12.501,00
04-08-23	FIA RVA EMB II	Compra	MOVI3	12,12	38.400,00	465.436,15	12,00	12,18	12,50	9.907,00
04-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	13,80	12.700,00	175.271,54	13,43	13,72	14,08	38.176,00
04-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	16,12	7.000,00	112.815,18	15,82	16,03	16,27	16.073,00
04-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	16,00	300,00	4.799,88	15,82	16,03	16,27	16.073,00
04-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	19,74	11.200,00	221.115,70	18,46	19,55	20,15	63.607,00
04-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	17,73	3.100,00	54.953,98	17,55	17,80	18,10	20.931,00
04-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	17,87	2.200,00	39.318,02	17,55	17,80	18,10	20.931,00
04-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	48,27	3.400,00	164.131,14	46,90	48,14	49,06	32.588,00
04-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	50,72	5.100,00	258.657,24	49,25	50,60	51,50	24.340,00
04-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	30,30	1.300,00	39.390,45	29,68	30,04	30,37	4.511,00
04-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	29,87	400,00	11.948,00	29,68	30,04	30,37	4.511,00
04-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	30,01	1.400,00	42.010,82	29,68	30,04	30,37	4.511,00
07-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ALSO3	23,98	800,00	19.182,13	23,75	24,00	24,30	6.581,00
07-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	14,05	22.600,00	317.541,86	13,81	13,99	14,30	39.800,00
07-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	13,88	3.000,00	41.648,75	13,82	13,86	13,96	4.774,00
07-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBA53	47,39	700,00	33.174,60	47,19	47,42	48,00	17.288,00
07-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	32,28	8.600,00	277.606,04	32,08	32,32	32,91	23.379,00
07-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	32,88	800,00	26.302,19	32,51	32,88	33,17	17.223,00
07-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	CIEL3	4,16	4.100,00	17.049,80	4,11	4,16	4,21	21.763,00
07-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	CIEL3	4,16	54.400,00	226.430,49	4,11	4,16	4,21	21.763,00
07-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	CIEL3	4,17	12.500,00	52.127,20	4,11	4,16	4,21	21.763,00
07-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	36,37	1.400,00	50.916,89	36,02	36,33	36,62	18.389,00
07-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,92	4.500,00	58.128,84	12,83	12,90	12,98	5.281,00
07-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	32,58	2.400,00	78.196,14	32,35	32,58	32,84	11.399,00
07-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	15,66	800,00	12.524,33	15,55	15,67	16,01	10.558,00
07-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	22,22	2.300,00	51.099,41	22,08	22,20	22,48	10.131,00
07-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	27,83	2.500,00	69.586,00	27,62	27,84	28,28	62.184,00
07-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	27,77	9.300,00	258.302,42	27,62	27,84	28,28	62.184,00
07-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	LREN3	19,33	2.800,00	54.135,53	18,93	19,23	19,75	26.124,00
07-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	17,46	7.500,00	130.931,71	17,25	17,47	17,68	17.963,00
07-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	17,45	1.000,00	17.450,36	17,25	17,47	17,68	17.963,00
07-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	47,49	300,00	14.247,00	46,92	47,64	48,20	18.239,00
07-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	22,78	1.100,00	25.056,27	22,57	22,78	23,15	4.522,00
07-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	66,39	600,00	39.833,03	66,11	66,41	67,41	9.274,00
07-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	SCAR3	24,14	400,00	9.654,00	23,99	24,06	24,28	20,00
07-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	23,50	1.400,00	32.901,39	23,19	23,46	24,26	6.043,00
07-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	50,44	2.500,00	126.106,29	50,18	50,53	51,00	14.398,00
07-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	17,16	1.200,00	20.589,83	17,01	17,15	17,25	8.759,00
07-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	29,71	1.600,00	47.532,76	29,44	29,79	30,10	5.954,00
07-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	CPLE6	8,64	49.405,00	426.689,71	8,53	8,64	8,70	18.195,00
08-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	14,05	7.700,00	108.182,20	13,47	14,00	14,19	25.637,00
08-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBA53	47,00	2.700,00	126.894,99	46,36	46,92	47,39	30.779,00
08-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	CIEL3	4,08	8.800,00	35.919,21	4,05	4,08	4,16	29.413,00
08-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	CIEL3	4,08	24.200,00	98.826,48	4,05	4,08	4,16	29.413,00
08-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	5,05	29.100,00	147.089,20	4,57	4,94	5,10	44.608,00
08-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	27,68	13.300,00	368.205,75	27,11	27,58	28,01	58.331,00
08-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	27,60	1.500,00	41.400,00	27,11	27,58	28,01	58.331,00

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2023

## RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE AGOSTO DE 2023 À 31 DE AGOSTO DE 2023



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
08-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	17,41	6.500,00	113.164,86	16,89	17,37	17,61	17.064,00
08-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	23,41	700,00	16.387,00	22,01	22,91	23,42	5.974,00
08-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	CPL66	8,72	3.299,00	28.759,44	8,53	8,70	8,83	25.187,00
08-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	CPL66	8,76	3.522,00	30.845,90	8,53	8,70	8,83	25.187,00
08-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	CPL66	8,67	14.526,00	125.943,49	8,53	8,70	8,83	25.187,00
08-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	CPL66	8,67	14.627,00	126.864,89	8,53	8,70	8,83	25.187,00
08-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	CPL66	8,78	1.114,00	9.780,92	8,53	8,70	8,83	25.187,00
09-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	MOVI3	12,85	3.400,00	43.676,47	11,64	12,45	12,89	20.915,00
09-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	13,78	4.700,00	64.747,81	13,67	13,86	14,18	31.930,00
09-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	46,71	462,00	21.579,54	46,51	46,69	47,15	24.256,00
09-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	33,08	3.266,00	108.035,16	32,23	32,96	33,32	40.740,00
09-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	27,21	11.977,00	325.900,35	26,92	27,24	27,60	45.846,00
09-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	LREN3	18,23	2.351,00	42.857,71	17,99	18,44	19,01	48.102,00
09-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	17,10	5.013,00	85.726,36	16,98	17,13	17,32	16.856,00
09-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	CPL66	8,25	262.986,00	2.169.634,50	8,17	8,32	8,44	40.650,00
10-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	ARZZ3	80,83	6.000,00	484.980,00	79,60	81,34	84,48	12.237,00
10-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	MOVI3	12,96	7.000,00	90.700,85	12,77	13,24	13,48	14.315,00
10-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	MOVI3	13,21	31.200,00	412.047,95	12,77	13,24	13,48	14.315,00
10-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	24,27	700,00	16.991,00	24,19	24,33	24,80	9.527,00
10-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	13,92	6.100,00	84.938,73	13,75	13,87	14,13	13.775,00
10-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	13,84	900,00	12.453,00	13,75	13,87	14,13	13.775,00
10-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	13,81	1.800,00	24.852,00	13,73	13,80	13,97	8.485,00
10-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	46,98	500,00	23.488,00	46,73	47,02	47,30	29.881,00
10-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	32,85	700,00	22.995,00	32,60	33,06	33,58	20.966,00
10-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	CIEL3	3,94	7.300,00	28.769,30	3,92	3,96	4,09	64.113,00
10-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	CIEL3	3,95	9.200,00	36.376,29	3,92	3,96	4,09	64.113,00
10-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	37,42	1.200,00	44.907,00	37,22	37,43	37,84	15.380,00
10-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,89	2.600,00	33.524,00	12,71	12,89	12,99	10.222,00
10-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	32,35	2.000,00	64.695,00	32,21	32,32	32,56	11.340,00
10-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	5,28	32.400,00	171.044,04	5,13	5,30	5,42	51.766,00
10-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	5,25	3.000,00	15.760,00	5,13	5,30	5,42	51.766,00
10-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	22,24	1.900,00	42.253,00	22,03	22,24	22,40	10.727,00
10-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	27,68	2.200,00	60.888,00	27,52	27,74	27,94	30.723,00
10-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	18,86	1.500,00	28.294,00	18,40	18,81	19,06	31.304,00
10-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	17,60	1.800,00	31.672,00	17,31	17,52	17,76	16.501,00
10-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	47,22	300,00	14.166,00	46,96	47,43	48,55	18.220,00
10-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	23,78	700,00	16.649,00	23,52	23,89	24,22	11.295,00
10-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	66,66	500,00	33.329,00	66,35	67,03	68,08	16.673,00
10-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	SMTF3	22,65	800,00	18.123,00	22,46	22,85	23,73	6.577,00
10-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	49,32	300,00	14.795,00	49,19	49,48	49,92	9.643,00
10-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	16,54	1.100,00	18.196,00	16,40	16,68	17,21	22.947,00
10-08-23	FIA RVA EMB IV	Venda	ALSO3	24,38	5.816,00	141.791,30	24,19	24,33	24,80	9.527,00
10-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RAIL3	24,01	5.315,00	127.635,16	23,86	24,07	24,36	25.049,00
10-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RAIL3	24,16	426,00	10.294,27	23,86	24,07	24,36	25.049,00
10-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RAIL3	24,14	2.660,00	64.223,04	23,86	24,07	24,36	25.049,00
10-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	18,42	3.672,00	67.643,09	17,97	18,44	19,12	29.914,00
11-08-23	FIA RVA EMB II	Compra	ARZZ3	79,41	6.000,00	476.430,00	78,70	81,46	84,36	12.863,00
11-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	13,03	6.600,00	86.024,69	12,82	13,00	13,30	15.826,00
11-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	31,93	800,00	25.544,00	31,80	32,25	32,49	14.105,00
11-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	32,25	1.900,00	61.266,72	31,80	32,25	32,49	14.105,00
11-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	5,26	110.870,00	583.188,20	5,22	5,29	5,39	49.323,00
11-08-23	FIA RVA EMB IV	Venda	PRI03	48,22	39.930,00	1.925.620,00	47,67	48,31	48,65	27.564,00
14-08-23	FIA RVA EMB II	Compra	BRFS3	9,91	26.700,00	264.513,17	9,76	9,90	10,10	23.942,00
14-08-23	FIA RVA EMB II	Compra	CPFE3	35,68	12.400,00	442.457,54	35,33	35,90	36,80	14.573,00
14-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	CYRE3	24,71	25.800,00	637.626,22	24,28	24,77	25,71	15.655,00
14-08-23	FIA RVA EMB II	Compra	GMAT3	7,34	23.600,00	173.217,50	7,27	7,39	7,81	16.620,00
14-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	62,00	9.200,00	570.422,29	61,90	62,19	63,04	84.731,00
14-08-23	FIA RVA EMB II	Compra	YDUQ3	20,87	16.700,00	348.564,72	20,53	21,44	24,07	56.454,00
14-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	32,78	4.000,00	131.118,19	32,56	32,77	32,91	16.312,00
14-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	CIEL3	3,79	34.500,00	130.613,18	3,76	3,79	3,93	33.618,00
14-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	32,00	1.600,00	51.200,00	31,99	32,19	32,46	19.742,00
14-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	32,20	3.400,00	109.480,10	31,99	32,19	32,46	19.742,00
14-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	15,00	21.000,00	315.093,67	14,88	15,01	15,35	16.640,00
14-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	27,24	2.400,00	65.373,85	27,17	27,36	27,62	26.345,00
14-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	LREN3	17,43	4.000,00	69.714,64	17,24	17,75	18,56	38.478,00
14-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	17,24	10.700,00	184.502,13	16,93	17,30	17,56	21.830,00
15-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	ELET3	35,10	33.800,00	1.186.491,85	34,94	35,18	35,76	65.874,00
15-08-23	FIA RVA EMB II	Compra	LREN3	17,22	67.200,00	1.157.075,10	17,04	17,32	17,70	38.270,00
15-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	PETRA	30,86	20.500,00	632.630,00	30,85	31,55	32,15	142.895,00
15-08-23	FIA RVA EMB II	Compra	RENT3	64,99	10.400,00	675.896,00	62,87	64,57	65,74	35.806,00
15-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	24,43	700,00	17.100,51	24,18	24,39	24,61	23.267,00
15-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	13,19	900,00	11.868,50	12,97	13,12	13,28	25.595,00
15-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	13,73	1.800,00	24.712,01	13,69	13,75	13,86	7.727,00
15-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	46,90	500,00	23.448,60	46,68	46,95	47,34	28.270,00
15-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	32,71	3.900,00	127.554,31	32,51	32,69	32,94	14.981,00
15-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	32,69	400,00	13.075,02	32,51	32,69	32,94	14.981,00
15-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	32,19	700,00	22.532,42	31,66	32,12	32,82	22.131,00
15-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	CIEL3	3,71	35.300,00	130.885,34	3,64	3,70	3,78	26.250,00
15-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	35,17	17.000,00	597.923,94	34,94	35,18	35,76	65.874,00
15-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,72	2.700,00	34.342,00	12,64	12,75	12,99	12.569,00
15-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	14,88	5.800,00	86.291,94	14,78	14,90	15,15	14.365,00
15-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	14,87	2.800,00	41.636,00	14,78	14,90	15,15	14.365,00
15-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	21,57	1.900,00	40.974,98	21,45	21,61	22,11	19.338,00
15-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	17,34	1.900,00	32.943,72	17,04	17,32	17,70	38.270,00
15-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	17,86	42.100,00	751.985,95	17,46	17,84	18,29	44.690,00
15-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	17,65	6.100,00	107.675,65	17,46	17,84	18,29	44.690,00
15-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	17,93	2.500,00	44.819,15	17,46	17,84	18,29	44.690,00

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2023

## RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE AGOSTO DE 2023 À 31 DE AGOSTO 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
15-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	46,72	400,00	18.688,98	45,91	46,76	48,00	40.422,00
15-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	22,61	1.000,00	22.610,92	22,33	22,65	23,35	10.003,00
15-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	65,31	500,00	32.654,67	62,87	64,57	65,74	35.806,00
15-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	21,89	900,00	19.700,41	21,36	21,83	22,04	5.956,00
15-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	50,22	1.000,00	50.222,69	49,83	50,32	51,40	11.020,00
15-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	17,31	1.000,00	17.314,57	16,95	17,42	17,77	33.363,00
15-08-23	FIA RVA EMB IV	Venda	ALSO3	24,36	5.537,00	134.867,88	24,18	24,39	24,61	23.267,00
15-08-23	FIA RVA EMB IV	Venda	ALSO3	24,43	667,00	16.294,35	24,18	24,39	24,61	23.267,00
15-08-23	FIA RVA EMB IV	Venda	EQTL3	31,87	8.131,00	259.141,99	31,59	31,83	32,32	21.555,00
15-08-23	FIA RVA EMB IV	Venda	HAPV3	5,01	59.433,00	297.909,07	4,91	5,01	5,08	35.325,00
15-08-23	FIA RVA EMB IV	Venda	PRI03	46,74	5.442,00	254.378,92	45,91	46,76	48,00	40.422,00
15-08-23	FIA RVA EMB IV	Venda	RENT3	65,47	143,00	9.362,49	62,87	64,57	65,74	35.806,00
15-08-23	FIA RVA EMB IV	Venda	RENT3	65,17	1.010,00	65.823,53	62,87	64,57	65,74	35.806,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ABEV3	14,20	6.944,00	98.607,05	14,18	14,25	14,42	17.558,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ALPA4	10,05	320,00	3.215,00	9,99	10,11	10,24	11.157,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ALSO3	24,18	843,00	20.386,26	24,18	24,39	24,61	23.267,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ARZZ3	81,23	96,00	7.797,60	77,33	79,43	81,30	5.962,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ASAI3	13,11	1.885,00	24.714,67	12,97	13,12	13,28	25.595,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	AZUL4	15,85	518,00	8.210,30	15,53	16,00	16,97	27.521,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	B3SA3	14,02	9.076,00	127.247,12	13,92	14,05	14,21	23.485,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBA53	46,76	2.249,00	105.163,34	46,68	46,95	47,34	28.270,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBD33	13,72	2.375,00	32.585,84	13,59	13,67	13,83	11.390,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBD43	15,33	8.147,00	124.893,95	15,15	15,29	15,38	29.126,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBSE3	32,55	1.064,00	34.634,64	32,51	32,69	32,94	14.981,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BEEF3	10,25	374,00	3.834,86	10,10	10,34	10,53	27.442,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BPAC11	31,79	1.940,00	61.672,58	31,66	32,12	32,82	22.131,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRAP4	21,41	397,00	8.501,12	21,41	21,58	22,08	8.919,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRFS3	10,53	2.654,00	27.948,27	9,82	10,33	10,60	31.956,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRKM5	23,76	420,00	9.977,60	23,43	23,84	24,40	13.355,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CASH3	7,68	118,00	906,06	7,63	7,76	7,99	5.218,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CCRO3	13,29	1.581,00	21.011,70	13,23	13,32	13,44	11.800,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CIEL3	3,67	1.734,00	6.363,78	3,64	3,70	3,78	26.250,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CMIG4	11,96	2.283,00	27.305,87	11,91	12,05	12,44	15.621,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CMIN3	4,08	1.758,00	7.173,12	4,07	4,09	4,15	8.853,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	COGN3	3,05	2.874,00	8.765,14	2,94	3,02	3,09	19.223,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CPFE3	35,30	297,00	10.483,47	35,27	35,47	36,00	8.161,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CPL63	8,80	2.474,00	21.771,47	8,75	8,82	9,05	34.056,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CRFB3	11,32	8.740,00	9.477,05	10,95	11,21	11,43	14.437,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CSAN3	18,44	1.854,00	34.186,80	18,38	18,64	19,16	23.926,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CSNA3	12,21	933,00	11.394,90	12,15	12,24	12,38	6.810,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CVCB3	2,51	634,00	1.591,68	2,48	2,52	2,63	9.500,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CYRE3	24,64	434,00	10.693,76	24,12	24,54	24,97	12.112,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	DXCO3	8,76	395,00	3.458,97	8,68	8,76	8,90	7.088,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	EGIE3	41,96	404,00	16.952,76	41,84	42,04	42,40	6.991,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ELET3	35,15	3.196,00	112.341,16	34,94	35,18	35,76	65.874,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ELET6	39,50	437,00	17.259,76	39,28	39,70	40,51	25.140,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	EMBR3	18,22	1.163,00	21.190,49	17,90	18,19	18,42	12.561,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ENEV3	12,78	2.498,00	31.930,32	12,64	12,75	12,99	12.569,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ENGI11	48,34	393,00	18.999,51	48,26	48,65	49,56	11.690,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	EQTL3	31,67	1.766,00	55.930,52	31,59	31,83	32,32	21.555,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	EZTC3	23,60	135,00	3.185,67	22,57	23,29	23,67	8.614,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	FLRY3	14,83	670,00	9.935,68	14,78	14,90	15,15	14.365,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	GGBR4	25,78	1.731,00	44.624,97	25,63	25,79	26,04	21.435,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	GOAU4	12,12	1.056,00	12.798,82	12,06	12,14	12,27	13.139,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	GOLL4	8,19	314,00	2.572,17	7,87	8,16	9,00	32.567,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	HAPV3	5,02	6.845,00	34.362,74	4,91	5,01	5,08	35.325,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	HYPE3	42,66	635,00	27.085,97	42,58	42,88	43,41	8.405,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	IGTI11	21,63	342,00	7.397,14	21,45	21,61	22,11	19.338,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	IRBR3	39,60	129,00	5.108,28	36,57	38,65	41,83	15.756,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ITSA4	9,53	7.937,00	75.640,11	9,48	9,53	9,59	18.366,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ITUB4	27,09	7.601,00	205.911,65	26,87	27,10	27,36	33.713,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	IBSS3	19,64	1.797,00	35.292,40	18,86	19,63	20,25	23.641,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	KLBN11	22,60	1.111,00	25.110,28	22,55	22,71	22,95	10.107,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	LENB3	17,44	1.504,00	26.229,20	17,04	17,32	17,70	38.270,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	LWSA3	6,75	619,00	4.180,57	6,56	6,73	7,04	14.753,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	MGLU3	2,77	4.550,00	12.603,65	2,53	2,68	2,80	54.626,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	MRF33	7,68	420,00	3.225,40	7,18	7,56	7,87	17.955,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	MRVE3	12,91	607,00	7.836,17	12,61	12,85	13,02	15.170,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	MULT3	26,64	422,00	11.242,92	26,44	26,62	26,87	19.741,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	NTCO3	18,09	1.328,00	24.023,22	17,46	17,84	18,29	44.690,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PCAR3	19,52	227,00	4.432,04	19,47	19,71	20,15	10.646,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PETR3	33,56	4.734,00	158.873,04	33,52	34,31	35,32	24.548,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PETRA	30,86	7.229,00	223.086,94	30,85	31,55	32,15	142.895,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PETZ3	5,34	483,00	2.579,22	5,29	5,36	5,60	32.632,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PRI03	46,82	1.329,00	62.227,01	45,91	46,76	48,00	40.422,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RADL3	27,30	1.842,00	50.285,20	27,27	27,40	27,63	10.303,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RAIL3	23,02	1.924,00	44.297,96	22,79	23,00	23,18	28.225,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RAI24	3,78	1.900,00	7.182,08	3,69	3,80	3,99	22.733,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RDOR3	30,75	1.734,00	53.321,62	30,69	30,97	31,35	17.167,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RENT3	64,99	1.332,00	86.572,88	62,87	64,57	65,74	35.806,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RRRP3	32,48	372,00	12.082,98	31,87	32,56	33,38	15.736,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SANB11	26,89	563,00	15.140,28	26,86	27,01	27,25	6.551,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SBS33	54,77	539,00	29.521,27	54,77	55,18	56,23	7.795,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SLCE3	39,88	168,00	6.699,36	39,73	40,10	41,04	9.085,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SMT03	35,10	226,00	7.933,20	34,30	35,23	35,56	11.388,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SOMA3	9,02	776,00	6.996,96	8,93	9,06	9,31	29.992,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SUZB3	50,04	1.150,00	57.541,65	49,83	50,32	51,40	11.020,00



# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2023

## RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE AGOSTO DE 2023 À 31 DE AGOSTO 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
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	TAEF11	34,50	346,00	11.937,11	34,50	34,66	35,03	8.184,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	TIMS3	14,87	1.279,00	19.017,43	14,87	14,96	15,05	15.488,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	TOTS3	27,50	814,00	22.385,00	27,12	27,44	27,67	14.443,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	UGPA3	18,74	1.722,00	32.272,02	18,33	18,90	19,64	20.411,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	USIM5	6,89	815,00	5.615,35	6,86	6,89	6,94	8.882,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VALE3	61,29	6.388,00	391.520,72	61,14	61,52	61,96	66.995,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VBBR3	17,62	1.764,00	31.081,38	16,95	17,42	17,77	33.363,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VIAI3	1,69	2.266,00	3.829,54	1,54	1,61	1,74	58.231,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VIVT3	42,13	670,00	28.228,23	42,08	42,34	42,62	7.203,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	WEGE3	39,35	1.996,00	78.543,64	39,16	39,42	39,78	13.276,00
15-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	YDUQ3	21,42	469,00	10.043,99	19,92	20,72	21,43	32.396,00
16-08-23	FIA RVA EMB II	Compra	B3SA3	14,08	24.000,00	337.812,00	13,76	13,92	14,15	31.949,00
16-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	ELET3	34,99	23.600,00	825.819,43	33,46	34,41	35,39	72.567,00
16-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	ENGI11	47,30	9.200,00	435.156,79	46,55	47,51	48,03	16.804,00
16-08-23	FIA RVA EMB II	Compra	HAPV3	4,82	75.200,00	362.464,00	4,73	4,81	4,87	39.553,00
16-08-23	FIA RVA EMB II	Compra	PETR3	34,70	67.600,00	2.345.483,00	33,68	34,60	34,96	30.779,00
16-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	VALE3	61,58	11.200,00	689.738,60	61,00	61,36	61,93	75.290,00
16-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	32,70	2.600,00	85.030,03	32,35	32,65	32,92	20.307,00
16-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	CIEL3	3,74	23.000,00	86.093,49	3,64	3,73	3,81	26.203,00
16-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	34,85	9.100,00	317.120,63	33,46	34,41	35,39	72.567,00
16-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	33,82	3.100,00	104.850,34	33,46	34,41	35,39	72.567,00
16-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	14,99	3.600,00	53.952,30	14,72	14,94	15,06	16.148,00
16-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	15,00	400,00	5.999,90	14,72	14,94	15,06	16.148,00
16-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	17,11	9.500,00	162.567,54	16,37	17,00	18,18	53.608,00
16-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	18,16	12.500,00	226.984,24	17,49	18,18	18,45	53.876,00
16-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	18,25	7.400,00	135.033,67	17,49	18,18	18,45	53.876,00
16-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	7,55	13.388,00	101.126,82	7,38	7,54	7,65	14.918,00
16-08-23	FIA RVA EMB IV	Venda	ITUB4	27,12	15.513,00	420.713,68	26,99	27,21	27,52	61.171,00
16-08-23	FIA RVA EMB IV	Venda	ITUB4	27,07	2.629,00	71.167,03	26,99	27,21	27,52	61.171,00
16-08-23	FIA RVA EMB IV	Venda	PRI03	46,36	5.817,00	269.682,26	45,82	46,59	47,55	25.901,00
16-08-23	FIA RVA EMB IV	Venda	PRI03	46,94	4.326,00	203.041,48	45,82	46,59	47,55	25.901,00
16-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RAIL3	23,05	9.485,00	218.629,25	22,68	22,94	23,12	26.349,00
16-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RAIL3	23,00	1.525,00	35.072,69	22,68	22,94	23,12	26.349,00
16-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RAIL3	22,98	2.047,00	47.035,09	22,68	22,94	23,12	26.349,00
17-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	47,50	3.000,00	142.498,96	47,18	47,48	47,70	31.615,00
17-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	29,91	11.100,00	332.026,08	29,63	29,97	30,79	37.029,00
17-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	29,74	600,00	17.844,11	29,63	29,97	30,79	37.029,00
17-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	34,20	7.300,00	249.689,55	33,72	34,37	34,77	46.642,00
17-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQT13	31,45	5.300,00	166.664,70	31,30	31,40	31,71	20.410,00
17-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	15,03	8.200,00	123.274,96	14,88	15,05	15,18	19.443,00
17-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	15,11	200,00	3.022,99	14,88	15,05	15,18	19.443,00
17-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	15,01	5.000,00	75.054,67	14,88	15,05	15,18	19.443,00
17-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	20,86	9.400,00	196.057,54	20,64	20,81	21,22	28.035,00
17-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	26,87	6.200,00	166.595,46	26,74	26,92	27,34	43.924,00
17-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	LTRE3	17,19	10.900,00	187.402,59	17,01	17,19	17,71	26.455,00
17-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	63,19	6.000,00	379.160,71	62,74	63,16	64,68	29.466,00
17-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	21,21	5.200,00	110.287,86	21,04	21,33	22,15	10.433,00
17-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	18,01	5.900,00	106.234,51	17,70	17,99	18,60	35.408,00
17-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	26,85	11.490,00	308.558,35	26,74	26,92	27,34	43.924,00
17-08-23	FIA RVA EMB IV	Venda	ITUB4	26,88	6.854,00	184.249,73	26,74	26,92	27,34	43.924,00
17-08-23	FIA RVA EMB IV	Venda	PRI03	45,38	2.529,00	114.766,02	45,14	45,76	46,99	29.781,00
17-08-23	FIA RVA EMB IV	Venda	PRI03	45,59	329,00	14.998,81	45,14	45,76	46,99	29.781,00
17-08-23	FIA RVA EMB IV	Venda	PRI03	45,75	10.327,00	472.425,51	45,14	45,76	46,99	29.781,00
17-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RAIL3	22,22	57,00	1.266,54	22,02	22,30	22,81	25.881,00
17-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RAIL3	22,27	8.906,00	198.368,16	22,02	22,30	22,81	25.881,00
17-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RAIL3	22,41	2.307,00	51.699,63	22,02	22,30	22,81	25.881,00
17-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RAIL3	22,34	1.888,00	42.186,27	22,02	22,30	22,81	25.881,00
18-08-23	FIA RVA EMB II	Compra	BRFS3	10,09	46.100,00	465.074,80	9,87	10,08	10,23	18.478,00
18-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	CCRO3	12,75	85.300,00	1.087.278,23	12,65	12,74	12,90	17.264,00
18-08-23	FIA RVA EMB II	Compra	CYRE3	23,54	16.700,00	393.129,63	22,91	23,50	23,74	16.217,00
18-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	HAPV3	4,41	257.700,00	1.137.415,33	4,34	4,56	4,70	40.266,00
18-08-23	FIA RVA EMB II	Compra	RENT3	63,00	10.300,00	648.947,71	62,08	62,98	63,62	24.923,00
18-08-23	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	50,60	22.000,00	1.113.198,48	50,16	50,77	51,50	21.782,00
18-08-23	FIA RVA EMB II	Compra	YDUQ3	22,86	8.700,00	198.889,90	21,76	22,47	23,05	15.916,00
18-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	23,12	1.600,00	36.997,62	22,86	23,16	23,32	11.528,00
18-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	13,38	2.100,00	28.099,05	13,01	13,33	13,44	18.915,00
18-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	47,87	1.200,00	57.440,12	47,33	47,77	48,12	26.280,00
18-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	29,92	2.500,00	74.803,20	29,44	29,83	30,00	12.728,00
18-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	30,78	1.500,00	46.175,58	29,82	30,68	30,92	24.829,00
18-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	3,87	14.900,00	57.618,88	3,82	3,87	3,92	20.172,00
18-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,78	5.700,00	72.855,80	12,51	12,78	12,92	8.613,00
18-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQT13	31,92	3.200,00	102.140,74	31,22	31,85	32,05	19.547,00
18-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	15,18	4.800,00	72.856,08	15,00	15,17	15,30	13.399,00
18-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,64	3.600,00	16.710,25	4,34	4,56	4,70	40.266,00
18-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	20,89	1.500,00	31.329,47	20,63	20,91	21,06	18.536,00
18-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	26,99	6.700,00	180.848,52	26,54	26,92	27,18	27.577,00
18-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	LTRE3	17,43	3.200,00	55.765,62	16,91	17,42	17,67	24.436,00
18-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	16,26	2.200,00	35.778,05	15,78	16,13	16,51	20.366,00
18-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	11,37	1.800,00	20.473,26	11,09	11,35	11,46	3.464,00
18-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	44,87	1.700,00	76.277,51	44,52	44,98	45,45	18.423,00
18-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	22,84	4.000,00	91.370,87	22,40	22,87	23,30	9.918,00
18-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	22,85	1.000,00	22.851,19	22,40	22,87	23,30	9.918,00
18-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	22,81	1.500,00	34.211,97	22,40	22,87	23,30	9.918,00
18-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	62,94	2.300,00	144.763,88	62,08	62,98	63,62	24.923,00
18-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	21,35	2.500,00	53.369,91	20,92	21,32	21,54	10.483,00
18-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	50,75	2.100,00	106.583,44	50,16	50,77	51,50	21.782,00
18-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	50,85	2.100,00	106.790,56	50,16	50,77	51,50	21.782,00



# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2023

## RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE AGOSTO DE 2023 À 31 DE AGOSTO 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
18-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	17,84	1.700,00	30.331,00	17,63	17,87	18,08	8.755,00
18-08-23	FIA RVA EMB IV	Venda	EQTL3	31,56	6.100,00	192.516,00	31,22	31,85	32,05	19.547,00
18-08-23	FIA RVA EMB IV	Venda	EQTL3	31,92	22.182,00	708.049,44	31,22	31,85	32,05	19.547,00
18-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	7,29	2.865,00	20.879,84	7,12	7,27	7,36	11.247,00
18-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	IGTI11	20,94	5.318,00	111.352,64	20,63	20,91	21,06	18.536,00
18-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	IGTI11	20,90	15.971,00	333.845,50	20,63	20,91	21,06	18.536,00
18-08-23	FIA RVA EMB IV	Venda	PRI03	44,94	6.616,00	297.327,04	44,52	44,98	45,45	18.423,00
18-08-23	FIA RVA EMB IV	Venda	PRI03	45,03	2.649,00	119.283,67	44,52	44,98	45,45	18.423,00
18-08-23	FIA RVA EMB IV	Venda	PRI03	45,05	1.311,00	59.063,86	44,52	44,98	45,45	18.423,00
18-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RAIL3	22,23	21.900,00	486.772,00	22,05	22,22	22,46	16.743,00
18-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	18,22	26.600,00	484.650,00	18,13	18,27	18,52	16.730,00
18-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	17,78	27.200,00	483.658,00	17,63	17,87	18,08	8.755,00
21-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	ARZ23	77,46	7.500,00	580.947,00	75,74	76,61	78,93	9.989,00
21-08-23	FIA RVA EMB II	Compra	BRFS3	9,93	41.400,00	411.296,79	9,80	9,91	10,11	22.099,00
21-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	CPL6	8,57	82.500,00	707.142,63	8,54	8,62	8,77	20.719,00
21-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	MOVI3	12,86	35.000,00	450.174,40	12,75	12,84	13,37	5.258,00
21-08-23	FIA RVA EMB II	Compra	PETR3	34,23	15.900,00	544.221,68	33,85	34,25	35,05	13.561,00
21-08-23	FIA RVA EMB II	Compra	PETR4	31,99	20.000,00	639.701,20	30,97	31,40	32,03	51.876,00
21-08-23	FIA RVA EMB II	Compra	SBSP3	58,74	11.400,00	669.586,12	58,30	58,71	59,88	7.085,00
21-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	22,96	700,00	16.072,09	22,82	22,94	23,39	23.423,00
21-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	13,21	1.000,00	13.211,34	13,09	13,21	13,49	25.577,00
21-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	13,61	3.100,00	42.181,32	13,56	13,60	13,70	9.265,00
21-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	47,53	600,00	28.518,22	47,31	47,63	48,05	22.053,00
21-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	29,78	800,00	23.823,62	29,60	29,77	29,97	12.473,00
21-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	30,42	800,00	24.333,92	30,21	30,44	30,97	18.317,00
21-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	3,80	5.100,00	19.401,53	3,77	3,80	3,85	18.449,00
21-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	33,95	1.600,00	54.321,68	33,74	33,97	34,55	24.743,00
21-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,45	2.700,00	33.609,72	12,31	12,43	12,74	13.345,00
21-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	31,64	1.900,00	60.108,10	31,47	31,62	32,04	19.418,00
21-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	15,23	400,00	6.093,03	15,01	15,27	15,38	13.093,00
21-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	15,28	3.800,00	58.080,51	15,01	15,27	15,38	13.093,00
21-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	15,23	1.100,00	16.751,35	15,01	15,27	15,38	13.093,00
21-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	20,82	1.900,00	39.549,46	20,67	20,82	21,03	18.080,00
21-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	20,79	900,00	18.710,54	20,67	20,82	21,03	18.080,00
21-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	LTRE3	17,10	1.600,00	27.362,58	16,90	17,10	17,47	32.521,00
21-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	15,83	1.000,00	15.828,81	15,65	15,83	16,30	20.664,00
21-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	44,90	2.200,00	98.787,24	44,32	44,93	46,10	17.654,00
21-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	21,97	14.500,00	318.615,37	21,74	21,99	22,20	21.320,00
21-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	22,88	1.000,00	22.878,25	22,51	22,92	23,48	13.360,00
21-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	22,91	5.400,00	123.698,67	22,51	22,92	23,48	13.360,00
21-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	62,20	1.500,00	93.306,56	61,92	62,29	62,90	18.056,00
21-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	21,79	1.000,00	21.791,09	21,37	21,78	21,98	9.706,00
21-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	50,22	1.000,00	50.222,22	49,83	50,20	50,84	11.543,00
21-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	17,73	1.000,00	17.730,86	17,58	17,72	18,15	20.026,00
21-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	7,26	13.405,00	97.257,10	7,22	7,26	7,36	8.112,00
21-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	IGTI11	20,80	3.359,00	69.867,20	20,67	20,82	21,03	18.080,00
21-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	IGTI11	20,83	9.282,00	193.367,44	20,67	20,82	21,03	18.080,00
21-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	IGTI11	20,78	8.947,00	185.939,62	20,67	20,82	21,03	18.080,00
21-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RAIL3	22,05	4.154,00	91.586,28	21,74	21,99	22,20	21.320,00
22-08-23	FIA RVA EMB II	Compra	B3SA3	13,82	23.600,00	326.256,00	13,54	13,77	13,87	34.022,00
22-08-23	FIA RVA EMB II	Compra	BPAC11	31,37	4.700,00	147.420,00	30,80	31,19	31,53	22.932,00
22-08-23	FIA RVA EMB II	Compra	EGIE3	41,23	5.900,00	243.244,39	40,83	41,13	41,58	6.495,00
22-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	JBSS3	18,47	18.400,00	339.849,65	18,36	18,52	18,78	15.575,00
22-08-23	FIA RVA EMB II	Compra	RAIL3	22,69	12.000,00	272.239,00	22,12	22,67	22,88	17.808,00
22-08-23	FIA RVA EMB II	Compra	SBSP3	59,91	1.500,00	89.860,00	58,75	59,65	60,18	9.810,00
22-08-23	FIA RVA EMB II	Compra	VBBR3	18,64	22.600,00	421.180,97	17,60	18,54	18,94	31.604,00
22-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	23,42	1.000,00	23.424,02	22,93	23,41	23,62	10.708,00
22-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	12,95	1.300,00	16.832,44	12,80	12,99	13,27	16.313,00
22-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	13,65	2.500,00	34.136,43	13,55	13,64	13,71	6.701,00
22-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	47,68	700,00	33.377,52	47,08	47,71	48,08	25.779,00
22-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	29,92	2.800,00	83.784,76	29,70	29,93	30,13	10.664,00
22-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	31,15	900,00	28.036,06	30,80	31,19	31,53	22.932,00
22-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	3,80	6.800,00	25.813,85	3,77	3,80	3,84	28.401,00
22-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	33,98	1.900,00	64.566,68	33,79	34,04	34,28	18.370,00
22-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,35	1.700,00	20.995,00	12,24	12,42	12,54	11.213,00
22-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,37	2.400,00	29.688,00	12,24	12,42	12,54	11.213,00
22-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,37	2.600,00	32.155,99	12,24	12,42	12,54	11.213,00
22-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,44	2.800,00	34.818,53	12,24	12,42	12,54	11.213,00
22-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	31,79	3.000,00	95.376,37	31,58	31,80	32,02	14.017,00
22-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	15,48	3.800,00	58.831,11	15,34	15,49	15,62	12.251,00
22-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,57	2.700,00	12.333,27	4,48	4,56	4,62	31.125,00
22-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	21,09	1.000,00	21.088,43	20,85	21,07	21,40	9.289,00
22-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	27,08	4.900,00	132.685,96	26,93	27,18	27,35	28.168,00
22-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	LTRE3	17,26	2.200,00	37.975,13	17,09	17,25	17,41	14.357,00
22-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	NINJ3	3,76	400,00	1.504,23	3,65	3,77	3,82	347,00
22-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	15,98	2.500,00	39.954,90	15,71	15,87	16,05	17.497,00
22-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	15,91	500,00	7.953,60	15,71	15,87	16,05	17.497,00
22-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	11,34	1.100,00	12.478,95	11,22	11,39	11,50	3.866,00
22-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	45,13	1.400,00	63.178,52	44,65	45,08	45,46	15.817,00
22-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,62	6.400,00	144.754,24	22,12	22,67	22,88	17.808,00
22-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	22,86	2.600,00	59.431,12	22,57	22,89	23,24	10.238,00
22-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	22,82	1.200,00	27.383,64	22,57	22,89	23,24	10.238,00
22-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	63,61	1.100,00	69.975,62	62,68	64,13	64,78	24.319,00
22-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	22,90	1.200,00	27.474,73	22,07	22,89	23,32	8.817,00
22-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	49,90	1.300,00	64.866,01	49,50	49,87	50,38	13.107,00
22-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	18,42	1.200,00	22.105,00	17,60	18,54	18,94	31.604,00
22-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	18,51	11.100,00	205.427,40	17,60	18,54	18,94	31.604,00

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2023

## RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE AGOSTO DE 2023 À 31 DE AGOSTO 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
22-08-23	FIA RVA EMB IV	Venda	ALSO3	23,40	8.481,00	198.455,40	22,93	23,41	23,62	10.708,00
22-08-23	FIA RVA EMB IV	Venda	PRI03	45,16	2.428,00	109.652,13	44,65	45,08	45,46	15.817,00
22-08-23	FIA RVA EMB IV	Venda	PRI03	45,00	1.798,00	80.910,00	44,65	45,08	45,46	15.817,00
22-08-23	FIA RVA EMB IV	Venda	PRI03	44,93	1.402,00	62.996,60	44,65	45,08	45,46	15.817,00
23-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	JBSS3	18,49	36.900,00	682.300,01	18,08	18,41	18,74	22.339,00
23-08-23	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	27,19	10.800,00	293.633,46	26,98	27,19	27,33	12.969,00
23-08-23	FIA RVA EMB II	Compra	RENT3	66,50	6.900,00	458.855,90	64,27	66,20	67,03	28.665,00
23-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	24,12	700,00	16.880,76	23,27	23,92	24,28	18.199,00
23-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	12,81	1.100,00	14.091,00	12,72	12,92	13,07	22.170,00
23-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	12,81	5.700,00	73.018,03	12,72	12,92	13,07	22.170,00
23-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	13,71	1.400,00	19.191,70	13,62	13,67	13,74	5.673,00
23-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	13,66	3.300,00	45.064,44	13,62	13,67	13,74	5.673,00
23-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	48,06	500,00	24.031,69	47,63	48,01	48,48	23.505,00
23-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	30,09	1.300,00	39.120,87	29,89	30,05	30,19	12.726,00
23-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	32,35	700,00	22.641,89	31,46	32,30	32,87	29.885,00
23-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	CIEL3	3,76	16.900,00	63.478,38	3,73	3,76	3,84	23.951,00
23-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	36,19	1.700,00	61.523,42	34,29	35,85	36,74	51.865,00
23-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,54	1.300,00	16.305,81	12,41	12,54	12,64	13.043,00
23-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,50	2.000,00	25.007,71	12,41	12,54	12,64	13.043,00
23-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	15,39	2.600,00	40.008,67	15,33	15,43	15,55	15.720,00
23-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	15,41	800,00	12.328,72	15,33	15,43	15,55	15.720,00
23-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	15,43	3.200,00	49.378,46	15,33	15,43	15,55	15.720,00
23-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	21,34	2.500,00	53.355,37	21,00	21,30	21,48	17.451,00
23-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	LTRE3	17,27	1.500,00	25.897,64	17,00	17,25	17,44	23.656,00
23-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	NINJ3	3,79	300,00	1.137,00	3,75	3,79	3,86	179,00
23-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	23,32	13.400,00	312.427,96	22,83	23,28	23,45	23.252,00
23-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	23,43	800,00	18.740,56	22,59	23,32	23,78	8.142,00
23-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	23,14	1.800,00	41.651,93	22,59	23,32	23,78	8.142,00
23-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	66,65	1.000,00	66.646,40	64,27	66,20	67,03	28.665,00
23-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	23,58	800,00	18.866,97	23,09	23,62	23,85	8.654,00
23-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	49,33	900,00	44.399,98	49,14	49,45	49,92	18.216,00
23-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	18,86	700,00	13.199,59	18,62	18,97	19,44	44.373,00
23-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	19,02	4.300,00	81.800,35	18,62	18,97	19,44	44.373,00
23-08-23	FIA RVA EMB IV	Venda	ALSO3	23,72	8.322,00	197.425,93	23,27	23,92	24,28	18.199,00
23-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ELET3	35,93	2.947,00	105.885,15	34,29	35,85	36,74	51.865,00
23-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ELET3	36,00	2.596,00	93.444,40	34,29	35,85	36,74	51.865,00
23-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ELET3	36,12	1.985,00	71.698,20	34,29	35,85	36,74	51.865,00
23-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ELET3	36,21	5.358,00	193.988,88	34,29	35,85	36,74	51.865,00
23-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ELET3	36,70	6.744,00	247.504,80	34,29	35,85	36,74	51.865,00
23-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ELET6	39,52	7.231,00	285.799,43	37,76	39,26	40,11	14.728,00
23-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ELET6	39,86	1.136,00	45.284,32	37,76	39,26	40,11	14.728,00
23-08-23	FIA RVA EMB IV	Venda	EQLT3	31,90	6.228,00	198.673,20	31,70	31,92	32,07	16.016,00
23-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	IGTI11	21,37	3.955,00	84.503,23	21,00	21,30	21,48	17.451,00
23-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	IGTI11	21,35	3.629,00	77.482,25	21,00	21,30	21,48	17.451,00
23-08-23	FIA RVA EMB IV	Venda	RENT3	65,90	1.027,00	67.679,30	64,27	66,20	67,03	28.665,00
23-08-23	FIA RVA EMB IV	Venda	RENT3	65,87	614,00	40.441,28	64,27	66,20	67,03	28.665,00
23-08-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	HBRH11	94,96	9.477,00	899.982,17	92,50	94,95	94,97	24,00
24-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	24,03	900,00	21.628,41	23,91	24,10	24,33	12.975,00
24-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	12,97	10.800,00	140.078,77	12,84	12,95	13,10	16.332,00
24-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	13,80	4.600,00	63.462,95	13,74	13,80	13,86	7.587,00
24-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	47,50	700,00	33.246,59	47,33	47,62	48,10	17.403,00
24-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	30,28	800,00	24.226,40	30,10	30,30	30,44	9.712,00
24-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	32,72	900,00	29.451,03	32,43	32,75	33,04	26.804,00
24-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	3,76	11.400,00	42.835,59	3,75	3,76	3,80	15.814,00
24-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	37,08	1.900,00	70.461,24	36,22	37,14	37,65	45.251,00
24-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,62	3.800,00	47.952,51	12,40	12,65	12,87	9.362,00
24-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	32,19	2.800,00	90.121,31	31,92	32,17	32,42	11.169,00
24-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,68	2.400,00	11.220,62	4,63	4,68	4,78	26.528,00
24-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	21,29	2.600,00	55.350,25	21,08	21,30	21,42	13.853,00
24-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	27,24	3.400,00	92.602,15	27,14	27,32	27,60	26.899,00
24-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	LTRE3	17,12	1.900,00	32.534,05	16,75	17,05	17,55	33.203,00
24-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	NINJ3	3,77	3.600,00	13.571,16	3,64	3,77	3,84	537,00
24-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	15,57	900,00	14.014,50	15,46	15,59	15,96	16.328,00
24-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	11,52	1.000,00	11.524,56	11,41	11,52	11,68	4.117,00
24-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	46,14	800,00	36.915,44	45,40	46,06	46,49	15.616,00
24-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	23,10	9.000,00	207.879,62	22,96	23,12	23,43	15.745,00
24-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	23,62	1.100,00	25.983,63	23,37	23,58	23,91	6.533,00
24-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	23,69	1.200,00	28.428,77	23,37	23,58	23,91	6.533,00
24-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	65,67	600,00	39.400,17	65,48	65,81	66,56	21.112,00
24-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	23,70	1.100,00	26.068,79	23,49	23,64	23,88	7.737,00
24-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	49,09	1.200,00	58.911,94	48,81	49,16	49,64	11.329,00
24-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	18,69	1.000,00	18.690,37	18,40	18,67	18,86	19.408,00
24-08-23	FIA RVA EMB IV	Venda	ALSO3	24,19	81,00	1.959,44	23,91	24,10	24,33	12.975,00
24-08-23	FIA RVA EMB IV	Venda	ALSO3	24,11	1.845,00	44.483,01	23,91	24,10	24,33	12.975,00
24-08-23	FIA RVA EMB IV	Venda	ALSO3	24,22	310,00	7.509,59	23,91	24,10	24,33	12.975,00
24-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ELET3	37,17	695,00	25.834,27	36,22	37,14	37,65	45.251,00
24-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ELET3	37,18	3.039,00	112.982,99	36,22	37,14	37,65	45.251,00
24-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ELET3	36,95	1.738,00	64.216,81	36,22	37,14	37,65	45.251,00
24-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ELET3	36,98	4.262,00	157.608,76	36,22	37,14	37,65	45.251,00
24-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ELET6	40,64	997,00	40.520,33	39,83	40,58	41,16	12.880,00
24-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ELET6	40,50	666,00	26.971,24	39,83	40,58	41,16	12.880,00
24-08-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	BTGL13	101,00	100,00	10.100,00	102,98	103,38	104,33	8.956,00
25-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	BBDC4	14,83	33.400,00	495.322,00	14,74	14,85	15,10	33.014,00
25-08-23	FIA RVA EMB II	Compra	CPL6E	8,82	83.100,00	733.231,40	8,68	8,79	8,87	26.808,00
25-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	ENGI11	46,86	13.900,00	651.395,05	46,75	47,16	47,81	5.243,00
25-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	MGLU3	2,94	459.100,00	1.348.512,84	2,92	2,95	3,02	24.617,00
25-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	NTCO3	15,31	45.500,00	696.597,08	15,15	15,31	15,53	20.884,00

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2023

## RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE AGOSTO DE 2023 À 31 DE AGOSTO DE 2023



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
25-08-23	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	27,06	18.000,00	487.107,03	26,83	27,02	27,35	10.433,00
25-08-23	FIA RVA EMB II	Compra	RENT3	63,08	8.500,00	536.169,85	62,77	63,38	65,68	24.031,00
25-08-23	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	49,90	13.000,00	648.700,00	49,12	49,65	50,13	10.942,00
25-08-23	FIA RVA EMB II	Compra	YDUQ3	20,92	24.500,00	512.483,46	20,70	21,11	22,05	17.912,00
25-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	23,83	700,00	16.683,56	23,69	23,87	24,22	10.774,00
25-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	12,43	4.600,00	57.178,00	12,32	12,49	12,90	25.258,00
25-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	12,46	16.700,00	208.162,26	12,32	12,49	12,90	25.258,00
25-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	13,78	1.800,00	24.804,17	13,71	13,80	13,94	7.706,00
25-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	46,82	500,00	23.410,50	46,41	46,90	47,70	23.425,00
25-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	30,38	600,00	18.229,62	30,26	30,41	30,59	12.665,00
25-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	31,80	700,00	22.257,44	31,57	31,99	32,76	22.216,00
25-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	3,70	4.900,00	18.148,52	3,67	3,70	3,78	13.975,00
25-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	36,68	1.400,00	51.356,87	36,25	36,58	37,08	21.049,00
25-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,48	2.700,00	33.693,25	12,42	12,48	12,73	8.149,00
25-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	31,68	2.100,00	66.530,94	31,55	31,74	32,37	12.883,00
25-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	20,93	1.900,00	39.769,78	20,84	20,98	21,63	14.415,00
25-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	26,85	800,00	21.477,94	26,67	26,89	27,30	27.347,00
25-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	26,87	3.100,00	83.287,42	26,67	26,89	27,30	27.347,00
25-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	LTRE3	16,55	1.600,00	26.481,39	16,41	16,56	16,83	23.622,00
25-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	15,31	1.000,00	15.305,59	15,15	15,31	15,53	20.884,00
25-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,59	8.600,00	194.263,49	22,37	22,58	23,10	18.883,00
25-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,63	1.900,00	43.002,45	22,37	22,58	23,10	18.883,00
25-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,54	9.800,00	220.860,89	22,37	22,58	23,10	18.883,00
25-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	23,19	800,00	18.553,47	22,99	23,20	23,69	9.167,00
25-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	63,32	2.400,00	151.978,69	62,77	63,38	65,68	24.031,00
25-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	22,40	900,00	20.155,75	21,90	22,56	23,69	15.165,00
25-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	49,55	1.000,00	49.545,44	49,12	49,65	50,13	10.942,00
25-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	18,48	800,00	14.785,52	18,37	18,54	18,89	19.793,00
25-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ELET3	36,65	416,00	15.246,01	36,25	36,58	37,08	21.049,00
25-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ELET3	36,74	7.640,00	280.713,93	36,25	36,58	37,08	21.049,00
25-08-23	FIA RVA EMB IV	Venda	EQLT3	31,68	1.521,00	48.192,75	31,55	31,74	32,37	12.883,00
25-08-23	FIA RVA EMB IV	Venda	EQLT3	31,80	436,00	13.864,94	31,55	31,74	32,37	12.883,00
25-08-23	FIA RVA EMB IV	Venda	EQLT3	31,66	2.792,00	88.407,12	31,55	31,74	32,37	12.883,00
25-08-23	FIA RVA EMB IV	Venda	EQLT3	31,67	987,00	31.262,22	31,55	31,74	32,37	12.883,00
25-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	7,25	19.717,00	142.931,25	7,19	7,25	7,35	5.735,00
25-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	7,23	2.464,00	17.807,68	7,19	7,25	7,35	5.735,00
28-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	B3SA3	13,53	28.900,00	391.017,00	13,37	13,50	13,64	28.433,00
28-08-23	FIA RVA EMB II	Compra	BBDC4	15,34	15.400,00	236.236,00	14,79	15,13	15,43	33.093,00
28-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	ENGI11	47,03	5.500,00	258.665,00	46,40	46,86	47,04	6.067,00
28-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	HAPV3	4,54	51.200,00	232.448,00	4,51	4,55	4,65	27.042,00
28-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	ITSA2	2,90	6.923,00	20.076,70	2,83	2,92	3,06	2.174,00
28-08-23	FIA RVA EMB II	Compra	ITUB4	27,70	10.600,00	293.648,32	26,72	27,42	27,99	40.989,00
28-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	MOVI3	13,01	27.400,00	356.338,04	12,79	13,00	13,22	5.331,00
28-08-23	FIA RVA EMB II	Compra	ONCO3	11,90	19.900,00	236.810,00	11,69	11,85	11,98	4.087,00
28-08-23	FIA RVA EMB II	Compra	ONCO3	11,91	39.600,00	471.652,12	11,69	11,85	11,98	4.087,00
28-08-23	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	26,92	8.000,00	215.360,00	26,63	26,82	27,12	7.860,00
28-08-23	FIA RVA EMB II	Compra	VALE3	62,96	3.500,00	220.360,00	62,27	62,96	63,27	32.982,00
28-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	23,68	1.000,00	23.682,45	23,49	23,70	23,88	9.592,00
28-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	12,09	4.100,00	49.584,85	12,00	12,11	12,44	25.290,00
28-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	12,09	1.200,00	14.508,07	12,00	12,11	12,44	25.290,00
28-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	13,76	2.600,00	35.773,12	13,68	13,76	13,86	5.194,00
28-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	47,77	700,00	33.438,44	46,95	47,81	48,50	25.086,00
28-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	30,56	900,00	27.501,44	30,39	30,57	30,77	9.376,00
28-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	32,20	1.000,00	32.198,94	31,98	32,34	32,83	14.880,00
28-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	3,72	7.200,00	26.759,76	3,68	3,71	3,75	16.810,00
28-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	36,44	2.200,00	80.172,65	36,14	36,46	36,75	16.303,00
28-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,25	3.900,00	47.783,52	12,16	12,29	12,45	12.890,00
28-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	31,50	3.000,00	94.507,88	31,38	31,57	31,86	12.323,00
28-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	14,88	700,00	10.416,00	14,76	14,89	15,05	10.351,00
28-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,55	2.600,00	11.830,92	4,51	4,55	4,65	27.042,00
28-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	20,91	600,00	12.543,04	20,81	21,07	21,27	9.512,00
28-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	21,08	2.300,00	48.483,75	20,81	21,07	21,27	9.512,00
28-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	LTRE3	16,61	2.200,00	36.537,61	16,45	16,66	16,86	21.948,00
28-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	NINJ3	4,01	1.800,00	7.221,02	3,78	3,98	4,15	2.710,00
28-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	NINJ3	3,97	4.300,00	17.080,52	3,78	3,98	4,15	2.710,00
28-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	15,61	1.400,00	21.856,50	15,47	15,70	16,26	31.805,00
28-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	11,83	1.100,00	13.016,06	11,69	11,85	11,98	4.087,00
28-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	PETRA	32,16	15.600,00	501.675,70	31,86	32,16	32,34	37.485,00
28-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRIQ3	46,61	500,00	23.304,17	46,20	46,63	46,80	12.625,00
28-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRIQ3	46,61	300,00	13.982,24	46,20	46,63	46,80	12.625,00
28-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,75	1.800,00	40.957,81	22,56	22,75	22,95	18.455,00
28-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,75	2.800,00	63.700,00	22,56	22,75	22,95	18.455,00
28-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,64	2.600,00	58.864,00	22,56	22,75	22,95	18.455,00
28-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,73	10.600,00	240.941,24	22,56	22,75	22,95	18.455,00
28-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	22,95	1.100,00	25.249,06	22,78	22,96	23,51	8.295,00
28-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	22,90	1.200,00	27.474,79	22,78	22,96	23,51	8.295,00
28-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	62,49	1.000,00	62.492,89	62,12	62,59	63,32	14.975,00
28-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	21,65	1.000,00	21.654,18	21,44	21,80	22,33	9.672,00
28-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	21,60	1.000,00	21.600,00	21,44	21,80	22,33	9.672,00
28-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	21,76	1.300,00	28.290,30	21,44	21,80	22,33	9.672,00
28-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	7,97	1.300,00	10.365,48	7,87	8,02	8,24	31.993,00
28-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	50,93	1.300,00	65.040,38	49,56	50,06	50,37	15.358,00
28-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	18,57	1.200,00	22.289,25	18,32	18,58	18,83	13.395,00
28-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ELET3	36,43	7.967,00	290.265,75	36,14	36,46	36,75	16.303,00
28-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ELET3	36,30	648,00	23.522,40	36,14	36,46	36,75	16.303,00
28-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	7,15	6.968,00	49.821,20	7,03	7,13	7,28	11.597,00
28-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	7,13	11.193,00	79.787,06	7,03	7,13	7,28	11.597,00

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2023

## RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE AGOSTO DE 2023 À 31 DE AGOSTO DE 2023



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
28-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	7,15	14.447,00	103.345,57	7,03	7,13	7,28	11.597,00
28-08-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	EXCO32	14,21	8.054,00	114.447,34	12,52	13,53	14,21	26.737,00
29-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	B3SA3	13,58	46.600,00	632.863,40	13,37	13,52	13,71	32.429,00
29-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	HAPV3	4,55	91.300,00	415.298,13	4,48	4,56	4,65	19.183,00
29-08-23	FIA RVA EMB II	Compra	VALE3	64,03	9.300,00	595.519,30	63,23	64,42	65,03	60.197,00
29-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	23,79	1.400,00	33.300,48	23,47	23,80	24,01	11.492,00
29-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	12,03	11.200,00	134.718,01	11,84	12,01	12,30	19.760,00
29-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	13,91	3.500,00	48.687,31	13,83	13,91	14,00	5.084,00
29-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	48,72	1.000,00	48.720,21	48,33	48,77	49,24	27.619,00
29-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	30,97	1.200,00	37.158,00	30,73	30,98	31,22	15.517,00
29-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	32,93	1.300,00	42.811,00	32,40	32,96	33,20	14.441,00
29-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	3,80	9.400,00	35.703,13	3,73	3,80	3,84	13.031,00
29-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	36,47	2.800,00	102.104,07	36,28	36,55	37,00	16.794,00
29-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENAT3	15,38	900,00	13.842,00	15,18	15,34	15,50	8.527,00
29-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENAT3	15,32	13.500,00	206.868,54	15,18	15,34	15,50	8.527,00
29-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENAT3	15,35	3.900,00	59.861,74	15,18	15,34	15,50	8.527,00
29-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,37	5.100,00	63.110,65	12,25	12,38	12,47	7.407,00
29-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	32,02	4.100,00	131.275,71	31,52	32,03	32,27	15.109,00
29-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	15,00	600,00	8.997,62	14,87	15,00	15,24	15.300,00
29-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	14,95	1.500,00	22.425,00	14,87	15,00	15,24	15.300,00
29-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	21,33	3.900,00	83.197,67	21,06	21,31	21,49	12.078,00
29-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	28,33	5.800,00	164.297,62	27,89	28,32	28,59	57.626,00
29-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	LTREN3	16,71	2.900,00	48.467,70	16,44	16,68	16,96	21.974,00
29-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	NINJ3	4,16	1.000,00	4.161,06	3,81	4,10	4,31	958,00
29-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	NINJ3	4,15	1.300,00	5.389,90	3,81	4,10	4,31	958,00
29-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	15,61	2.000,00	31.214,69	15,44	15,61	15,80	11.719,00
29-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	11,96	900,00	10.765,62	11,77	11,97	12,10	4.240,00
29-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	PETRA	32,21	9.200,00	296.367,37	31,99	32,24	32,50	73.495,00
29-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	45,88	300,00	13.762,76	45,63	46,06	47,18	23.936,00
29-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,94	9.300,00	213.353,49	22,80	22,99	23,14	20.784,00
29-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	23,00	2.700,00	62.100,00	22,80	22,99	23,14	20.784,00
29-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,97	3.600,00	82.699,98	22,80	22,99	23,14	20.784,00
29-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	23,14	600,00	13.884,00	22,74	23,11	23,29	9.672,00
29-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	23,19	2.100,00	48.706,13	22,74	23,11	23,29	9.672,00
29-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	23,18	100,00	2.317,74	22,74	23,11	23,29	9.672,00
29-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	23,12	1.600,00	36.989,63	22,74	23,11	23,29	9.672,00
29-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	63,37	300,00	19.011,00	62,95	63,54	64,28	17.624,00
29-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	21,82	1.400,00	30.542,89	21,56	21,87	22,14	10.937,00
29-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	51,04	2.700,00	137.821,01	50,30	50,94	51,19	9.425,00
29-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	50,86	1.800,00	91.545,93	50,30	50,94	51,19	9.425,00
29-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	18,90	1.400,00	26.465,71	18,75	18,96	19,09	13.517,00
29-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ELET3	36,46	11.331,00	413.174,82	36,28	36,55	37,00	16.794,00
29-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	7,13	10.014,00	71.401,86	7,07	7,16	7,25	11.318,00
29-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	7,16	8.460,00	60.597,66	7,07	7,16	7,25	11.318,00
29-08-23	FIA RVA EMB IV	Venda	PRI03	45,95	6.435,00	295.705,59	45,63	46,06	47,18	23.936,00
29-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	RAIL3	22,99	21.511,00	494.592,80	22,80	22,99	23,14	20.784,00
30-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	ABEV3	14,28	26.100,00	372.621,00	14,17	14,25	14,34	28.749,00
30-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	ARZZ3	72,53	6.900,00	500.487,85	71,94	73,17	74,40	6.722,00
30-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	B3SA3	13,36	34.100,00	455.511,00	13,17	13,32	13,64	33.654,00
30-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	B3SA3	13,41	60.600,00	812.778,61	13,17	13,32	13,64	33.654,00
30-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	BBAS3	48,39	12.000,00	580.677,00	47,80	48,12	48,88	16.690,00
30-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	BBD4	15,31	30.600,00	468.394,00	15,12	15,25	15,54	27.720,00
30-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	BBSE3	30,81	4.000,00	123.245,00	30,60	30,81	31,20	12.409,00
30-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	BPAC11	32,89	7.300,00	240.111,00	32,67	32,90	33,46	11.249,00
30-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	BRKM5	22,70	1.600,00	36.325,00	22,38	22,65	22,94	8.065,00
30-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	CPFE3	34,79	1.100,00	38.274,00	34,62	34,77	35,08	3.775,00
30-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	CSMG3	18,25	11.800,00	215.350,00	18,23	18,38	18,69	4.928,00
30-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	CSMG3	18,39	20.200,00	371.419,78	18,23	18,38	18,69	4.928,00
30-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	CYRE3	23,26	1.600,00	37.220,00	23,00	23,20	23,70	9.520,00
30-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	ELET3	36,69	11.900,00	436.627,00	36,24	36,58	36,99	13.925,00
30-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	ELET6	39,89	1.600,00	63.820,00	39,50	39,92	40,10	3.369,00
30-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	ENEV3	12,13	9.400,00	114.064,00	12,05	12,13	12,46	12.540,00
30-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	ENGI11	47,07	1.400,00	65.892,00	46,70	47,03	47,74	7.243,00
30-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	EQLT3	32,61	6.700,00	218.490,00	32,22	32,50	32,81	19.360,00
30-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	GOAU4	11,95	4.000,00	47.787,00	11,88	11,95	12,06	5.655,00
30-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	HAPV3	4,57	25.700,00	117.489,00	4,47	4,55	4,69	28.419,00
30-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	ITSA4	9,44	30.200,00	285.228,00	9,39	9,45	9,60	17.734,00
30-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	ITSA4	9,46	29.900,00	282.970,00	9,39	9,45	9,60	17.734,00
30-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	ITUB4	28,08	46.500,00	1.305.923,00	27,58	27,80	28,35	29.883,00
30-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	JBSS3	18,86	25.300,00	477.214,00	18,74	18,87	19,09	12.000,00
30-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	LTREN3	16,63	5.700,00	94.807,00	16,43	16,60	16,81	18.309,00
30-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	MRVE3	11,74	47.100,00	552.724,81	11,59	11,69	12,05	15.783,00
30-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	MULT3	25,68	17.500,00	449.352,00	25,51	25,64	26,20	14.976,00
30-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	NTCO3	15,49	38.200,00	591.708,00	15,33	15,45	15,71	12.440,00
30-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	PETR3	35,56	17.800,00	632.912,00	35,44	35,56	35,74	8.235,00
30-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	PETRA	32,42	40.000,00	1.296.610,00	32,30	32,51	32,70	47.804,00
30-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	PRI03	45,77	4.900,00	224.250,00	45,44	45,77	46,13	17.168,00
30-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	RAIL3	22,72	7.300,00	165.826,00	22,56	22,69	22,87	17.726,00
30-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	RDOR3	28,90	6.600,00	190.731,00	28,51	28,86	29,74	13.093,00
30-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	RENT3	63,75	4.900,00	312.355,00	63,07	63,62	64,10	12.534,00
30-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	SBSP3	59,17	2.000,00	118.338,00	58,60	59,05	59,78	7.261,00
30-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	SUZB3	51,06	4.300,00	219.537,00	50,68	50,97	51,88	11.262,00
30-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	TOTS3	28,63	3.100,00	88.755,00	28,40	28,59	28,98	11.814,00
30-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	VBBR3	19,06	6.700,00	127.687,00	18,90	19,03	19,25	16.440,00
30-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	WEGE3	36,44	7.500,00	273.283,00	36,11	36,38	36,71	10.760,00
30-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	YDUQ3	20,77	1.800,00	37.379,00	20,47	20,78	21,09	16.644,00
30-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALSO3	23,61	1.000,00	23.614,66	23,38	23,65	24,20	15.160,00

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2023

## RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE AGOSTO DE 2023 À 31 DE AGOSTO DE 2023



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
30-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	11,85	4.100,00	48.597,60	11,80	11,85	12,03	29.178,00
30-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	11,87	1.500,00	17.801,14	11,80	11,85	12,03	29.178,00
30-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	14,00	2.600,00	36.399,64	13,93	14,00	14,09	6.143,00
30-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	48,14	800,00	38.512,00	47,80	48,12	48,88	16.690,00
30-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	30,81	900,00	27.728,64	30,60	30,81	31,20	12.409,00
30-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	32,91	1.100,00	36.199,44	32,67	32,90	33,46	11.249,00
30-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	3,80	7.300,00	27.733,12	3,78	3,80	3,87	12.715,00
30-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	36,65	2.100,00	76.964,65	36,24	36,58	36,99	13.925,00
30-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENAT3	15,73	1.900,00	29.885,49	15,38	15,79	16,03	7.645,00
30-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENAT3	15,57	800,00	12.456,00	15,38	15,79	16,03	7.645,00
30-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,11	900,00	10.898,12	12,05	12,13	12,46	12.540,00
30-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,12	1.900,00	23.025,55	12,05	12,13	12,46	12.540,00
30-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,12	1.000,00	12.122,45	12,05	12,13	12,46	12.540,00
30-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	32,42	800,00	25.932,29	32,22	32,50	32,81	19.360,00
30-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	32,55	1.600,00	52.080,19	32,22	32,50	32,81	19.360,00
30-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	32,52	100,00	3.251,55	32,22	32,50	32,81	19.360,00
30-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	32,56	3.100,00	100.946,09	32,22	32,50	32,81	19.360,00
30-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	32,44	800,00	25.952,11	32,22	32,50	32,81	19.360,00
30-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	15,05	1.000,00	15.051,84	14,93	15,02	15,26	11.193,00
30-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,57	3.700,00	16.908,26	4,47	4,55	4,69	28.419,00
30-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	21,21	2.900,00	61.518,37	21,05	21,20	21,53	6.206,00
30-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	27,82	3.500,00	97.365,13	27,58	27,80	28,35	29.883,00
30-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	LTRE3	16,61	2.300,00	38.212,26	16,43	16,60	16,81	18.309,00
30-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	15,48	1.500,00	23.219,59	15,33	15,45	15,71	12.440,00
30-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETRA	32,55	400,00	13.021,00	32,30	32,51	32,70	47.804,00
30-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRIQ3	45,79	400,00	18.315,77	45,44	45,77	46,13	17.168,00
30-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,74	400,00	9.096,23	22,56	22,69	22,87	17.726,00
30-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,72	900,00	20.449,88	22,56	22,69	22,87	17.726,00
30-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	23,29	1.300,00	30.272,93	23,14	23,28	23,55	7.479,00
30-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	63,68	900,00	57.311,07	63,07	63,62	64,10	12.534,00
30-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	SCAR3	23,01	300,00	6.902,00	22,77	23,28	23,49	29,00
30-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	21,23	4.600,00	97.642,82	20,99	21,33	22,23	11.823,00
30-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	51,01	2.300,00	117.318,70	50,68	50,97	51,88	11.262,00
30-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	50,78	100,00	5.078,34	50,68	50,97	51,88	11.262,00
30-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	51,07	1.400,00	71.492,62	50,68	50,97	51,88	11.262,00
30-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	19,04	1.200,00	22.852,14	18,90	19,03	19,25	16.440,00
30-08-23	FIA RVA EMB IV	Venda	EQTL3	32,45	5.211,00	169.081,95	32,22	32,50	32,81	19.360,00
30-08-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	XPLG11	112,50	8,00	900,00	111,65	112,46	112,69	4.193,00
31-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	CYRE3	22,44	42.400,00	951.456,00	22,38	22,58	23,11	15.223,00
31-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	ENGI11	46,13	21.000,00	968.764,00	45,91	46,14	46,95	7.272,00
31-08-23	FIA RVA EMB II	Venda	HAPV3	4,26	147.500,00	628.350,00	4,23	4,31	4,49	33.254,00
31-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	11,72	3.300,00	38.683,64	11,49	11,70	12,00	36.317,00
31-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENAT3	15,80	2.900,00	45.807,71	15,50	15,93	16,35	7.414,00
31-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	14,73	2.900,00	42.718,49	14,65	14,80	15,05	15.864,00
31-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	14,70	200,00	2.940,00	14,65	14,80	15,05	15.864,00
31-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	14,75	1.100,00	16.225,00	14,65	14,80	15,05	15.864,00
31-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	20,63	3.400,00	70.129,18	20,47	20,63	21,18	14.284,00
31-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	NINJ3	4,27	500,00	2.135,00	4,14	4,26	4,35	424,00
31-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	NINJ3	4,26	13.500,00	57.554,99	4,14	4,26	4,35	424,00
31-08-23	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	12,10	3.200,00	38.720,00	11,65	11,98	12,10	7.458,00
31-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,41	6.100,00	136.683,13	22,20	22,38	22,62	22.360,00
31-08-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	20,59	6.500,00	133.865,99	20,22	20,67	21,19	21.950,00
31-08-23	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	13,85	19.119,00	264.791,27	13,61	13,75	14,00	5.073,00
31-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ELET3	35,59	5.483,00	195.122,49	35,20	35,49	36,37	17.754,00
31-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	6,90	62.317,00	430.078,22	6,70	6,88	7,25	17.329,00
31-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	6,95	770,00	5.351,63	6,70	6,88	7,25	17.329,00
31-08-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	6,76	2.588,00	17.496,76	6,70	6,88	7,25	17.329,00
31-08-23	FIA RVA EMB IV	Venda	PRIQ3	47,01	8.026,00	377.297,30	45,71	46,62	47,30	23.855,00
31-08-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	19,18	11.921,00	228.675,66	18,39	18,84	19,40	24.427,00
31-08-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	19,03	989,00	18.822,96	18,39	18,84	19,40	24.427,00

## 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](http://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.