



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO

Dezembro/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 - DEZEMBRO 2023



Data: 29/12/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS
CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais		Limite Fundo:		0,00%		Dutacion DC:		1.758,64	
PL:	4.694.579.032,07	VAR / PL:	3,0811%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:			1.208,97
VAR:	144.645.147,23	ETL / PL:	3,8638%	Benchmark:					
ETL:	181.390.850,13	VAR / CDI:	0,0341%						

Cenários de STRESS										
Cenário Alta - 09999 (+):	165.882.715,13	Cenário Baixa - 10000 (+):	301.132.253,10	CENARIO BRADESCO 1 (+):	362.377.530,17	CENARIO BRADESCO 2 (+):	28.883.039,00			
Cenário Alta - 09999 (-):	(251.677.958,69)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(200.834.132,83)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(96.696.170,60)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(326.420.861,79)			
Cenário Alta - 09999:	(85.795.243,56)	Cenário Baixa - 10000:	100.298.120,27	CENARIO BRADESCO 1:	265.681.359,57	CENARIO BRADESCO 2:	(297.537.822,79)			

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
17H0164854	7.770.184,18	119.914,48	103.765,75	0,07%	0,00	0,00	0,00	0,00
AEGP23	15.103.778,86	188.890,12	83.753,69	0,06%	-447.273,45	-118.600,14	69.844,71	-93.348,59
CCRD01	3.186.891,82	40.630,81	19.158,86	0,01%	747.170,67	-1.601.118,89	782.394,43	-788.798,75
CMDT33	1.445.612,81	7.999,47	4.939,35	0,00%	-599.434,24	-198.759,38	60.469,78	-81.617,44
CSMG23	11.104.931,98	85.963,98	47.577,76	0,03%	-6.947,11	5.775,59	7.816,19	-10.873,28
ELET42	14.819.690,09	549.717,97	440.855,83	0,30%	940.441,25	-940.441,25	275.737,37	-277.994,43
ENJG21	1.664.679,76	24.709,56	21.545,65	0,01%	0,00	0,00	0,00	0,00
ENM212	1.063.455,14	16.181,26	14.256,52	0,01%	3.079,01	-3.079,01	1.805,53	-1.820,31
ENTV12	32.095.997,42	1.277.951,91	1.040.721,88	0,72%	-3.687,38	2.996,45	4.198,10	-6.017,78
ENTV17_VENCIMENTO	13.216.527,90	146.158,68	64.397,46	0,04%	-1.462.771,46	-36.030,78	500.622,83	-629.399,35
ERDV26	2.124.978,77	27.285,66	13.020,92	0,01%	-162.403,27	-31.444,59	29.747,40	-36.437,43
GASP17	60.537.400,92	408.263,13	346.586,23	0,24%	-142,30	115,07	173,74	-254,13
GRRB24_VENCIMENTO	16.548.854,95	638.709,40	503.739,59	0,35%	-426,91	345,26	489,44	-706,67
IGSN15	2.824.242,84	109.118,10	95.436,65	0,07%	185.381,78	-185.381,78	90.589,90	-91.331,43
LFSN16000GM	15.003.051,11	156.696,19	93.974,24	0,06%	-648.941,98	-74.820,61	176.533,70	-228.900,17
LFSN18000DC5	4.983.274,32	57.013,23	42.286,24	0,03%	176.615,21	-163.999,84	92.470,68	-93.227,60
NEOE16	7.603.540,93	292.349,56	232.161,34	0,16%	604.017,78	-748.982,05	354.196,03	-357.095,31
NTNB20240815 - 760199_VENCIMENTO	125.284.327,15	203.664,24	85.457,32	0,06%	428.417,99	-249.910,50	104.676,80	-105.533,63
NTNB20260815 - 760199_VENCIMENTO	43.531.840,53	746.949,01	717.183,60	0,50%	1.886.145,60	-1.886.145,60	1.106.035,78	-1.115.089,28
NTNB20300815 - 760199_VENCIMENTO	27.416.919,73	788.118,76	778.845,37	0,54%	1.925.868,76	-1.925.868,76	1.129.329,44	-1.138.573,61
NTNB20350815 - 760199_VENCIMENTO	245.557.293,94	9.397.194,95	9.252.195,80	6,40%	291.462,18	-291.462,18	170.913,42	-172.312,44
NTNB20400815 - 760199_VENCIMENTO	31.287.129,90	1.375.728,10	1.357.972,03	0,94%	1.450.231,77	-1.450.265,71	850.415,91	-857.377,02
NTNB20450815 - 760199_VENCIMENTO	236.207.717,60	11.811.910,73	11.655.709,85	8,06%	1.088.197,91	-1.088.214,08	797.650,92	-804.190,21
NTNB20500815 - 760199_VENCIMENTO	765.418.273,34	43.882.867,61	43.194.877,04	29,86%	0,00	0,00	0,00	0,00
NTNB20550815 - 760199_VENCIMENTO	238.600.235,67	15.125.451,20	14.874.397,56	10,28%	-44,60	36,59	61,77	-91,57
OMGE31	13.432.513,73	181.185,49	163.039,83	0,11%	-630,90	514,58	846,12	-1.251,85
PETRA5	9.359.328,60	176.552,46	43.070,57	0,03%	4.043,14	-4.043,14	2.370,90	-2.390,30
SBSPC2	17.748.034,36	97.967,60	60.454,86	0,04%	0,00	0,00	0,00	0,00
TAE333	4.208.172,91	78.490,29	26.114,53	0,02%	-23,19	22,32	52,87	-79,70
020913	1.438.254,02	41.523,29	9.529,29	0,01%	3.846.508,80	-3.846.508,80	563.898,19	-568.514,00
ABEV3	5.336.933,38	559.963,23	546.369,33	0,38%	2.204.540,24	-2.571.963,61	1.077.285,33	-1.086.103,49
AEGPA1	1.936.535,24	2.362,88	2.275,86	0,00%	2.267.520,00	-2.267.520,00	332.418,43	-335.139,46
AIEC11	1.880.882,50	142.028,05	95.191,10	0,07%	69.891,43	-69.891,43	40.984,33	-41.319,81
ALOS3	3.499.396,20	194.792,13	165.076,80	0,11%	0,00	0,00	0,00	0,00
ALPFA4	12.316,04	2.155,65	1.294,18	0,00%	327.324,62	-327.324,62	191.943,16	-193.514,32
AMPB13	2.686.794,14	1.163,54	1.116,63	0,00%	173.890,00	-179.601,10	56.020,26	-56.473,81
ANEM11	11.177.716,65	499.411,91	463.891,26	0,32%	28.290,12	-15.431,21	7.540,60	-7.602,33
ANET11	2.290.451,76	51.548,09	41.775,64	0,03%	-1.536.209,92	-115.127,00	485.930,06	-621.004,24
ANHB10	553.280,14	39,17	37,46	0,00%	-6.022,58	4.887,77	6.810,97	-9.782,78
APRB28	1.128.923,15	131,53	126,08	0,00%	-789.167,61	-69.269,05	235.648,10	-304.793,72
ARZZ3	617.939,28	114.860,18	103.821,48	0,07%	-793.433,25	-125.903,91	180.979,54	-239.168,33
ASAB11	6.408.326,18	238.878,19	202.648,00	0,14%	0,00	0,00	0,00	0,00
ASAI3	630.768,60	76.684,73	41.945,58	0,03%	-1.338.602,43	-116.321,50	397.312,59	-510.502,11
AURE3	2.416.071,13	165.336,70	107.053,94	0,07%	-155.837,25	137.985,77	172.427,21	-220.772,89
AZUL4	714.029,99	170.696,89	30.442,03	0,02%	-2.020.681,02	-174.055,94	600.627,81	-773.867,01
B3SA3	7.544.582,40	1.270.322,14	1.216.291,82	0,84%	-612.459,11	-49.972,77	184.953,90	-237.913,59
BBAS3	7.703.475,03	459.382,00	340.369,58	0,24%	436.764,00	-436.764,00	160.074,01	-161.384,30
BBDC3	1.165.848,72	143.919,24	139.619,98	0,10%	0,00	0,00	0,00	0,00
BBDC4	5.800.927,06	960.871,24	623.975,41	0,43%	-161.012,07	-20.900,41	15.232,70	-20.554,12
BBSE3	5.441.070,40	267.646,22	104.501,81	0,07%	28.845,67	-28.845,67	16.911,10	-17.015,55
BBTOPIND	339.585.881,08	10.974.942,16	10.830.354,18	7,49%	0,00	0,00	0,00	0,00
BCBF14	178.175,04	9,34	8,85	0,00%	-844,18	690,02	962,85	-1.373,75
BCBF15	2.027.183,13	141,04	133,94	0,00%	-1.409,30	1.135,75	1.623,56	-2.354,14
BEEF3	16.172,55	2.640,45	2.170,55	0,00%	-1.362,57	1.089,01	1.655,03	-2.432,04
BHIA3	55.022,30	120.474,56	-106.476,00	-0,07%	328.424,05	-328.424,05	96.293,93	-97.062,15
BKBR18	1.053.525,74	1,34	0,79	0,00%	-4.503,58	3.739,12	5.101,73	-7.125,43
BMLC11	3.846.508,80	126.829,94	72.089,12	0,05%	886.044,18	-738.370,15	432.980,26	-436.524,43
BPAC11	7.348.467,46	826.841,75	763.800,70	0,53%	-850.001,94	-72.473,70	253.101,18	-324.595,29
BPML11	2.267.520,00	228.874,16	-184.577,47	-0,13%	-18.217,41	15.492,50	20.917,42	-28.203,09
BRAP4	279.965,70	32.345,95	13.944,57	0,01%	-37.726,47	-13.084,04	3.445,69	-4.648,78
BRELETRO	2.257.728,38	30.327,75	-14.753,77	-0,01%	505.559,11	-606.670,93	296.459,86	-296.886,55
BRF33	1.309.298,48	297.365,53	-81.816,07	-0,04%	25.374,29	-25.374,29	10.628,20	-10.715,20
BRF23	382.130,00	62.000,27	52.264,26	0,04%	174.309,63	-174.309,63	51.107,68	-51.525,93
BRKM5	51.436,58	9.708,70	6.573,66	0,00%	-1.289.697,95	-86.119,98	405.638,06	-517.689,52
BRKP28	11.037.063,53	545.826,91	491.067,70	0,34%	12.976,69	-18.167,37	7.609,53	-7.671,82
BRKPA0	3.342.353,17	1.958,85	1.878,32	0,00%	-35.215,67	35.914,92	139.079,43	-211.684,47
BTOW15	5.658.926,28	308.825,52	260.560,32	0,18%	0,00	0,00	0,00	0,00
CAEC21	9.266.246,84	303.004,25	250.433,51	0,17%	-833.799,28	-134.618,87	190.447,41	-251.233,43
CAIXA	56.999,04	0,00	0,00	0,00%	251.551,76	-251.555,02	184.389,83	-185.899,16
CART13	11.291.650,03	485.059,40	427.118,68	0,30%	115,71	-97,15	-178,32	271,08
CBAN22	9.055.298,04	60.870,51	58.315,51	0,04%	549.062,17	-549.062,17	365.875,07	-368.869,95
CBAN32	17.047.703,75	762.175,08	657.318,18	0,45%	1.504.994,57	-1.505.060,60	1.002.917,66	-1.011.127,08
CBAN72	5.001.126,22	229.656,64	199.464,82	0,14%	-0,51	2,41	5,75	-8,73
CBAV3	1.091.910,00	255.978,88	201.148,10	0,14%	-5.269,71	4.446,59	6.005,56	-8.181,31
CCPR43	1.309.298,48	297.365,53	-81.816,07	-0,04%	0,00	0,00	0,00	0,00
CCRO3	115.382,66	12.407,26	10.941,66	0,01%	192.147,08	-192.147,08	112.676,05	-113.597,35
CDB323RSTI1	6.352.240,43	0,00	0,00	0,00%	-831.298,91	-125.256,99	199.857,81	-261.789,60
CEAB22	538.915,21	271,84	260,97	0,00%	-6.094,62	5.198,42	6.992,17	-9.383,00
CEEB43	1.001.551,80	434,37	416,53	0,00%	682.648,12	-682.648,12	400.304,86	-403.581,57
CELG12	3.357.084,81	353,01	337,65	0,00%	-265.401,16	-68.280,28	65.382,54	-85.913,23
CEOC11	656.848,10	47.995,37	43.893,85	0,03%	-337.636,48	-108.963,09	34.389,39	-46.397,37
CGBP13	2.108.031,89	1.509,48	1.453,42	0,00%	135.252,94	-101.439,70	49.570,20	-49.975,96
CIEL3	2.953.480,60	598.487,31	539.468,02	0,37%	173.783,40	-173.783,40	84.922,16	-85.617,29
CJEN13	7.294.000,71	302.292,32	268.836,65	0,19%	94.690,75	-94.690,75	27.763,33	-27.990,59
CLH12	2.550.781,94	6.187,33	5.981,27	0,00%	232.716,00	-232.716,00	170.580,83	-171.977,12
CMG4	2.022.236,44	350.373,16	-2.022,33	0,00%	29.150,29	-26.417,45	13.354,47	-13.463,79

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2023



Relatório de Risco de Mercado

Data: 29/12/2023

FUNDO: EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS
CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais		Limite Fundo:		0,00%		Dutacion DC:		1.758,64	
PL:	4.694.579.032,07	VAR / PL:	3,0811%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:			1.208,97
VAR:	144.845.147,23	ETL / PL:	3,8638%	Benchmark:					
ETL:	161.390.850,13	VAR / CDI:	0,0341%						

Cenários de STRESS										
Cenário Alta - 09999 (+):	165.882.715,13	Cenário Baixa - 10000 (+):	301.132.253,10	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	362.377.530,17	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	28.883.039,00			
Cenário Alta - 09999 (-):	(251.677.958,69)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(200.834.132,83)	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	(96.696.170,60)	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(326.420.861,79)			
Cenário Alta - 09999:	(85.795.243,56)	Cenário Baixa - 10000:	100.298.120,27	CENÁRIO BRADESCO 1:	265.681.359,57	CENÁRIO BRADESCO 2:	(297.537.822,79)			

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
CMIN3	72.497,97	13.225,49	2.392,67	0,00%	5.523,86	-8.019,94	-3.322,52	3.350,23
CNES11	348.619,26	32.133,69	27.163,09	0,02%	-1.023.548,90	973.873,81	675.137,02	-672.321,92
CNRD11	10.044.045,21	456.614,29	413.231,62	0,29%	-1.192.301,50	1.068.653,95	908.708,95	-899.740,75
COGN3	51.906,77	12.199,15	10.914,69	0,01%	106.688,50	-98.544,41	-98.324,72	89.584,68
COMPROMISSADA_PRE	1.242.975.805,52	15.176,82	4.366,69	0,00%	-499.981,35	529.957,25	388.119,60	-388.715,35
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	4.508.637,92	0,00	0,00	0,00%	-2.496.702,28	2.267.471,75	1.831.096,70	-1.805.022,33
GONX12	9.755.487,79	313.058,93	258.611,91	0,18%	-414.121,19	368.207,46	330.113,09	-319.697,99
CPFE3	1.257.775,11	96.314,65	81.145,38	0,06%	278.745,24	-248.475,41	-232.795,65	221.559,77
CPGT16	151.321,78	11,95	-10,27	0,00%	-190.721,15	173.661,93	169.581,42	-158.352,10
CPLE3	2.495.737,14	179.594,86	148.579,31	0,10%	-43,18	38,63	80,44	-120,82
CPLE6	6.841.184,56	513.574,22	467.369,67	0,32%	-4.950,78	4.076,93	5.638,94	-7.987,52
CPMF24099500	2.139,43	431,23	202,64	0,00%	-16.273,63	15.404,39	61.787,91	-94.043,75
CPT1E2	2.051.473,05	1.780,41	1.719,72	0,00%	-1.025.084,57	805.547,34	1.218.205,69	-1.797.580,98
CREDEM24	210.806,29	77.106,20	68.516,08	0,05%	-1.620.006,30	1.297.310,03	1.724.467,93	-2.473.707,80
CRFB3	768.588,30	139.038,32	118.004,84	0,08%	193.675,13	-181.847,59	-281.821,23	288.777,48
CRMG15	9.129.809,67	303.260,57	251.425,62	0,17%	2.067.343,81	-2.076.989,70	-5.197.092,23	7.844.485,45
CSAN23	1.155.343,76	2.081,15	2.012,53	0,00%	-1.011.200,18	865.310,65	1.625.904,46	-2.434.861,88
CSAN3	2.730.592,48	344.204,62	280.008,86	0,19%	1.837.277,50	-1.452.639,41	-2.041.995,28	2.972.807,75
CSMGB8	2.847.700,68	104.718,66	85.311,53	0,06%	2.092.584,63	-1.705.804,04	-2.246.490,40	3.175.507,39
CSNA3	338.132,34	95.196,71	77.607,76	0,05%	-4.991.491,94	3.715.072,41	6.211.225,73	-9.231.003,50
CURY3	579.278,00	71.867,72	65.863,18	0,05%	456.689,40	-363.619,65	-496.399,09	717.268,85
CVCB3	189.381,50	27.340,22	15.920,71	0,01%	263.978,10	-263.978,10	128.997,30	-130.053,21
CXSE3	1.163.580,00	86.944,66	64.409,81	0,04%	0,00	0,00	0,00	0,00
CYRE3	91.094,64	21.774,10	21.263,61	0,01%	-1.262.033,12	1.346.727,32	-1.684.834,84	1.694.017,15
DAPF24	-3.706,24	7.577,78	-4.135,71	0,00%	18.855,56	-22.626,67	11.056,90	-11.147,40
DAPK25	17.622,46	371.385,82	339.372,67	0,23%	274.828,50	-274.828,50	161.159,43	-162.478,61
DAPK27	10.160,46	718.109,68	696.296,82	0,48%	75.955,86	-75.955,86	61.861,82	-62.368,20
DAPK35	-311,24	48.909,68	-48.178,48	-0,03%	-1.312,50	1.053,91	1.572,41	-2.301,41
DAPQ24	18.308,51	145.785,14	41.740,59	0,03%	-5.310,59	4.374,62	5.952,02	-8.379,50
DAPQ26	26.561,21	1.509.570,42	1.453.333,02	1,00%	4.444.139,42	-4.444.174,33	2.171.702,79	-2.189.479,35
DAPQ28	2.684,21	224.225,81	219.756,61	0,15%	-1.344.374,99	-179.529,69	328.676,90	-433.176,86
DAPQ30	-1.315,67	137.677,41	-136.262,18	-0,09%	452.022,77	-452.022,77	220.888,46	-222.696,55
DAPQ32	715,72	91.435,50	90.306,66	0,06%	129.565,33	-129.565,33	75.977,11	-76.599,03
DASAA2	1.313.421,66	3,55	2,78	0,00%	402.201,80	-402.201,80	168.465,10	-169.844,07
DESK13	2.704.799,22	1.622,44	1.599,40	0,00%	2.787.602,38	-3.842.370,85	1.104.493,27	-1.113.534,14
DHF124	240,95	6.901,33	2.000,03	0,00%	1.809.463,63	-2.341.694,67	1.560.413,51	-1.573.166,34
DHF25	-35.225,52	230.455,62	218.851,62	0,15%	-96.031,98	-25.460,66	14.593,81	-19.408,35
DHF26	-63.401,68	571.771,55	549.568,07	0,38%	81.677,70	-49.006,62	26.608,78	-26.826,59
DHF33	10.856,49	64.267,81	-61.882,44	-0,04%	-63.127,47	-16.835,66	9.568,79	-12.801,91
DHJ24	8.113,87	91.712,96	-26.821,08	-0,02%	-3.195.271,52	-394.683,81	823.076,93	-1.078.215,21
DHN24	-14.005,83	88.441,10	72.325,68	0,05%	4.983.647,26	-4.983.647,26	3.653.013,44	-3.682.915,32
DHN25	51.078,50	583.263,39	-561.849,84	-0,39%	-361.483,49	-112.340,86	34.632,36	-46.765,15
DHN26	82.150,73	760.392,48	-729.061,73	-0,50%	-475.219,31	-147.687,37	45.528,96	-61.479,16
DHV24	-93.822,86	756.085,18	695.286,17	0,48%	0,00	0,00	0,00	0,00
DHV25	14.384,40	149.952,13	-149.102,27	-0,10%	-68.404,87	-14.120,95	10.369,18	-13.991,12
DHR3	879.927,00	173.430,64	166.670,58	0,12%	-369.164,42	-123.912,16	42.358,67	-56.933,83
DOLF24	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DOLG24	-22.841,39	422.341,49	153.730,84	0,11%	4.932,93	-7.399,72	3.615,93	-3.645,53
DXO03	75.422,22	15.715,84	14.346,13	0,01%	270.152,61	-270.152,61	198.021,98	-199.542,78
ECOR3	1.089.314,00	205.132,76	191.126,18	0,13%	600.495,00	-600.495,00	175.065,13	-177.500,32
EGIE3	421.976,97	28.228,83	20.221,62	0,01%	-1.754.004,69	2.029.364,15	1.371.425,83	-1.806.863,78
ELET13	2.062.111,46	367,72	352,08	0,00%	-834.376,86	48.127,60	333.968,70	-408.039,33
ELET24	2.742.395,08	1.794,99	1.725,46	0,00%	219.880,98	-219.880,98	128.938,21	-129.993,64
ELET3	14.813.798,05	1.490.719,83	681.374,74	0,47%	3.318.913,85	-3.318.913,85	1.081.228,38	-1.090.078,81
ELET6	1.506.742,56	130.664,26	75.310,24	0,05%	1.537.060,33	-1.366.500,51	1.251.947,12	-1.262.194,98
EMBR3	518.261,33	92.858,09	77.572,97	0,05%	452.418,91	-377.015,76	221.082,04	-222.891,72
ENAT3	1.149.148,00	278.891,60	233.964,86	0,02%	40.714,83	-23.750,32	9.947,99	-10.029,42
ENEV3	7.534.060,48	981.834,42	808.406,40	0,56%	-255,17	204,57	304,42	-445,44
ENH11	10.644.021,22	1.030.178,88	394.082,45	0,27%	-787.295,67	-95.750,99	197.495,72	-260.159,32
ENJ3	181.506,00	24.142,54	12.933,82	0,01%	-1.510.623,57	-183.722,22	378.944,91	-499.180,69
EQFL3	24.918.236,28	1.486.058,64	693.685,85	0,47%	-2.794,95	2.214,25	3.190,03	-4.617,70
ERDV17	10.053.372,22	111.178,03	48.985,00	0,03%	3.379.099,40	-3.379.099,40	1.456.308,15	-1.466.914,39
ERDV18	1.358.876,63	0,00	0,00	0,00%	-1.392.676,60	-69.255,82	453.196,13	-574.558,09
ERDV38	6.077.400,65	74.016,20	65.579,41	0,05%	3.598.489,28	-3.598.489,28	527.538,53	-531.856,72
ETEN13	1.321.982,32	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
EZTC3	24.665,30	6.774,95	5.959,65	0,00%	-1.531.980,23	-101.696,59	478.203,46	-612.616,97
FLRY3	1.350.763,04	88.258,62	71.258,37	0,05%	161.987,64	-138.469,72	99.384,14	-100.197,65
FVPQ11	1.200.990,00	77.103,10	44.118,41	0,03%	-296.598,26	-26.617,45	87.569,05	-112.407,67
GBSP11	5.363.879,01	278.051,17	267.723,62	0,19%	0,00	0,00	0,00	0,00
GGBR4	879.523,92	90.113,11	73.633,27	0,05%	0,00	0,00	0,00	0,00
GGPS3	7.375.364,10	946.129,30	827.658,48	0,57%	0,00	0,00	0,00	0,00
GMAT3	8.539.884,82	1.604.549,61	1.446.721,23	1,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
GOAU4	1.508.063,04	167.492,25	104.108,55	0,07%	0,00	0,00	0,00	0,00
GOLL4	67.858,05	11.838,85	-947,50	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
GRRB14	1.106.703,49	69,15	65,15	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
GRRB24	8.624.810,40	332.877,86	262.535,29	0,18%	0,00	0,00	0,00	0,00
GUAR15	2.636.090,20	828,52	793,74	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
HAPV3	9.938.527,65	1.494.209,11	560.288,21	0,39%	0,00	0,00	0,00	0,00
HARG11	11.240.240,43	482.554,30	441.158,81	0,30%	0,00	0,00	0,00	0,00
HBRH11	3.598.489,28	145.029,90	-2.272,77	0,00%	9.001,26	-10.639,28	-53.542,12	26.685,69
HSLG11	1.182.575,11	0,00	0,00	0,00%	-45.090,55	42.836,31	172.097,15	-248.404,68
HVRD15	11.690.020,05	568.322,30	504.637,13	0,35%	32.095,49	-30.381,33	-121.861,27	185.473,11
HYPE3	677.927,25	113.666,27	98.796,44	0,07%	-145,62	137,84	552,90	-841,54
HZTC14	2.559.044,63	105.638,05	93.666,80	0,06%	-5.613,50	5.313,69	21.313,52	-32.440,05
IDIF24C381500	0,00	0,00	0,00	0,00%	14.468,91	-13.696,15	-54.936,06	83.614,95

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2023

Relatório de Risco de Mercado



Data: 29/12/2023

FUNDO: EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS
 CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais		Limite Fundo:		0,00%		Dutacion DC:		1.758,64	
PL:	4.694.579,032,07	VAR / PL:	3,0811%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:			1.208,97
VAR:	144.845.147,23	ETL / PL:	3,8638%	Benchmark:					
ETL:	161.390.850,13	VAR / CDI:	0,0341%						

Cenários de STRESS										
Cenário Alta - 09999 (+):	165.882.715,13	Cenário Baixa - 10000 (+):	301.132.253,10	CENARIO BRADESCO 1 (+):	362.377.530,17	CENARIO BRADESCO 2 (+):	28.883.039,00			
Cenário Alta - 09999 (-):	(251.677.958,69)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(200.834.132,83)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(96.696.170,60)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(326.420.861,79)			
Cenário Alta - 09999:	(85.795.243,56)	Cenário Baixa - 10000:	100.298.120,27	CENARIO BRADESCO 1:	265.681.359,57	CENARIO BRADESCO 2:	(297.537.822,79)			

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
IDIF24C381600	0,00	0,00	0,00	0,00%	-14.226,08	13.466,28	54.014,05	-82.211,61
IDIF24C381800	0,00	0,00	0,00	0,00%	-44.719,04	42.330,67	169.790,78	-258.428,55
IDIF24C381900	0,00	0,00	0,00	0,00%	44.730,76	-42.341,76	-169.835,27	258.496,27
IDIF24C382000	0,00	0,00	0,00	0,00%	35.396,82	-33.506,33	-134.395,85	204.556,02
IDIF24C382100	0,00	0,00	0,00	0,00%	-35.406,09	33.515,11	134.431,05	-204.609,60
IDIF24C382500	0,00	0,00	0,00	0,00%	10.012,09	-9.477,36	-38.014,23	57.859,22
IDIF24C382600	0,00	0,00	0,00	0,00%	-10.014,70	9.479,84	38.024,17	-57.874,35
IDIF24C382700	0,00	0,00	0,00	0,00%	147.814,30	-94,50	-94,50	2.257.799,68
IDIF24P380200	0,00	0,00	0,00	0,00%	-103.203,57	29,01	29,01	-2.185.171,32
IDIF24P380300	0,00	0,00	0,00	0,00%	141.341,39	-2.178.300,00	-6.382.061,84	141.347,41
IDIF24P380900	-28.037,93	4.243,79	-1.247,95	0,00%	-63.320,49	697.331,09	1.942.694,76	-68.327,63
IDIF24P381000	10.285,20	18.888,31	5.554,39	0,00%	-493.947,03	3.496.866,19	9.384.322,89	-494.069,83
IDIF24P381100	-576.463,87	13.413,93	-3.944,57	0,00%	354.107,64	-1.814.797,06	-4.742.321,00	354.309,72
IDIF24P381200	3.914,24	60,86	17,90	0,00%	-134.891,65	520.559,57	1.336.026,96	-135.061,44
IDIF24P381300	200.926,85	2.346,09	689,90	0,00%	176.126,06	-500.594,74	-1.346.274,15	176.593,76
IDIF24P381400	-646.801,31	6.047,11	-1.778,24	0,00%	-939.722,19	1.622.098,42	4.064.829,49	-957.049,19
IDIF24P381500	762.623,79	5.945,62	1.748,40	0,00%	2.148.491,64	-3.248.758,11	-8.133.921,70	2.216.433,76
IDIF24P381600	2.795.271,98	18.689,79	5.496,01	0,00%	-1.199.727,34	1.626.319,16	4.070.298,11	-1.261.455,14
IDIF24P381700	-3.193.898,05	18.694,69	-5.497,45	0,00%	212.808,07	-6.797.083,17	-13.610.317,90	212.808,07
IDIF24P381800	-2.842.129,79	14.793,68	-4.350,30	0,00%	-88.920,88	2.067.983,08	4.084.261,67	-88.920,88
IDIF24P381900	3.157.492,19	14.797,56	4.351,44	0,00%	-289.602,12	5.040.817,18	9.840.643,82	-289.602,12
IDIF24P382400	-1.337.009,52	4.184,43	-1.230,49	0,00%	-908.654,66	9.555.117,90	18.332.398,89	-908.654,66
IDIF24P382500	1.426.070,66	4.185,53	1.230,82	0,00%	1.796.991,25	-15.199.506,92	-28.905.164,95	1.796.991,25
IDU24C391800	94,50	50,08	-14,65	0,00%	-802.791,79	5.574.979,16	10.882.414,76	-802.791,79
IDU24C391900	-29,01	16,63	4,86	0,00%	-568.650,39	2.129.715,67	4.008.210,83	-568.650,39
IDU24P390700	-141.347,41	34.498,46	-10.088,94	-0,01%	1.284.866,36	-4.269.406,76	-8.029.667,39	1.284.866,36
IDU24P390800	68.327,63	14.532,39	4.249,94	0,00%	-1.831.227,93	5.457.602,93	10.280.075,17	-1.831.227,93
IDU24P390900	494.069,83	90.869,14	26.574,31	0,02%	2.463.719,16	-6.648.681,97	-12.496.220,18	2.463.719,16
IDU24P391000	-354.309,72	55.984,47	-16.372,43	-0,01%	-1.349.899,24	3.326.130,31	6.250.627,45	-1.349.899,24
IDU24P391100	135.061,44	18.250,91	5.337,41	0,00%	-304.552,68	-1.808,49	86.624,05	-111.669,77
IDU24P391200	-176.933,76	20.369,89	-5.957,09	0,00%	2.463,25	-1.984,81	-3.350,68	5.054,97
IDU24P391500	957.049,19	70.190,54	20.526,94	0,01%	1.927.179,97	-1.927.219,50	1.412.651,89	-1.424.215,21
IDU24P391600	-2.216.433,76	142.170,41	-41.577,16	-0,03%	959.438,12	-957.460,00	756.216,14	-759.827,60
IDU24P391700	1.261.455,14	71.551,94	20.925,08	0,01%	0,00	0,00	0,00	0,00
IDN24P400300	-212.908,07	219.093,59	-179.171,16	-0,12%	-843.533,76	-86.451,04	237.473,77	-305.864,65
IDN24P400400	86.920,88	63.366,11	86.177,08	0,05%	-833.126,68	-238.591,00	-23.604,58	-155.427,91
IDN24P400500	299.802,11	246.332,93	201.447,05	0,14%	80.769,98	-68.343,93	18.216,74	-18.365,85
IDN24P400700	908.654,66	629.817,75	515.054,67	0,36%	-301.993,61	16.199,41	120.563,64	-148.045,07
IDN24P400800	-1.796.991,25	1.119.896,60	-915.833,15	-0,63%	-1.255.314,70	-52.081,21	417.155,61	-529.439,73
IDN24P400900	802.791,79	449.077,42	367.248,18	0,25%	1.225.709,84	-1.225.709,84	9.455.731,91	-953.473,23
IDN24P401300	568.650,39	207.230,99	169.470,12	0,12%	7.161.939,15	-6.803.942,34	5.249.778,67	-5.292.750,94
IDN24P401400	-1.284.866,36	423.334,46	-346.196,01	-0,24%	-87,51	71,91	125,08	-186,16
IDN24P401500	1.831.227,93	547.876,42	448.044,39	0,31%	1.084.563,96	-1.084.563,96	454.277,36	-457.995,87
IDN24P401600	-2.463.719,22	672.641,30	-550.075,07	-0,38%	-389.563,67	-41.416,75	108.778,49	-141.321,15
IDN24P401700	1.349.899,34	338.070,42	276.468,47	0,19%	80.853,03	-64.682,42	47.412,21	-47.800,31
IGTA37	2.132.336,84	387,57	-354,78	0,00%	-1.063.187,04	-116.663,88	294.436,26	-382.605,45
IGTH11	9.636.097,48	1.201.788,45	1.096.760,50	0,76%	-721,91	581,87	915,36	-1.349,68
INDG24	0,00	363.287,23	316.966,54	0,22%	-4.274,69	3.469,23	4.834,27	-6.943,99
INFSN1	1.907.325,67	126.572,77	-10.181,36	-0,01%	-1.984.997,73	-205.095,94	559.450,33	-726.465,21
INPL11	8.093.949,90	298.504,21	261.421,99	0,18%	-437.897,31	-36.683,68	119.099,30	-156.826,44
IRBR12	11.677.993,86	204.538,02	192.299,93	0,13%	0,00	0,00	0,00	0,00
IRBR3	124.261,50	23.221,44	6.565,63	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
IRJS14	1.792.587,69	102.068,37	98.086,10	0,07%	0,00	0,00	0,00	0,00
ITPO14	8.946.642,21	448.725,20	408.625,91	0,28%	0,00	0,00	0,00	0,00
ITSA4	6.451.104,41	682.304,47	630.641,76	0,44%	0,00	0,00	0,00	0,00
ITUB4	35.810.222,84	2.996.769,69	2.695.129,84	1,86%	0,00	0,00	0,00	0,00
IWA35	1.292.425,48	14,82	13,77	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
JBSS3	3.098.754,18	278.207,58	209.378,81	0,14%	0,00	0,00	0,00	0,00
JMSLB5	3.435.791,80	153.032,23	126.442,83	0,09%	0,00	0,00	0,00	0,00
KLBN11	323.412,10	27.576,30	-12.736,55	-0,01%	0,00	0,00	0,00	0,00
LAMIEA6	9.641.970,17	413.301,73	341.947,35	0,24%	0,00	0,00	0,00	0,00
LCAMA9	6.980.165,83	170,15	162,16	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LCAMC3	3.026.084,09	1.390,35	1.333,19	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LCAMD1	17.133.914,51	782.819,30	647.085,28	0,45%	1.031,80	-894,56	-1.780,16	2.716,23
LF001800FAU	4.607.183,33	209.041,72	157.131,24	0,11%	1.586,46	-1.372,76	-2.718,41	4.147,95
LF002100Q31	2.478.537,55	0,00	0,00	0,00%	1.127,13	-967,50	-1.871,47	2.855,92
LF002100HDP	1.546.318,41	0,00	0,00	0,00%	-10.262,74	8.332,77	11.498,62	-16.456,90
LF002100HDQ	2.816.989,08	0,00	0,00	0,00%	-631.036,18	-173.788,76	75.551,65	-101.923,48
LF00220018H	1.305.168,32	0,00	0,00	0,00%	-309.238,59	-114.252,35	29.579,09	-39.862,00
LF002200IO9	2.263.049,98	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002200U5M	10.147.734,41	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF00230695Q	5.263.813,92	0,00	0,00	0,00%	-25.408,96	27.363,50	-52,91	80,55
LF002306J15	10.550.413,31	0,00	0,00	0,00%	-2.019,54	2.417,77	-1,66	2,52
LF002306SWQ	10.561.147,37	0,00	0,00	0,00%	-48.910,65	76.078,76	972,74	-1.480,80
LF002306U55	6.339.595,34	0,00	0,00	0,00%	-112.573,20	210.077,29	5.174,42	-7.875,47
LF002306ZBP	5.221.857,73	0,00	0,00	0,00%	-23.459,86	54.150,37	2.160,92	-3.287,76
LF002306ZK1	5.236.416,97	0,00	0,00	0,00%	-46.188,85	121.953,34	8.700,26	-13.210,27
LFSC1900089	3.688.074,26	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFSC190054B	899.780,51	0,00	0,00	0,00%	-2.063,07	1.702,49	2.312,51	-3.250,52
LFSC190059S	1.362.861,41	0,00	0,00	0,00%	291.360,60	-291.360,60	94.918,81	-95.695,77
LFSC190051X	901.564,82	0,00	0,00	0,00%	-791.918,41	-81.678,15	223.550,96	-290.330,30
LFSC22002DX	4.711.506,76	3.367,60	3.227,15	0,00%	818.691,22	-818.691,22	600.100,67	-605.012,82
LFSN210029N	4.438.354,43	0,00	0,00	0,00%	-62,70	52,85	101,96	-152,52
LFSN2301ERT	4.312.519,09	0,00	0,00	0,00%	-14.543,08	10.954,81	16.227,07	-23.787,78
LFT20240301 - 210100	68.915.789,18	359,90	-102,06	0,00%	-1.831.057,57	1.458.859,34	2.043.419,44	-2.974.775,65

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO - DEZEMBRO 2023



Relatório de Risco de Mercado

Data: 29/12/2023

FUNDO: EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS
 CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais			
PL:	4.694.579,032,07	VAR / PL:	3,0811%
VAR:	144.645.147,23	ETL / PL:	3,8638%
ETL:	161.390.850,13	VAR / CDI:	0,0341%

Limite Fundo:		ENQUADRADO		0,00%		Duration DC:		1.758,64	
Status:									
Benchmark:									1.208,97

Cenários de STRESS										
Cenário Alta - 09999 (+):	165.882.715,13	Cenário Baixa - 10000 (+):	301.132.253,10	CENARIO BRADESCO 1 (+):	362.377.530,17	CENARIO BRADESCO 2 (+):	28.883.039,00			
Cenário Alta - 09999 (-):	(251.677.958,69)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(200.834.132,83)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(96.696.170,60)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(326.420.861,79)			
Cenário Alta - 09999:	(85.795.243,56)	Cenário Baixa - 10000:	100.298.120,27	CENARIO BRADESCO 1:	265.681.359,57	CENARIO BRADESCO 2:	(297.537.822,79)			

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
LFT20240901 - 210100	1.198.042,25	18,81	-5,07	0,00%	-449.911,29	370.397,76	497.919,43	-179.331,76
LFT20250901 - 210100	10.835.569,66	2.435,57	-1.768,43	0,00%	-2.041.563,82	1.258.743,34	2.257.173,95	-3.189.195,80
LFT20260301 - 210100	21.173.595,90	5.961,18	-2.907,04	0,00%	48.034,32	-48.034,32	17.604,68	-17.748,68
LFT20260901 - 210100	4.127.625,11	1.558,35	-217,52	0,00%	2.271.456,00	-2.271.456,00	665.990,90	-671.442,39
LFT20290301 - 210100	4.073.446,79	2.997,61	1.927,01	0,00%	383.387,75	-383.387,75	187.348,81	-188.882,36
LIGHB4	2.388.756,42	0,00	0,00	0,00%	886.606,70	-886.606,70	259.953,08	-262.080,94
LIGHD3	944.077,40	698,84	671,84	0,00%	291.851,17	-282.563,51	82.279,58	-82.953,08
LJQQ3	647.468,00	224.361,59	214.483,64	0,15%	-5.065,88	4.214,15	5.702,37	-7.927,75
LORTA7	6.700.406,54	312.441,57	258.332,62	0,18%	-1.035.929,88	-109.454,86	289.854,00	-376.527,86
LREN3	4.093.456,12	1.195.463,27	1.124.090,03	0,78%	401.409,28	-301.056,96	147.116,50	-148.320,73
LREN81	1.407.232,54	7,70	6,91	0,00%	10.659,62	-10.659,62	5.213,89	-5.256,57
LTN20250401 - 100000	533.720,99	4.077,10	3.944,64	0,00%	-1.066.168,77	-147.217,64	266.885,64	-348.828,16
LTN20250701 - 100000	56.584.579,03	578.550,78	560.246,01	0,39%	287.750,36	-230.127,81	137.265,29	-138.388,88
LTN20251001 - 100000	11.730.587,08	153.635,87	148.615,23	0,10%	-699.844,93	-87.304,43	174.781,58	-230.154,27
LTN20260701 - 100000	36.963.049,88	752.712,54	728.422,96	0,50%	3.335.206,42	-3.335.206,42	977.882,52	-985.887,02
LWSA3	120.085,81	14.132,68	8.787,94	0,01%	1.827.112,00	-1.827.112,00	267.854,62	-270.047,15
MALL11	4.542.912,00	113.017,61	78.635,97	0,05%	628.751,36	-628.751,36	368.699,80	-371.717,81
MATD3	1.277.959,15	293.264,39	272.663,93	0,19%	-266.136,88	-44.759,78	59.717,23	-78.655,92
MAXR11	1.773.213,40	102.057,61	67.305,88	0,05%	-112.295,45	125.569,08	78.067,74	-105.193,99
MGLU3	561.252,24	260.346,81	214.006,63	0,15%	-1.064.762,10	1.190.525,05	740.222,08	-997.427,49
MOVIZ7	1.193.646,89	1.723,03	1.659,55	0,00%	-403.990,47	406.964,95	239.762,50	-321.266,46
MOVIZ7	9.094.025,58	407.291,42	336.557,05	0,23%	-659.583,64	716.060,14	466.458,87	-618.734,91
MRFZ3	1.003.523,20	272.369,50	139.885,12	0,10%	-1.144.315,82	1.242.237,25	309.252,44	-1.073.447,09
MVVE3	35.565,41	8.677,37	8.136,91	0,01%	-192.681,48	214.656,98	144.335,58	-190.203,11
MTRJH9	11.354.728,48	395.579,44	328.992,57	0,23%	-867.812,28	911.873,97	656.978,18	-857.054,60
MULT3	936.325,32	68.770,87	60.956,75	0,04%	-1.472.323,07	1.568.883,85	1.170.393,58	-1.502.835,98
NEWU11	6.870.412,84	344.641,63	247.442,79	0,17%	-18.612.359,76	22.033.760,17	16.808.330,73	-20.785.303,68
NEWU11	1.827.112,00	96.322,97	57.707,88	0,04%	-2.935.475,14	3.658.085,91	2.790.618,22	-3.325.883,75
NTCO3	2.515.005,45	590.181,49	393.197,78	0,27%	-22.164.686,37	37.511.222,63	25.302.873,11	-29.204.066,21
NTEN11	3.186.887,42	96.801,84	79.172,63	0,05%	-902.919,39	1.340.993,17	975.189,22	-1.094.062,54
NTNB20240815 - 760199_NEGOCIACAO	13.213.148,91	21.479,51	9.012,78	0,01%	-84.563.806,31	125.592.038,64	91.323.308,70	-102.465.506,64
NTNB20250515 - 760199_NEGOCIACAO	22.484.530,52	155.576,81	143.895,67	0,10%	-28.264.825,95	43.222.099,28	31.265.925,62	-34.292.816,12
NTNB20260815 - 760199_NEGOCIACAO	25.091.752,88	430.541,41	413.384,63	0,29%	-7.118,82	5.897,75	8.035,02	-11.241,53
NTNB20270515 - 760199_NEGOCIACAO	6.017.100,62	127.940,28	123.723,31	0,09%	-871.459,50	-292.521,69	102.967,00	-138.270,68
NTNB20280815 - 760199_NEGOCIACAO	21.012.892,85	511.322,85	499.866,72	0,35%	645.190,00	-645.190,00	270.242,44	-272.454,52
NTNB20290815 - 760199_NEGOCIACAO	8.172.657,21	468.553,79	461.207,86	0,32%	101.112,08	-101.112,08	29.646,96	-29.889,73
OMGE13	3.154.063,00	2.396,81	2.306,92	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ONCO3	1.843.400,00	519.531,83	461.537,83	0,32%	-1.168,86	938,11	1.399,77	-2.050,04
OULG11	202.224,15	21.172,66	-1.625,70	0,00%	-629.966,55	-110.815,59	137.566,03	-181.264,68
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	2.226.627,00	-2.226.627,00	652.847,04	-658.190,94
OVSA10	1.779.666,52	311,77	298,11	0,00%	8.248,91	-8.248,91	4.837,16	-4.876,75
PASN12	8.669.335,58	223.695,95	182.670,52	0,13%	-556.856,52	-62.639,01	152.375,67	-198.149,47
PATC11	4.453.254,00	1.974.946,21	-383.825,20	-0,27%	981.331,25	-1.177.597,49	575.452,64	-580.163,03
PCAR3	32.995,62	16.271,64	14.237,87	0,01%	4.115.653,08	-4.938.783,70	2.413.418,97	-2.433.174,10
PEJA11	5.196.985,70	215.157,41	179.862,14	0,12%	-252.286,64	-82.993,81	30.439,87	-41.151,04
PETR3	3.925.324,98	224.178,69	-122.875,63	-0,08%	45.525,73	-45.525,73	26.696,29	-26.914,81
PETRA	16.462.612,32	840.546,15	-308.051,49	-0,21%	10.606.189,95	-10.606.189,95	2.591.445,74	-2.612.658,12
PETZ3	182.102,90	40.692,93	31.069,52	0,02%	0,00	0,00	0,00	0,00
PRFZ3	17.676.963,25	1.281.014,55	-581.535,18	-0,40%	0,00	0,00	0,00	0,00
PRLG14	1.112.889,83	0,00	0,00	0,00%	2.765.194,35	-2.765.194,35	810.754,98	-817.391,45
PVBH11	2.506.754,46	89.053,63	-2.288,62	0,00%	-220.319,69	-74.666,94	25.311,23	-34.046,33
QAQR11	5.830.388,70	236.785,54	192.519,61	0,13%	524.560,68	-524.560,68	394.502,98	-387.650,34
QUAT12	3.461.061,00	44.535,83	39.034,82	0,03%	-2.179.739,63	-38.393,34	756.302,52	-947.153,52
RADL3	2.622.803,40	240.015,19	135.181,41	0,09%	9.332.830,07	-6.844.232,03	3.040.458,08	-3.065.345,87
RAHD11	16.854.395,42	742.053,67	690.948,46	0,48%	56.298,70	-56.298,70	23.581,11	-23.774,14
RAIL3	20.739.823,20	1.091.487,87	112.845,00	0,08%	0,00	0,00	0,00	0,00
RAIZ4	160.853,42	24.428,36	12.092,25	0,01%	2.483.492,92	-2.483.492,92	364.080,06	-367.060,25
RBCAPMZ	588.523,14	1.838,39	-268,48	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
RBR11	2.483.492,92	84.007,56	34.711,44	0,02%	-2.843,59	2.291,94	3.348,55	-4.873,24
RCRB11	6.440.322,00	550.472,67	331.379,88	0,23%	580.405,56	-580.405,56	283.624,85	-285.946,47
RDCO10	3.730.052,85	819,55	785,04	0,00%	-8.790,81	4.939,94	6.645,77	-8.916,28
RDSA14	11.906.504,88	372.879,84	371.217,76	0,22%	-8.230,86	7.064,11	9.503,45	-12.750,27
RDRB9	1.144.294,68	1.977,18	1.912,06	0,00%	-932.323,05	-62.400,58	289.800,92	-369.415,73
RDRD9	1.636.341,00	2.827,36	2.734,25	0,00%	2.594.371,46	-2.594.371,46	633.891,43	-639.080,17
RDEVE11	7.984.886,11	321.849,85	290.883,35	0,20%	0,00	0,00	0,00	0,00
RECV3	4.323.952,44	848.847,54	562.306,20	0,39%	5.725.298,61	-4.325.220,35	2.482.078,15	-2.502.395,30
RENT1	17.080,00	17.126,23	14.402,16	0,01%	-355.944,19	-32.589,75	105.686,77	-136.094,98
RENT3	16.930.956,00	2.800.976,66	2.564.656,29	1,77%	-224,17	182,61	312,47	-463,66
RIS412	2.907.219,11	131.322,73	114.502,96	0,08%	-1.994.012,35	85.704,67	782.529,89	-963.937,81
RLOG11	1.040.096,24	45,52	43,20	0,00%	-22.853,03	19.292,39	25.974,63	-35.413,42
RMSA12	12.058.492,17	672.618,33	644.449,83	0,45%	88.505,78	-88.505,78	21.624,91	-21.801,93
RODB11	2.867.715,28	7.796,43	7.528,52	0,01%	-212,17	171,17	271,29	-399,70
RRRP3	147.509,64	28.338,64	-20.288,20	-0,01%	-1.042.677,66	-168.004,92	242.788,49	-318.654,74
RSANZ4	807.880,54	51,89	49,51	0,00%	89.845,68	-89.845,68	65.856,88	-66.395,96
RSANZ4	11.906.504,88	372.879,84	371.217,76	0,22%	164.337,30	-219.116,40	90.305,16	-90.963,51
SANB11	449.228,40	36.093,51	11.798,06	0,01%	1.238.536,37	-1.238.536,37	726.277,73	-732.222,70
SBFZ3	547.791,00	160.626,24	115.300,55	0,08%	-461.980,33	-160.335,46	42.144,00	-56.858,83
SBSF3	4.954.145,47	471.334,05	406.148,11	0,28%	-4.605,84	3.747,84	5.154,49	-7.357,63
SBSF7	2.358.905,99	1.513,71	1.453,06	0,00%	105.600,00	-105.600,00	25.801,60	-26.012,80
SCAR3	176.000,00	32.987,18	20.416,00	0,01%	8.475,12	-8.326,72	4.094,37	-4.127,89
SLCE3	27.928,88	1.745,53	1.095,58	0,00%	-15.903,77	13.089,45	17.777,22	-25.036,70
SMFT16	5.790.479,66	5.331,98	5.127,74	0,00%	989.140,00	-989.140,00	362.519,81	-365.487,23
SMFT3	2.472.850,00	416.143,04	388.667,37	0,27%	10.358,15	-10.358,15	5.061,69	-5.103,12
SMT03	34.527,18	4.747,18						

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2023



bradesco

Data: 29/12/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS
CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais	
PL:	4.694.579,032,07
VAR:	144.645.147,23
ETL:	161.390.850,13
VAR / PL:	3,0811%
ETL / PL:	3,8638%
VAR / CDI:	0,0341%
Limite Fundo:	0,00%
Status:	ENQUADRADO
Benchmark:	
Dutacion DC:	1.758,64
Dutacion DU:	1.208,97

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	165.882.715,13	Cenário Baixa - 10000 (+):	301.132.253,10	CENARIO BRADESCO 1 (+):	362.377.530,17	CENARIO BRADESCO 2 (+):	28.883.039,00
Cenário Alta - 09999 (-):	(251.677.958,69)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(200.834.132,83)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(96.696.170,60)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(326.420.861,79)
Cenário Alta - 09999:	(85.795.243,56)	Cenário Baixa - 10000:	100.298.120,27	CENARIO BRADESCO 1:	265.681.359,57	CENARIO BRADESCO 2:	(297.537.822,79)

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
SOMA3	3.795.298,20	1.082.879,08	1.003.348,75	0,69%	2.713.826,11	-2.171.060,88	1.591.387,63	-1.604.413,99
SUZB3	10.855.304,42	782.500,37	-31.835,59	-0,02%	48.282,04	-48.282,04	28.312,59	-28.544,34
TAE11	193.128,16	11.288,06	7.477,14	0,01%	-120.590,57	-23.853,50	19.331,37	-26.092,51
TBSP1	2.689.072,26	1.198,67	1.150,84	0,00%	-3.731,99	3.049,68	4.260,43	-6.078,52
TCI11	10.552.788,17	476.223,30	446.920,58	0,31%	-1.405.712,53	4.691,20	506.555,57	-630.224,62
TEPP11	5.798.470,60	185.536,90	18.451,20	0,01%	2.899.235,30	-2.899.235,30	850.055,79	-857.013,96
TERMO_RF_PRE	-266.822,03	2.005,68	-1.924,53	0,00%	7.131,60	-5.622,34	-8.150,00	11.945,28
TIMS3	907.078,70	48.869,40	31.630,87	0,02%	290.265,18	-208.628,10	132.977,74	-134.066,23
TOTS3	1.240.331,04	215.035,83	83.889,69	0,06%	248.066,21	-248.066,21	181.832,53	-183.320,93
TRPL4	534.664,00	84.965,15	76.812,51	0,05%	106.932,80	-133.666,00	78.351,74	-79.923,34
TRXF11	8.423.603,25	324.307,12	266.255,86	0,18%	4.211.801,63	-4.211.801,63	1.234.900,24	-1.245.008,56
UGPA3	12.769.495,86	1.358.888,78	292.435,04	0,20%	3.192.373,97	-2.553.899,17	1.872.008,09	-1.887.331,49
UNEG11	10.978.085,64	548.057,59	516.342,91	0,36%	-1.602.031,36	14.382,75	590.724,62	-737.441,40
USIM5	106.045,35	22.252,69	20.541,66	0,01%	41.357,69	-23.329,98	15.546,25	-15.673,50
UTPS21	6.733.489,96	323.655,42	292.694,08	0,20%	-905.553,19	-42.701,00	297.897,11	-378.472,38
VALE3	22.853.516,00	1.915.943,52	565.058,79	0,39%	5.713.379,00	-5.713.379,00	3.350.325,45	-3.377.749,67
VAMO22	1.101.878,45	129,84	124,33	0,00%	-469,46	378,03	571,06	-835,21
VAMO3	34.691,15	8.194,44	7.530,64	0,01%	12.141,90	-18.876,46	5.085,72	-5.127,35
VAMO33	11.791.072,42	544.035,92	443.590,92	0,31%	-1.349.009,37	-137.302,66	377.672,74	-491.212,74
VAMO34	7.506.623,62	337.979,22	280.580,32	0,19%	-865.033,09	-90.912,83	242.946,96	-315.426,47
VBBR3	6.028.236,36	478.258,17	-81.138,59	-0,06%	1.507.059,09	-1.507.059,09	883.739,45	-890.973,33
VCCS11	700.807,98	864,19	833,41	0,00%	-2.521,66	2.116,28	2.841,88	-3.909,34
VFC511	3.684.627,81	132,07	124,59	0,00%	-670,54	541,78	888,71	-1.317,52
VERDECS2	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
VERO12	5.070.450,70	181.282,94	146.872,40	0,10%	-458.783,39	-64.380,60	111.732,45	-146.930,97
VIMT13	7.407.707,15	330.764,12	297.484,26	0,21%	-929.494,65	-53.053,34	296.782,95	-377.912,01
VIVT3	1.152.540,48	72.503,11	388,24	0,00%	183.793,97	-164.815,01	168.962,43	-170.345,48
VIXL14	1.207.400,74	101,24	96,59	0,00%	-406,40	328,78	517,40	-761,53
VRDN12	5.197.874,68	219.765,96	193.344,01	0,13%	-605.377,32	-54.454,54	178.323,90	-229.408,16
VVEO15	1.084.671,20	365,88	350,99	0,00%	-1.145,40	926,50	1.294,49	-1.861,47
VVEO16	1.068.408,77	449,62	431,45	0,00%	-1.377,84	1.120,83	1.556,15	-2.227,37
VVRT11	2.594.218,61	697,25	668,80	0,00%	-2.260,97	1.835,14	2.613,11	-3.762,86
WDOF24	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
WDOG24	-1.713,10	31.675,61	11.529,81	0,01%	-94.852,48	101.004,55	-126.362,61	127.051,29
WEGE3	3.015.953,01	367.322,12	305.461,69	0,21%	753.988,25	-753.988,25	442.138,71	-445.757,86
WIMG24	0,00	168.301,14	162.341,81	0,11%	492.019,55	-491.005,13	387.693,15	-389.555,16
XPNH1	2.471.764,00	77.223,54	-23.276,64	-0,02%	1.235.882,00	-1.235.882,00	362.350,60	-365.325,72
XPPR11	2.368.208,80	574.608,70	403.801,31	0,28%	1.184.104,40	-1.184.104,40	347.179,41	-350.021,26
YDUQ3	740.958,58	125.315,70	110.969,37	0,08%	288.973,85	-185.239,65	108.624,53	-109.513,68
Total Var:	4.939.987.523,54	180.629.841,64	144.645.147,23	99,98%	-85.795.243,57	100.298.120,26	265.681.359,56	-297.537.822,81

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: EMBRAERPREV RENDA FIXA
CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais	
PL:	3.781.411.207,79
VAR:	115.203.248,54
ETL:	144.469.521,38
VAR / PL:	3,0466%
ETL / PL:	3,8205%
VAR / CDI:	0,0337%
Limite Fundo:	0,00%
Status:	ENQUADRADO
Benchmark:	
Dutacion DC:	2.102,29
Dutacion DU:	1.445,51

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (+):	244.786.616,98	CENARIO BRADESCO 1 (+):	193.819.501,97	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
Cenário Alta - 09999 (-):	(227.656.380,60)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(4.642.040,25)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(223.010.644,37)
Cenário Alta - 09999:	(227.656.380,60)	Cenário Baixa - 10000:	240.144.576,73	CENARIO BRADESCO 1:	193.819.501,97	CENARIO BRADESCO 2:	(223.010.644,37)

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
GAXA	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
FI RF EMB II	3.075.021.532,71	95.566.050,09	95.144.912,69	82,59%	-166.282.177,26	236.974.574,40	172.491.513,16	-196.658.669,45
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	138.288.047,84	2.323.162,75	1.787.241,20	1,55%	-7.847.141,35	-1.289.358,24	1.556.448,03	-2.060.358,98
FIM EMB II A	224.705.774,36	1.169.208,42	1.122.168,10	0,97%	-2.271.116,99	2.463.487,53	1.721.042,86	-2.352.674,36
FIM EMB VII A CRED PRIV	270.297.101,94	4.733.736,92	4.594.557,53	3,99%	-11.309.572,51	5.328.855,05	6.129.240,19	-6.695.312,76
FIM EMB VII A CRED PRIV	371.919.621,11	14.306.078,70	12.554.268,62	10,90%	-40.146.372,39	-3.352.692,01	11.921.257,73	-15.243.828,82
Total Var:	4.080.232.077,96	118.098.236,89	115.203.248,54	100,00%	-227.656.380,60	240.144.576,73	193.819.501,97	-223.010.644,37

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2023



Relatório de Risco de Mercado

Data: 29/12/2023

FUNDO:		EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL							
CNPJ:		10679245000140							
Dados Gerais									
PL:	543.225.994,23	VAR / PL:	6,9902%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	5,05		
VAR:	37.972.329,96	ETL / PL:	8,7659%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1,72		
ETL:	47.618.833,71	VAR / CDI:	0,0773%	Benchmark:					
Cenários de STRESS									
Cenário Alta - 09999 (+):	130.883.641,24	Cenário Baixa - 10000 (+):	-	CENARIO BRADESCO 1 (+):	69.488.896,89	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-		
Cenário Alta - 09999 (-):	-	Cenário Baixa - 10000 (-):	(128.436.205,38)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(70.059.450,70)		
Cenário Alta - 09999:	130.883.641,24	Cenário Baixa - 10000:	(128.436.205,38)	CENARIO BRADESCO 1:	69.488.896,89	CENARIO BRADESCO 2:	(70.059.450,70)		
Parâmetros do Cálculo									
Modelo:	VaR paramétrico	Modelo Volatilidade:	EWMA						
Int. Confiança:	95	Lambda:	0,94						
Horizonte:	21								
Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2	
CAIXA	110.000.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
FIA RVA EMB II	115.700.647,65	8.449.168,69	8.434.780,89	22,21%	30.014.905,89	-30.329.131,78	16.489.627,52	-16.623.499,84	
FIA RVA EMB III	118.712.945,01	9.427.968,43	9.236.944,02	24,33%	32.966.488,86	-31.743.339,77	14.911.897,74	-15.038.024,15	
FIA RVA EMB IV	110.594.038,06	6.858.745,48	6.667.516,87	17,56%	29.693.967,87	-27.824.924,48	14.824.124,46	-14.945.999,73	
FIC FIA EMB VIII ETF	75.266.331,89	5.202.906,13	5.186.960,82	13,66%	6.768.763,31	-6.768.785,16	5.514.167,09	-5.589.884,15	
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	122.932.580,61	8.478.601,72	8.446.127,37	22,24%	31.440.115,32	-31.770.024,19	17.749.080,09	-17.892.042,83	
Total Var:	663.206.543,23	38.417.390,44	37.972.329,96	100,00%	130.883.641,24	-128.436.205,38	69.488.896,89	-70.059.450,70	

Relatório de Risco de Mercado

Data: 29/12/2023

FUNDO:		FI RF EMB II							
CNPJ:		11005764000196							
Dados Gerais									
PL:	2.882.827.895,82	VAR / PL:	3,3150%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	2,402,67		
VAR:	95.566.048,08	ETL / PL:	4,1572%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1,652,00		
ETL:	119.843.679,77	VAR / CDI:	0,0367%	Benchmark:					
Cenários de STRESS									
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (+):	237.726.461,02	CENARIO BRADESCO 1 (+):	172.491.509,53	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-		
Cenário Alta - 09999 (-):	(166.282.173,77)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(751.891,59)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(196.658.665,32)		
Cenário Alta - 09999:	(166.282.173,77)	Cenário Baixa - 10000:	236.974.569,42	CENARIO BRADESCO 1:	172.491.509,53	CENARIO BRADESCO 2:	(196.658.665,32)		
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	
CSMGC3	11.104.931,98	85.963,98	38.488,30	0,04%	0,00	0,00	0,00	0,00	
ELET42	14.819.690,09	549.717,97	403.293,68	0,42%	0,00	0,00	0,00	0,00	
ENTV12	13.866.857,57	552.130,44	413.493,89	0,43%	-25.567,41	26.075,08	100.974,97	-153.687,95	
GASP17	50.159.560,77	338.275,16	285.878,91	0,30%	0,00	0,00	0,00	0,00	
IGSN15	2.824.242,84	109.118,10	89.025,78	0,09%	-337.636,48	-108.963,09	34.389,39	-46.397,39	
NEOE16	7.603.540,93	292.349,56	212.031,54	0,22%	0,00	0,00	0,00	0,00	
NTNB20240815 - 760199_VENCIMENTO	125.284.327,15	203.664,24	72.923,35	0,08%	-1.344.374,99	-179.529,69	328.676,90	-433.176,86	
NTNB20260815 - 760199_VENCIMENTO	43.531.840,53	746.949,01	708.707,65	0,74%	-1.380.495,35	-170.520,46	356.604,79	-465.835,56	
NTNB20300815 - 760199_VENCIMENTO	27.416.919,73	788.118,76	783.402,01	0,82%	-1.453.318,17	1.681.473,15	1.136.324,26	-1.497.115,70	
NTNB20350515 - 760199_VENCIMENTO	245.557.293,94	9.397.194,95	9.374.800,62	9,91%	-304.552,68	-31.808,49	86.624,05	-111.669,77	
NTNB20400815 - 760199_VENCIMENTO	31.287.129,90	1.376.728,10	1.375.105,19	1,44%	-699.844,93	-87.394,43	174.781,58	-230.154,27	
NTNB20450515 - 760199_VENCIMENTO	236.207.717,60	11.811.910,73	11.809.653,93	12,36%	-1.064.752,10	1.190.525,05	740.222,08	-997.427,49	
NTNB20500815 - 760199_VENCIMENTO	765.418.273,34	43.882.867,61	43.871.413,88	45,91%	-1.144.315,82	1.242.297,25	809.262,44	-1.073.447,09	
NTNB20550515 - 760199_VENCIMENTO	238.600.235,57	15.125.451,20	15.118.406,86	15,82%	-1.472.323,07	1.568.883,85	1.170.993,58	-1.502.835,98	
PETR45	9.359.328,60	176.552,46	21.655,73	0,02%	-18.612.359,76	22.033.760,17	16.808.330,73	-20.785.303,68	
SBSP2C	10.047.797,98	55.462,97	30.282,80	0,03%	-2.935.475,14	3.658.085,91	2.790.518,22	-3.325.883,75	
BBTOPIND	339.585.881,08	10.974.942,16	10.954.362,71	11,46%	-22.164.686,37	37.511.222,63	25.302.873,11	-29.204.066,21	
CAIXA	5.000,00	0,00	0,00	0,00%	-84.563.806,31	125.592.038,64	91.332.308,70	-102.465.506,64	
COMPROMISSADA_PRE	902.429.936,63	11.018,73	3.121,46	0,00%	-28.264.825,95	43.222.099,28	31.265.925,62	-34.292.816,12	
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-89.038,10	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-252.285,64	-82.993,81	30.439,87	-41.151,04	
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-261.543,61	-90.771,65	23.859,23	-32.189,82	
Total Var:	3.075.021.488,14	96.477.416,14	95.566.048,08	99,99%	-166.282.173,77	236.974.569,42	172.491.509,53	-196.658.665,32	

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2023



Relatório de Risco de Mercado

Data: 29/12/2023

FUNDO: FI RF EMB V CREDITO PRIVADO
CNPJ: 20726178000121

Dados Gerais					
PL:	131.269.357,30	VAR / PL:	1,7698%	Limite Fundo:	0,00%
VAR:	2.323.162,75	ETL / PL:	2,2194%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	2.913.339,81	VAR / CDt:	0,0196%	Benchmark:	Dutacion DC: Dutacion DU:
					769,28 529,09

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (+):	347.956,05	CENARIO BRADESCO 1 (+):	1.556.448,03
Cenário Alta - 09999 (-):	(7.647.141,35)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(1.637.314,29)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-
Cenário Alta - 09999:	(7.647.141,35)	Cenário Baixa - 10000:	(1.289.358,24)	CENARIO BRADESCO 1:	1.556.448,03
				CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	(2.060.358,98)
				CENARIO BRADESCO 2:	(2.060.358,98)

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	7.770.184,18	119.914,48	116.997,34	5,04%	-447.273,45	-118.600,14	69.844,71	-33.348,59
AEGP23	15.103.778,96	183.890,12	157.452,43	6,78%	-599.434,24	-198.759,38	60.469,78	-81.617,44
CCRDD1	3.186.891,82	40.630,81	35.974,73	1,55%	0,00	0,00	0,00	0,00
CMDT33	1.445.612,81	7.999,47	7.178,87	0,31%	-101.012,07	-20.900,41	15.232,70	-20.554,12
ENJG21	1.664.679,76	24.709,56	23.975,63	1,03%	-37.726,47	-13.084,04	3.445,69	-4.648,78
ENM21	1.063.455,14	16.181,26	15.633,86	0,67%	-63,78	65,05	251,91	-383,41
ENTV12	18.229.139,85	725.821,47	714.002,42	30,73%	0,00	0,00	0,00	0,00
ERDV17_VENCIMENTO	13.216.527,90	146.158,68	122.746,09	5,28%	0,00	0,00	0,00	0,00
ERDV36	2.124.979,77	27.295,66	24.234,02	1,04%	-96.031,88	-25.460,66	14.503,81	-19.408,35
GASP17	10.377.840,16	69.987,96	41.873,43	1,80%	-63.127,47	-16.835,66	9.568,79	-12.801,91
GRRB24_VENCIMENTO	16.548.854,95	638.709,40	629.409,04	27,09%	-1.814.776,17	-224.163,35	467.472,14	-612.379,66
LFSN16000GM	15.003.051,11	156.696,19	118.498,05	5,10%	-475.219,31	-147.687,37	45.528,96	-61.479,16
LFSN18000DC5	4.983.274,32	57.013,23	49.743,76	2,14%	-68.404,87	-14.120,95	10.369,18	-13.991,12
OMGE31	13.432.513,73	181.185,49	166.130,37	7,15%	-300.686,52	347.891,00	235.101,57	-309.748,08
SBSPC2	7.700.236,38	42.504,63	38.154,61	1,64%	-1.510.623,57	-183.722,22	378.944,91	-499.180,69
TAE33	4.208.172,91	78.490,29	61.153,20	2,63%	-631.036,18	-173.788,76	75.551,65	-101.923,48
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	-309.238,69	-114.252,35	29.579,09	-39.862,00
COMPROMISSADA_PRE	2.251.327,48	27,49	4,90	0,00%	-871.459,50	-292.521,69	102.967,00	-136.270,68
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-23.473,30	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-200.436,72	-69.563,81	18.284,77	-24.669,01
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-120.590,57	-23.853,50	19.331,37	-26.092,51
Total Var:	138.288.047,83	2.522.216,19	2.323.162,75	99,98%	-7.647.141,35	-1.289.358,24	1.556.448,03	-2.060.358,98

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2023



Data: 29/12/2023

Relatório de Risco de Mercado

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

Dados Gerais		Limite Fundo:		0,00%		Dutacion DC:		749,87	
PL:	255.921.292,00	VAR / PL:	1,8497%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:			515,27
VAR:	4.733.736,92	ETL / PL:	2,3196%	Benchmark:					
ETL:	5.936.297,07	VAR / CDI:	0,0205%						

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	391.642,38	Cenário Baixa - 10000 (+):	6.115.789,93	CENARIO BRADESCO 1 (+):	6.470.091,51	CENARIO BRADESCO 2 (+):	325.935,06
Cenário Alta - 09999 (-):	(11.701.214,99)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(787.234,88)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(340.851,31)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(7.021.247,82)
Cenário Alta - 09999:	(11.309.572,61)	Cenário Baixa - 10000:	5.328.555,05	CENARIO BRADESCO 1:	6.129.240,19	CENARIO BRADESCO 2:	(6.695.312,76)

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
020913	1.438.254,02	41.523,29	10.420,87	0,22%	0,00	0,00	0,00	0,00
AEQPA1	1.936.635,24	2.362,88	2.308,20	0,05%	-6.947,11	5.775,59	7.816,19	-10.873,28
AMBP13	2.696.794,14	1.163,64	1.134,74	0,02%	-3.687,38	2.996,45	4.198,10	-6.017,78
APRB28	1.128.923,15	131,53	128,16	0,00%	-426,91	345,26	489,44	-706,67
BCBF15	2.027.193,13	141,04	136,60	0,00%	-630,90	514,58	846,12	-1.251,85
BKBR18	1.053.525,74	1,34	0,94	0,00%	-23,19	22,32	52,87	-79,70
BRELETRO	2.257.726,38	30.327,75	-14.612,07	-0,31%	0,00	0,00	0,00	0,00
BRKPA0	3.342.353,17	1.958,85	1.909,39	0,04%	-6.022,58	4.887,77	6.810,97	-9.782,78
CAIXA	10.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CART13	1.008.650,87	43.328,97	39.903,90	0,84%	-119.573,54	-10.390,67	35.490,80	-45.601,70
CBAN22	4.366.531,03	29.352,20	28.445,75	0,60%	-75.145,86	66.537,75	83.145,66	-106.458,30
CCPRA3	41.601,15	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CEAB22	538.915,21	271,84	265,16	0,01%	-844,18	690,02	962,85	-1.373,75
CELG12	3.357.084,81	353,01	343,02	0,01%	-1.362,57	1.089,01	1.655,03	-2.432,04
CLH12	2.550.781,94	6.187,33	6.049,28	0,13%	-18.217,41	15.492,50	20.917,42	-28.203,09
COMPROMISSADA_PRE	80.689.042,99	985,22	201,64	0,00%	-2.286,06	2.331,45	9.028,48	-13.741,71
GONTAS_A_PAGAR_RECEBER	58.768,63	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CSAN23	1.155.343,76	2.081,15	2.034,61	0,04%	-6.094,62	5.198,42	6.992,17	-9.383,00
CSMG88	2.847.700,68	104.718,66	90.938,45	1,92%	-265.401,16	-36.280,28	65.382,54	-85.913,23
DAPK25	17.622,46	371.385,82	347.284,12	7,34%	-1.023.548,90	973.873,81	675.137,02	-672.321,92
DAPK27	10.160,46	718.109,68	696.882,91	14,72%	-1.192.301,50	1.068.653,95	908.708,95	-889.740,75
DAPK35	-311,24	48.909,68	-46.123,92	-0,97%	106.680,50	-98.544,41	-96.324,72	89.584,68
DAPQ24	18.308,51	145.735,14	36.150,32	0,76%	-499.981,35	529.957,25	388.119,60	-388.715,35
DAPQ26	28.561,21	1.509.570,42	1.462.444,20	30,89%	-2.496.702,28	2.267.471,75	1.831.096,70	-1.805.022,33
DAPQ28	2.684,21	224.225,81	218.051,39	4,61%	-414.121,19	368.207,46	330.113,09	-319.697,99
DAPQ30	-1.315,67	137.677,41	-132.962,69	-2,81%	278.745,24	-248.475,41	-232.795,65	221.559,77
DAPQ32	715,72	91.435,50	86.962,46	1,84%	-190.721,15	173.681,93	166.581,42	-158.352,10
DASAA2	1.313.421,66	3,55	3,04	0,00%	-43,18	38,63	80,44	-120,82
DESK13	2.704.799,22	1.622,44	1.583,51	0,03%	-4.960,78	4.076,93	5.638,94	-7.987,52
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ELET24	2.742.395,08	1.794,99	1.752,01	0,04%	-5.310,59	4.374,62	5.952,02	-8.379,50
GUAR15	2.636.090,20	828,52	807,06	0,02%	-2.734,95	2.214,25	3.190,03	-4.617,70
HZTC14	2.559.044,63	105.638,05	97.870,64	2,07%	-296.598,26	-26.617,45	87.569,05	-112.407,67
IDIF24P380200	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
IDIF24P380300	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
IGTA37	2.132.335,84	387,57	-367,05	-0,01%	2.463,25	-1.984,81	-3.350,68	5.054,97
INSSSN1	1.907.325,67	128.572,77	-11.191,46	-0,24%	0,00	0,00	0,00	0,00
IRJ514	1.792.587,69	102.068,37	99.202,33	2,10%	-301.993,61	16.199,41	120.563,64	-148.045,07
ISMLB5	3.455.791,80	153.032,23	133.853,76	2,83%	-389.563,67	-41.416,75	106.778,49	-141.321,15
LCAMA9	1.980.166,83	170,15	165,13	0,00%	-721,91	915,36	915,36	-1.349,68
LCAMD1	5.338.915,48	243.925,93	213.348,58	4,51%	-618.520,76	-63.895,28	174.324,32	-226.366,04
LF01800FAU	4.607.183,33	209.041,72	169.157,99	3,57%	-437.897,31	-35.683,68	119.099,30	-156.826,44
LF002100301	2.478.637,55	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002200109	2.463.049,98	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF00230695Q	5.263.813,92	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF00230628P	5.221.857,73	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0023062K1	5.238.416,97	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFSC190054B	899.780,51	0,00	0,00	0,00%	1.031,80	-894,56	-1.780,16	2.716,23
LFSC190059S	1.362.861,41	0,00	0,00	0,00%	1.586,46	-1.372,76	-2.718,41	4.147,95
LFSC19005L1	901.564,82	0,00	0,00	0,00%	1.127,13	-967,50	-1.871,47	2.855,92
LFSC22002IX	4.711.506,76	3.367,60	3.282,20	0,07%	-10.262,74	8.332,77	11.498,62	-16.456,90
LFSN210029N	4.438.354,43	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFSN2301ERT	4.312.519,09	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20240301 - 210100	11.153.176,15	58,24	-21,68	0,00%	-4.112,13	4.428,45	-8,56	13,04
LFT20240901 - 210100	1.198.042,25	18,81	-7,38	0,00%	-2.019,54	2.417,77	-1,66	2,52
LIGHB4	2.388.756,42	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LIGHD3	944.077,40	695,84	682,14	0,01%	-2.063,07	1.702,49	2.312,51	-3.250,52
LRENB1	1.407.232,54	7,70	7,22	0,00%	52,85	52,85	101,96	-162,62
MOVIZ7	1.193.646,89	1.723,03	1.683,15	0,04%	-5.065,88	4.214,15	5.702,37	-7.927,75
MTRJ19	2.856.442,38	99.513,60	87.883,17	1,86%	-268.209,82	-37.034,68	67.138,85	-87.752,65
NTEN11	3.186.887,42	96.801,84	84.554,06	1,79%	-266.136,88	-44.759,78	59.717,23	-78.655,92
NTNB20240815 - 760199_NEGOCIACAO	106.454,63	173,05	88,54	0,00%	-904,73	1.011,59	628,97	-847,52
NTNB20250515 - 760199_NEGOCIACAO	593.818,95	4.108,80	3.816,62	0,08%	-10.669,43	10.747,99	6.332,15	-8.484,68
NTNB20260815 - 760199_NEGOCIACAO	2.463.902,17	42.277,31	40.808,82	0,86%	-64.768,28	70.314,02	45.804,25	-60.757,11
NTNB20270515 - 760199_NEGOCIACAO	706.374,02	15.019,47	14.522,21	0,31%	-22.619,73	25.203,05	16.944,19	-22.328,78
NTNB20280815 - 760199_NEGOCIACAO	5.904.230,75	143.672,12	138.991,04	2,94%	-243.839,06	256.219,57	184.598,61	-240.816,35
NTNB20290815 - 760199_NEGOCIACAO	947.762,07	53.992,99	50.941,81	1,08%	-104.046,36	154.527,04	112.374,25	-126.072,41
OMGE13	2.167.442,43	1.646,38	1.607,91	0,03%	-4.891,98	4.052,88	5.521,59	-7.725,08
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
OVSAN10	1.779.666,52	311,77	303,06	0,01%	-1.168,86	938,11	1.399,77	-2.050,04
PASN12	4.038.616,73	104.206,35	90.967,32	1,92%	-293.463,14	-51.622,25	64.083,66	-84.440,20
RAHD11	3.579.657,55	157.602,69	150.869,74	3,19%	-462.948,76	-8.154,25	160.628,96	-201.163,27
RECAPMZ	588.523,14	1.838,39	-197,65	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
RDCO10	3.730.052,85	819,55	797,95	0,02%	-2.843,59	2.291,84	3.348,55	-4.873,24
RDORB8	1.144.294,68	1.977,18	1.932,97	0,04%	-5.790,81	4.939,94	6.646,77	-8.916,28
RDROR3	1.636.341,40	2.827,36	2.764,14	0,05%	-8.280,86	7.064,11	9.503,45	-12.750,27
RIS412	2.907.219,11	131.322,73	119.896,47	2,53%	-355.944,19	-32.569,75	105.686,77	-136.094,98
RLOG11	1.040.096,24	45,52	44,06	0,00%	-224,17	182,61	312,47	-463,66
RODB11	2.867.715,28	7.796,43	7.621,58	0,16%	-22.853,03	19.292,39	25.974,63	-35.413,42
RSAN24	807.880,54	51,89	50,40	0,00%	-212,17	171,17	271,29	-399,70
RSAN44	912.869,29	28.588,38	25.347,44	0,54%	-79.941,21	-12.880,80	18.614,39	-24.430,99
SMFT16	2.529.137,67	2.328,88	2.273,51	0,05%	-6.946,37	5.717,15	7.764,65	-10.935,41
SNGO18	1.620.146,19	86,09	83,32	0,00%	-400,57	326,05	535,67	-792,65

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2023



Relatório de Risco de Mercado

Data: 29/12/2023

FUNDO: FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO
CNPJ: 4183766000109

Dados Gerais							
PL:	255.921.292,00	VAR / PL:	1,8497%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	749,87
VAR:	4.733.736,92	ETL / PL:	2,3196%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	515,27
ETL:	5.936.297,07	VAR / CDI:	0,0205%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	391.642,38	Cenário Baixa - 10000 (+):	6.115.789,93	CENARIO BRADESCO 1 (+):	6.470.091,51	CENARIO BRADESCO 2 (+):	325.935,06
Cenário Alta - 09999 (-):	(11.701.214,99)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(787.234,88)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(340.851,31)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(7.021.247,82)
Cenário Alta - 09999:	(11.309.572,61)	Cenário Baixa - 10000:	5.328.555,05	CENARIO BRADESCO 1:	6.129.240,19	CENARIO BRADESCO 2:	(6.695.312,76)

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
TBSP11	2.689.072,26	1.198,67	1.169,30	0,02%	-3.731,99	3.049,68	4.260,43	-6.078,52
UNEG11	4.969.623,03	248.097,87	238.622,59	5,04%	-725.216,79	6.510,87	267.412,63	-333.829,22
VAMO33	2.891.445,57	133.410,28	115.352,86	2,44%	-330.808,52	-33.669,81	92.614,15	-120.456,81
VCCS11	700.807,98	864,19	844,50	0,02%	-2.521,66	2.115,28	2.841,88	-3.909,34
VECS11	3.684.527,81	132,07	127,46	0,00%	-670,54	541,73	888,71	-1.317,52
VERDECS2	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
VXL14	1.207.400,74	101,24	98,31	0,00%	-406,40	328,78	517,40	-761,53
VVEO15	1.084.671,20	365,88	356,68	0,01%	-1.145,40	926,50	1.294,49	-1.861,47
VVEO16	1.068.408,77	449,62	438,44	0,01%	-1.377,84	1.120,83	1.556,15	-2.227,37
VVRT11	2.594.218,61	697,25	679,70	0,01%	-2.260,97	1.835,14	2.613,11	-3.762,86
Total Var:	270.297.101,93	5.747.274,55	4.733.736,92	100,01%	-11.309.572,61	5.328.555,05	6.129.240,19	-6.695.312,76

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2023



Data: 29/12/2023

Relatório de Risco de Mercado

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

		Dados Gerais			
PL:	299.804.858,11	VAR / PL:	4,7650%	Limite Fundo:	0,00%
VAR:	14.285.716,73	ETL / PL:	5,9755%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	17.914.865,11	VAR / CDI:	0,0527%	Benchmark:	Dutacion DC: 1.937,24 Dutacion DU: 1.332,53

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (+):	146.712,99	CENARIO BRADESCO 1 (+):	11.904.290,09
Cenário Alta - 09999 (-):	(40.089.231,67)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(3.494.623,10)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-
Cenário Alta - 09999:	(40.089.231,67)	Cenário Baixa - 10000:	(3.347.910,11)	CENARIO BRADESCO 1:	11.904.290,09
				CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	(15.221.932,42)
				CENARIO BRADESCO 2:	(15.221.932,42)

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
ANEM11	11.177.716,65	499.411,91	494.515,36	3,46%	-1.462.771,46	-36.030,78	500.622,83	-629.399,35
ANET11	2.290.451,76	51.548,09	50.241,90	0,35%	-152.403,27	-31.444,59	29.747,40	-39.437,43
ASAB11	6.408.326,18	238.878,19	236.036,77	1,67%	-646.941,98	-74.820,61	176.533,70	-228.900,17
BRPK28	11.037.063,53	545.826,91	542.049,97	3,79%	-1.536.209,92	-115.127,00	485.930,06	-621.004,24
BTOW16	5.659.926,28	308.826,52	307.335,14	2,15%	-789.167,61	-69.269,05	235.648,10	-304.793,72
CAEC21	9.266.246,84	303.004,25	297.979,99	2,09%	-793.433,25	-125.903,91	180.979,54	-239.168,33
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CART13	10.282.999,16	441.730,43	441.582,48	3,09%	-1.219.028,89	-105.930,83	361.821,79	-464.900,42
CBAN32	17.047.703,75	762.175,08	761.048,41	5,33%	-2.020.681,02	-174.055,94	600.627,81	-773.867,01
CBANT2	5.001.126,22	229.656,64	229.404,46	1,61%	-612.459,11	-49.972,77	184.953,90	-237.913,59
CJEN13	7.294.000,71	302.292,32	302.129,60	2,11%	-850.001,94	-72.473,70	253.101,18	-324.595,29
CNRD11	10.044.045,21	456.614,29	454.809,85	3,18%	-1.289.697,95	-86.119,98	405.638,06	-517.689,52
COMPROMISSADA_PRE	14.453.726,18	176,48	41,89	0,00%	-409,50	417,63	1.617,26	-2.461,54
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-144.908,96	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CONX12	9.755.487,79	313.058,93	308.224,10	2,16%	-833.799,28	-134.618,87	190.447,41	-251.233,43
CREDZM24	210.806,29	77.106,20	67.461,21	0,47%	0,00	0,00	0,00	0,00
CRMG15	9.129.809,67	303.260,57	300.051,11	2,10%	-831.298,91	-125.256,99	199.857,81	-261.789,60
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ERDV17	10.053.372,22	111.178,03	77.347,71	0,54%	-361.483,49	-112.340,86	34.632,36	-46.765,15
ERDV38	6.077.400,65	74.016,20	68.501,40	0,49%	-369.164,42	-123.912,16	42.358,67	-56.933,33
GBSP11	5.363.879,01	278.051,17	269.033,68	1,88%	-834.376,86	48.127,60	333.968,70	-408.039,33
GRRB24	8.624.810,40	332.877,86	323.905,03	2,27%	-787.295,67	-95.750,99	197.495,72	-260.159,32
HARG11	11.240.240,43	482.554,30	479.795,57	3,36%	-1.392.676,62	-69.255,82	453.196,13	-574.558,09
HVRD15	11.690.020,05	568.322,30	567.924,15	3,98%	-1.531.980,23	-101.696,59	478.203,46	-612.616,97
IPIL11	8.093.949,90	298.504,21	298.402,72	2,09%	-843.533,76	-86.451,04	237.473,77	-305.864,65
IRBR12	11.677.993,86	204.538,02	188.345,85	1,32%	-833.128,68	-239.591,00	123.604,68	-165.427,91
ITPO14	8.946.642,21	449.725,20	447.803,75	3,13%	-1.255.314,70	-52.081,21	417.155,61	-529.439,73
LAMEA6	9.641.970,17	413.301,73	409.884,73	2,87%	-1.063.187,04	-116.663,88	294.436,26	-382.605,45
LCAMD1	11.794.999,03	538.893,37	534.194,12	3,74%	-1.366.466,98	-141.160,65	385.126,01	-500.099,17
LORTA7	6.700.406,54	312.441,57	309.739,08	2,17%	-791.918,41	-81.678,15	223.550,96	-290.335,30
MOVI37	9.094.025,58	407.291,42	403.698,75	2,83%	-1.035.929,88	-109.454,86	289.854,00	-376.527,86
MTRJ19	8.498.286,10	296.065,84	293.403,47	2,05%	-797.958,95	-110.182,96	199.746,79	-261.075,51
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PASN12	4.630.818,85	119.489,60	117.475,74	0,82%	-336.503,41	-59.193,34	73.482,38	-96.624,48
PEJA11	5.196.985,70	215.157,41	213.691,27	1,50%	-556.856,52	-62.639,01	152.375,67	-198.149,47
QUAT12	3.451.061,00	44.535,83	39.406,75	0,28%	-220.319,69	-74.666,94	25.311,23	-34.046,33
RAHD11	13.274.737,87	584.450,98	578.969,70	4,05%	-1.716.790,88	-30.233,09	595.673,86	-745.990,26
RDVE11	7.984.886,11	321.849,85	321.250,61	2,25%	-932.323,05	-62.400,58	289.803,92	-368.415,73
RMSA12	12.058.492,17	672.618,33	652.017,93	4,56%	-1.994.012,35	85.704,67	782.529,89	-963.937,81
RSAN44	10.993.735,59	344.291,45	340.873,42	2,39%	-962.736,44	-155.124,13	224.174,10	-294.223,75
TCI11	10.552.788,17	476.223,30	470.463,70	3,29%	-1.405.712,53	4.591,20	506.555,57	-630.224,62
UNEG11	6.008.462,60	299.959,72	293.729,59	2,06%	-876.814,58	7.871,88	323.312,00	-403.612,18
UTPS21	6.733.489,96	323.655,42	322.384,42	2,26%	-905.553,19	-42.701,00	297.897,11	-378.472,38
VAMO33	8.899.626,85	410.625,65	405.513,28	2,84%	-1.018.200,85	-103.632,85	285.058,59	-370.755,94
VAMO34	7.506.623,62	337.979,22	335.689,57	2,35%	-865.033,09	-90.912,53	242.946,96	-315.426,47
VERDECS2	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
VERO12	5.070.450,70	181.282,94	177.981,15	1,25%	-458.783,39	-64.360,60	111.732,45	-146.930,97
VIMT13	7.407.707,15	330.764,12	330.018,51	2,31%	-929.494,65	-53.053,34	296.782,95	-377.912,01
VRDN12	5.197.874,68	219.765,96	219.676,82	1,54%	-605.377,32	-64.454,54	178.323,90	-229.408,16
Total Var:	371.390.264,38	14.483.976,85	14.285.716,73	100,02%	-40.089.231,67	-3.347.910,11	11.904.290,09	-15.221.932,42

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2023



Data: 29/12/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: **FIRF EMB II A CRED PRIV**
CNPJ: **20725957000102**

		Dados Gerais			
PL:	211.587.804,56	VAR / PL:	0,5227%	Limite Fundo:	0,00%
VAR:	1.105.991,37	ETL / PL:	0,6555%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	1.386.957,80	VAR / CDI:	0,0058%	Benchmark:	Dutacion DC: 707,69 Dutacion DU: 486,84

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	3.213.453,08	Cenário Baixa - 10000 (+):	4.939.385,27	CENARIO BRADESCO 1 (+):	5.210.391,95	CENARIO BRADESCO 2 (+):	5.100.970,32
Cenário Alta - 09999 (-):	(5.361.774,75)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(2.590.175,57)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(3.582.402,87)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(7.326.439,69)
Cenário Alta - 09999:	(2.148.321,67)	Cenário Baixa - 10000:	2.349.209,70	CENARIO BRADESCO 1:	1.627.989,08	CENARIO BRADESCO 2:	(2.225.469,37)

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
CAIXA	8.999,95	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CDB323R5ITI	6.352.240,43	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	4.557.117,71	55,64	10,00	0,00%	-129,11	131,68	509,91	-776,10
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	28.163,34	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CRGT16	151.321,78	11,95	-10,38	0,00%	115,71	-97,15	-178,32	271,08
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DHF25	-11.040,83	72.232,36	69.919,32	6,32%	-321.295,16	252.484,99	381.825,66	-563.420,91
DHF33	10.856,49	64.267,81	-58.241,14	-5,27%	193.675,13	-181.847,59	-251.821,23	288.777,48
DHN25	51.078,50	583.263,39	-569.277,92	-51,47%	1.837.277,50	-1.452.639,41	-2.041.995,28	2.972.807,75
DHN26	28.029,97	259.447,22	-249.530,21	-22,56%	713.993,47	-582.023,27	-766.506,38	1.083.488,57
DHV25	14.384,40	154.952,13	-150.725,12	-13,63%	456.689,40	-363.619,65	-496.399,09	717.268,85
ERDV18	1.358.575,63	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
IDIF24P381200	-122.846,85	1.910,09	-356,15	-0,03%	4.570,27	-4.326,18	-17.352,56	26.411,32
IDIF24P381300	163.629,05	1.910,59	356,25	0,03%	-4.571,47	4.327,32	17.357,12	-26.418,24
LF002200U5M	10.147.734,41	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306J15	10.550.413,31	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306SWQ	10.561.147,37	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306U55	6.339.595,34	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20260301 - 210100	185.233,34	52,15	-22,79	0,00%	-984,83	1.537,82	45,27	-68,90
LFT20260301 - 210100	1.679.516,42	534,09	-9,61	0,00%	-9.545,74	22.033,60	879,27	-1.337,78
LTN20250401 - 100000	533.720,99	4.077,10	3.994,81	0,36%	-14.543,08	10.954,81	16.227,07	-23.787,78
LTN20250701 - 100000	56.584.579,03	578.550,78	567.387,60	51,30%	-1.831.057,57	1.458.899,34	2.043.419,44	-2.974.775,65
LTN20251001 - 100000	11.730.587,08	153.635,87	150.511,37	13,61%	-449.911,29	370.397,76	497.919,43	-719.331,76
LTN20260701 - 100000	12.612.126,72	256.832,32	249.922,23	22,60%	-696.600,03	599.416,71	770.168,16	-1.088.182,44
NTNB20240815 - 760199_NEGOCIACAO	13.106.694,27	21.306,46	11.277,03	1,02%	-111.390,72	124.547,49	77.438,77	-104.346,47
NTNB20250515 - 760199_NEGOCIACAO	21.890.711,56	151.468,01	148.506,49	13,43%	-393.321,04	396.216,96	233.430,35	-312.781,77
NTNB20260815 - 760199_NEGOCIACAO	22.627.850,71	388.264,09	386.581,13	34,95%	-594.815,36	645.746,11	420.654,61	-557.977,80
NTNB20270515 - 760199_NEGOCIACAO	5.310.726,60	112.920,81	112.452,43	10,17%	-170.061,75	189.483,93	127.391,39	-167.874,33
NTNB20280815 - 760199_NEGOCIACAO	15.108.662,11	367.650,53	365.613,99	33,06%	-623.973,23	655.654,40	472.379,57	-616.238,25
NTNB20500815 - 760199_NEGOCIACAO	1.263.339,37	72.429,62	69.585,67	6,29%	-139.574,39	207.292,37	150.745,95	-169.121,53
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
TERMO_RF_PRE	-266.822,03	2.005,68	-1.953,63	-0,18%	7.131,60	-5.622,34	-8.150,00	11.945,28
Total Var:	212.556.326,19	3.247.878,66	1.105.991,37	100,00%	-2.148.321,67	2.349.209,70	1.627.989,08	-2.225.469,38

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2023



Data: 29/12/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO:	FIM EMB I A
CNPJ:	20725946000122

Dados Gerais		Limite Fundo:		0,00% Dutation DC:	
PL:	375.160.765,65	VAR / PL:	0,5258%	Status:	ENQUADRADO
VAR:	1.972.511,37	ETL / PL:	0,6593%	Benchmark:	Dutation DU:
ETL:	2.473.608,83	VAR / C/D:	0,0058%		

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	12.323.130,00	Cenário Baixa - 10000 (+):	50.757.709,92	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	97.573.378,83
Cenário Alta - 09999 (-):	(19.569.959,65)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(44.036.055,86)	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	22.106.155,17
Cenário Alta - 09999:	(7.246.829,65)	Cenário Baixa - 10000:	6.721.654,06	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	(91.421.340,13)
				CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(30.422.423,98)
				CENÁRIO BRADESCO 2:	(8.316.268,81)

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
ANWB10	553.230,14	39,17	39,01	0,00%	-142,30	115,07	173,74	-254,13
BCBF14	172.175,04	9,34	9,29	0,00%	-44,60	36,59	61,77	-91,57
CAKA	9.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CBAN22	4.688.767,01	31.518,30	30.849,62	1,56%	-80.691,39	71.448,02	89.281,55	-114.314,59
CEEB43	1.901.551,80	434,37	432,56	0,02%	-1.409,30	1.135,75	1.623,56	-2.354,14
CGBP13	2.108.031,89	1.509,48	1.500,61	0,08%	-4.503,58	3.739,12	5.101,73	-7.125,43
COMPROMISSADA_PRE	215.844.977,50	2.635,48	563,29	0,03%	-6.115,26	6.236,69	24.151,39	-36.759,39
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-151.226,67	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPMF24C099500	2.139,43	431,23	205,22	0,01%	-0,51	2,41	5,75	-8,73
CPT12	2.051.473,05	1.780,41	1.768,34	0,09%	-5.269,71	4.446,59	6.005,56	-8.181,31
DAPF24	-11.292.572,77	7.577,78	-3.635,41	-0,18%	5.523,86	-8.019,94	-3.322,52	3.350,23
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DHF24	553.558.468,25	6.801,33	1.482,96	0,08%	-16.273,53	15.404,39	61.787,91	-94.043,75
DHF25	33.410.251,44	158.223,26	157.388,25	7,98%	-703.789,41	553.062,36	836.390,03	-1.234.160,08
DHF26	35.671.736,61	571.771,55	569.136,69	28,85%	-1.620.006,30	1.297.310,03	1.724.467,93	-2.473.707,80
DH1J24	769.587.387,94	91.712,96	-42.593,61	-2,16%	2.067.343,81	-2.076.989,70	-5.197.092,23	7.644.485,45
DHN24	124.323.508,70	88.441,10	81.260,43	-4,12%	-1.011.200,18	865.310,65	1.625.904,46	-2.434.861,88
DHN26	-24.385.299,93	500.945,26	-497.496,60	-25,22%	1.378.591,16	-1.123.780,77	-1.479.984,02	2.092.018,82
DHV24	323.037.310,01	756.085,18	744.036,38	37,72%	-4.591.491,94	3.715.072,41	6.211.225,73	-9.231.003,50
DOLF24	2.662.715,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DOLG24	-2.683.202,63	96.786,59	38.106,84	1,93%	-289.215,92	308.625,01	-386.107,98	388.212,26
ELET13	2.062.111,46	367,72	366,32	0,02%	-1.312,50	1.053,91	1.572,41	-2.301,41
ETEN13	1.321.982,32	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
GRRB14	1.106.703,49	69,15	68,89	0,00%	-255,17	204,57	304,42	-445,44
IDIF24C381500	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
IDIF24C381600	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
IDIF24C381800	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
IDIF24C381900	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
IDIF24C382000	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
IDIF24C382100	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
IDIF24C382500	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
IDIF24C382600	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
IDIF24C382700	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
IDIF24P380200	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
IDIF24P380300	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
IDIF24P380900	-28.037,93	4.243,79	-925,32	-0,05%	9.001,26	-10.639,28	-53.542,12	26.685,69
IDIF24P381000	410.285,20	18.888,31	4.118,41	0,21%	-45.090,55	42.836,31	172.097,15	-248.404,68
IDIF24P381100	-576.463,87	13.413,93	-2.924,78	-0,15%	32.095,49	-30.381,33	-121.861,27	185.473,11
IDIF24P381200	126.761,08	1.970,95	429,75	0,02%	-4.715,89	4.464,03	17.905,46	-27.252,85
IDIF24P381300	37.297,80	435,50	94,96	0,00%	-1.042,03	986,37	3.956,40	-6.021,81
IDIF24P381400	-646.801,31	6.047,11	-1.318,51	-0,07%	14.468,91	-13.696,15	-54.936,06	83.614,95
IDIF24P381500	762.623,79	5.945,62	1.296,38	0,07%	-14.226,08	13.466,28	54.014,05	-82.211,61
IDIF24P381600	2.795.271,98	18.689,79	4.075,13	0,21%	-44.719,04	42.330,67	169.790,78	-258.428,55
IDIF24P381700	-3.193.898,05	18.694,69	-4.076,19	-0,21%	44.730,76	-42.341,76	-169.835,27	258.496,27
IDIF24P381800	-2.842.129,79	14.793,68	-3.225,62	-0,16%	35.396,82	-33.506,33	-134.395,86	204.556,02
IDIF24P381900	3.157.492,19	14.797,56	3.225,46	0,16%	-35.406,09	33.515,11	134.431,05	-204.609,60
IDIF24P382400	-1.337.009,52	4.194,43	-912,37	-0,05%	10.012,09	-9.477,96	-38.014,23	57.859,22
IDIF24P382500	1.426.070,66	4.185,53	912,61	0,05%	-10.014,70	9.479,84	38.024,17	-57.874,35
IDU24C391800	94,50	50,08	-23,25	0,00%	147.514,30	-94,50	-94,50	2.257.799,68
IDU24C391900	-29,01	16,63	7,72	0,00%	-103.203,57	29,01	29,01	-2.185.171,32
IDU24P390700	-141.347,41	34.498,46	-16.018,12	-0,81%	141.341,39	-2.178.300,00	-5.382.061,84	141.347,41
IDU24P390800	68.327,63	14.532,39	6.747,59	0,34%	-68.320,49	697.331,09	1.942.694,76	-68.327,63
IDU24P390900	494.069,83	90.869,14	42.191,81	2,14%	-493.947,03	3.496.866,19	9.384.322,89	-494.069,83
IDU24P391000	-354.309,72	55.984,47	-25.994,37	-1,32%	354.107,64	-1.814.797,06	-4.742.321,00	354.309,72
IDU24P391100	135.061,44	18.250,91	8.474,15	0,43%	-134.891,65	520.559,57	1.336.029,96	-135.061,44
IDU24P391200	-176.593,76	20.369,89	-9.458,03	-0,48%	176.126,06	-530.594,74	-1.346.274,15	176.593,76
IDU24P391500	957.049,19	70.190,54	32.590,45	1,65%	-939.722,19	1.622.098,42	4.064.829,49	-957.049,19
IDU24P391600	-2.216.433,76	142.170,41	-66.011,71	-3,35%	2.148.491,64	-3.248.758,11	-8.133.921,70	2.216.433,76
IDU24P391700	1.261.455,14	71.561,94	33.222,57	1,68%	-1.199.727,34	1.626.319,16	4.070.298,11	-1.261.455,14
IDN24P400300	-212.808,07	219.093,59	-201.305,05	-10,21%	212.808,07	-6.797.083,17	-13.610.317,90	212.808,07
IDN24P400400	88.920,86	83.358,11	76.599,33	3,88%	-88.920,86	2.067.953,08	4.984.251,67	-88.920,86
IDN24P400500	289.602,11	246.332,93	226.332,79	-0,05%	-289.602,12	5.040.917,19	9.840.643,82	-289.602,12
IDN24P400700	908.654,66	629.817,75	578.681,90	29,34%	-908.654,66	9.555.117,90	18.332.398,89	-908.654,66
IDN24P400800	-1.796.991,25	1.119.896,60	-1.028.970,50	-52,17%	1.796.991,25	-15.199.506,92	-28.985.164,95	1.796.991,25
IDN24P400900	802.791,79	449.077,42	412.616,14	20,92%	-802.791,79	5.574.979,16	10.582.414,76	-802.791,79
IDN24P401300	568.650,39	207.230,99	190.405,59	9,65%	-568.650,39	2.129.715,67	4.008.210,83	-568.650,39
IDN24P401400	-1.284.866,36	423.334,46	-388.963,29	-19,72%	1.284.866,36	-4.269.406,76	-8.029.667,39	1.284.866,36
IDN24P401500	1.831.227,95	547.876,42	503.393,50	25,52%	-1.831.227,95	5.457.602,93	10.260.075,37	-1.831.227,95
IDN24P401600	-2.463.719,22	672.641,30	-618.028,53	-31,33%	2.463.719,16	-6.648.681,97	-12.496.220,18	2.463.719,22
IDN24P401700	1.349.899,34	338.070,42	310.621,97	15,75%	-1.349.899,24	3.326.130,31	6.250.627,45	-1.349.899,34
IVIA35	1.292.425,48	14,82	14,65	0,00%	-87,51	71,91	125,08	-186,16
LCAMC3	3.026.084,09	1.390,35	1.383,35	0,07%	-4.274,69	3.469,23	4.834,27	-6.943,59
LF002100HDP	1.546.318,41	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002100HDQ	2.816.989,08	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF00220018H	1.305.168,32	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFS3190009	3.658.074,26	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20240301 - 210100	57.049.494,35	297,93	-100,91	-0,01%	-21.033,91	22.651,91	-43,80	66,68
LFT20250901 - 210100	9.780.527,35	2.198,43	-1.740,09	-0,09%	-43.787,24	68.671,09	878,03	-1.336,62
LFT20260301 - 210100	20.988.362,55	5.909,03	-3.435,87	-0,17%	-111.588,37	208.239,47	5.129,15	-7.806,57
LFT20260901 - 210100	2.448.108,68	924,26	-206,45	-0,01%	-13.914,12	32.116,77	1.281,65	-1.949,98
LFT20290301 - 210100	4.073.446,79	2.997,61	1.752,83	0,09%	-46.188,85	121.953,34	8.700,26	-13.210,27
LTM20260701 - 100000	24.350.923,16	495.880,22	493.371,19	25,01%	-1.344.963,79	1.157.326,64	1.487.005,80	-2.101.013,37
NTNB20500815 - 760199_NEGOCIACAO	5.967.555,77	342.131,18	319.180,36	16,18%	-659.298,65	979.173,77	712.009,03	-798.868,60
OMGE13	986.620,57	749,43	745,01	0,04%	-2.226,83	1.844,87	2.513,43	-3.516,46

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2023



Data: 29/12/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIM EMB I A
CNPJ: 20725946000122

Dados Gerais			
PL:	375.160.765,65	VAR / PL:	0,5258%
VAR:	1.972.511,37	ETL / PL:	0,6593%
ETL:	2.473.608,83	VAR / CDI:	0,0058%
Limite Fundo:		Status:	ENQUADRADO
Benchmark:		Dutacion DC:	0,00%
		Dutacion DU:	309,17
			211,63

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	12.323.130,00	Cenário Baixa - 10000 (+):	50.757.709,92	CENARIO BRADESCO 1 (+):	97.573.378,83
Cenário Alta - 09999 (-):	(19.569.959,65)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(44.036.055,86)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(91.421.340,13)
Cenário Alta - 09999:	(7.246.829,65)	Cenário Baixa - 10000:	6.721.654,06	CENARIO BRADESCO 1:	6.152.038,70
				CENARIO BRADESCO 2 (+):	22.106.155,17
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	(30.422.423,98)
				CENARIO BRADESCO 2:	(8.316.268,81)

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
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PRLG14	1.112.999,83	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
SBSPC7	2.358.905,99	1.513,71	1.506,01	0,08%	-4.605,84	3.747,84	5.154,49	-7.357,63
SMFT16	3.261.341,99	3.003,10	2.986,45	0,15%	-8.957,40	7.372,30	10.012,57	-14.101,29
WMOQ22	1.101.878,45	129,84	129,35	0,01%	-469,46	378,03	571,06	-835,21
WDOF24	-2.662.715,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
WDOG24	-390.284,02	14.078,05	5.542,81	0,28%	-42.067,77	44.890,91	-56.161,16	56.467,24
Total Var:	640.694.787,92	8.769.873,38	1.972.511,37	99,97%	-7.246.829,65	6.721.654,06	6.152.038,70	-8.316.268,81



Data: 29/12/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIM EMB III A IMOBILIÁRIO
CNPJ: 32711990000162

Dados Gerais			
PL:	70.047.393,85	VAR / PL:	4,9245%
VAR:	3.449.494,67	ETL / PL:	6,1755%
ETL:	4.325.805,48	VAR / CDI:	0,0545%
Limite Fundo:		Status:	ENQUADRADO
Benchmark:		Dutacion DC:	0,00%
		Dutacion DU:	4,00
			1,00

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	37.184.018,80	Cenário Baixa - 10000 (+):	15,68	CENARIO BRADESCO 1 (+):	8.846.625,20
Cenário Alta - 09999 (-):	(15,37)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(37.184.018,80)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-
Cenário Alta - 09999:	37.184.003,43	Cenário Baixa - 10000:	(37.184.003,12)	CENARIO BRADESCO 1:	8.846.625,20
				CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	(8.919.070,80)
				CENARIO BRADESCO 2:	(8.919.070,80)

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
AIEC11	1.880.882,50	142.028,05	96.876,77	2,81%	940.441,25	-940.441,25	275.737,37	-277.994,43
BMLC11	3.846.508,80	126.829,94	-27.709,70	-0,80%	3.846.508,80	-3.846.508,80	563.898,19	-568.514,00
BPML11	2.267.520,00	225.874,16	-146.451,28	-4,25%	2.267.520,00	-2.267.520,00	332.418,43	-335.139,46
CAIXA	999,45	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CEOC11	656.848,10	47.995,37	27.944,51	0,81%	328.424,05	-328.424,05	96.293,93	-97.082,15
CNES11	348.619,26	32.133,69	3.668,82	0,11%	174.309,63	-174.309,63	51.107,58	-51.525,93
COMPROMISSADA_PRE	542.675,92	6,63	3,35	0,00%	-15,38	15,68	60,72	-92,42
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-514.751,29	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	1.200.990,00	77.103,10	63.474,98	1,84%	600.495,00	-600.495,00	176.065,13	-177.506,32
HBRH11	3.598.489,28	145.029,90	-113.036,85	-3,28%	3.598.489,28	-3.598.489,28	527.538,53	-531.856,72
HSLG11	1.182.575,11	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
MALL11	4.542.912,00	113.017,61	83.630,18	2,42%	2.271.456,00	-2.271.456,00	665.990,90	-671.442,39
MAXR11	1.773.213,40	102.057,51	68.287,86	1,98%	886.606,70	-886.606,70	259.953,08	-262.080,94
NEWL11	6.670.412,84	344.641,63	257.020,44	7,45%	3.335.206,42	-3.335.206,42	977.882,52	-985.887,02
NEWU11	1.827.112,00	96.322,97	522,45	0,02%	1.827.112,00	-1.827.112,00	267.854,62	-270.047,15
OULG11	202.224,15	21.172,66	16.232,80	0,47%	101.112,08	-101.112,08	29.646,06	-29.888,73
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PATC11	4.453.254,00	1.974.946,21	1.494.691,09	43,33%	2.226.627,00	-2.226.627,00	652.847,04	-658.190,94
PVBH11	2.506.764,46	89.053,63	71.411,09	2,07%	0,00	0,00	0,00	0,00
QAGR11	5.530.388,70	236.785,54	169.546,05	4,92%	2.765.194,35	-2.765.194,35	810.754,98	-817.391,45
RBRL11	2.483.492,92	84.407,56	39.585,18	1,15%	2.483.492,92	-2.483.492,92	364.080,06	-367.060,25
RCRB11	6.440.322,00	550.472,67	492.697,53	14,28%	0,00	0,00	0,00	0,00
TEPP11	5.798.470,60	185.536,90	129.311,10	3,75%	2.899.235,30	-2.899.235,30	850.055,79	-857.013,96
TRKF11	8.423.603,25	324.307,12	216.968,33	6,29%	4.211.801,63	-4.211.801,63	1.234.900,24	-1.245.008,96
XPIN11	2.471.764,00	77.223,54	-11.188,02	-0,32%	1.235.882,00	-1.235.882,00	362.360,60	-365.325,72
XPPR11	2.368.208,80	574.808,70	516.008,00	14,96%	1.184.104,40	-1.184.104,40	347.179,41	-350.021,26
Total Var:	70.203.500,25	5.571.555,09	3.449.494,67	100,01%	37.184.003,43	-37.184.003,12	8.846.625,20	-8.919.070,80

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2023



Data: 29/12/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO:	FIA RVA EMB II		
CNPJ:	1329426800125		

Dados Gerais			
PL:	115.700.648,96	VAR / PL:	7,3026%
VAR:	8.449.168,69	ETL / PL:	9,1578%
ETL:	10.595.598,40	VAR / CDI:	0,0808%
Limite Fundo:		Status:	ENQUADRADO
Benchmark:		Dutacion DC:	4,00
		Dutacion DU:	1,00

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	30.014.413,39	Cenário Baixa - 10000 (+):	109,64	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	16.489.627,51	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	-
Cenário Alta - 09999 (-):	(107,51)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(30.329.241,42)	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	-	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(16.623.499,83)
Cenário Alta - 09999:	30.014.305,88	Cenário Baixa - 10000:	(30.329.131,78)	CENÁRIO BRADESCO 1:	16.489.627,51	CENÁRIO BRADESCO 2:	(16.623.499,83)

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
ABEV3	2.960.656,65	310.596,88	292.366,40	3,34%	414.439,93	-898.098,66	433.979,63	-437.626,93
ARZZ3	412.992,00	76.765,37	58.346,01	0,69%	123.897,60	-123.897,60	60.544,63	-61.040,22
AZUL4	446.679,00	106.783,63	55.835,23	0,68%	268.007,40	-156.337,65	65.483,14	-66.019,16
B3SA3	3.421.126,95	576.033,65	537.627,80	6,36%	855.281,74	-855.281,74	501.537,21	-505.642,56
BBAS3	3.234.776,00	192.899,68	132.196,56	1,56%	808.694,00	-808.694,00	474.218,16	-478.099,89
BBDC4	3.810.728,20	434.137,62	378.759,96	4,48%	952.682,05	-952.704,35	558.652,75	-563.225,63
BPAC11	3.832.459,00	431.224,22	384.231,58	4,55%	1.149.737,70	-1.341.360,65	561.838,49	-566.437,44
BRFS3	1.064.820,05	242.247,47	42.565,25	0,50%	266.205,01	-266.205,01	156.102,62	-157.380,40
BRIT3	382.130,00	62.000,27	48.258,65	0,57%	179.590,00	-179.601,10	56.020,26	-56.478,81
CAIXA	9.999,89	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CBAV3	1.091.910,00	255.978,88	179.924,50	2,13%	436.764,00	-436.764,00	160.074,01	-161.384,30
CIEL3	698.341,00	141.510,40	102.704,71	1,22%	209.502,30	-174.585,25	102.376,79	-103.214,80
CMG4	1.184.736,00	205.267,64	-16.450,50	-0,19%	296.184,00	-355.420,80	173.682,30	-175.103,98
COMPROMISSADA_PRE	3.794.658,60	46,33	11,47	0,00%	-107,51	109,64	424,59	-646,25
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	2.059.374,22	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPFE3	1.128.343,00	86.403,34	81.666,79	0,97%	225.666,67	-225.666,60	165.415,08	-166.769,10
CPLE6	1.167.212,00	86.373,00	81.987,35	0,97%	254.575,47	-254.596,64	169.647,28	-171.035,93
CRFB3	689.730,00	124.772,78	110.009,89	1,30%	172.432,50	-172.432,50	101.114,42	-101.942,09
CSAN3	1.637.856,00	206.459,81	174.731,70	2,07%	409.464,00	-409.464,00	240.109,69	-242.075,12
CURY3	579.278,00	71.867,72	64.577,69	0,76%	173.783,40	-173.783,40	84.922,16	-85.617,29
CVCB3	160.500,00	21.727,06	9.702,87	0,11%	75.250,00	-75.250,00	22.063,30	-22.243,90
CXSE3	1.163.580,00	85.944,66	41.814,99	0,49%	232.716,00	-232.716,00	170.580,83	-171.977,12
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DIRR3	879.927,00	173.430,64	145.414,61	1,72%	263.978,10	-263.978,10	128.997,30	-130.053,21
ECOR3	1.099.314,00	205.132,76	181.520,65	2,15%	274.828,50	-274.828,50	161.159,43	-162.478,61
ELET3	2.296.396,46	231.087,51	177.488,62	2,10%	688.918,94	-688.924,35	336.651,72	-339.407,40
ELET6	1.306.044,00	113.259,74	94.856,30	1,12%	391.813,20	-391.813,20	191.466,05	-193.033,30
ENEV3	440.964,00	57.466,17	54.328,04	0,64%	163.156,68	-224.891,64	64.645,32	-65.174,48
ENGH1	586.747,00	56.788,16	37.890,56	0,45%	99.745,90	-129.084,34	86.017,11	-86.721,21
EQTL3	2.892.604,00	171.910,99	120.364,49	1,42%	576.520,00	-576.520,00	422.569,75	-426.040,87
GGPS3	435.435,00	55.858,64	47.732,19	0,56%	195.945,75	-195.945,75	63.834,77	-64.357,29
GMAT3	474.598,00	89.171,70	65.979,17	0,78%	85.421,03	-75.942,29	69.576,07	-70.145,58
GOAU3	1.142.472,00	126.888,07	103.479,28	1,22%	342.741,60	-285.618,00	167.486,40	-168.857,36
HAPV3	1.215.241,60	182.705,64	126.244,55	1,49%	413.182,14	-413.182,14	178.154,42	-179.612,71
ITSA4	2.300.522,28	243.315,96	237.318,70	2,81%	437.099,23	-437.099,23	337.256,57	-340.017,19
ITUB4	9.278.463,89	776.465,97	752.817,23	8,91%	1.855.665,46	-1.762.908,14	1.360.222,81	-1.371.356,96
JBSS3	1.820.921,00	163.483,13	125.849,72	1,49%	637.322,35	-637.322,35	266.947,02	-269.132,12
LJQQ3	647.468,00	224.361,59	202.791,90	2,40%	291.360,60	-291.360,60	94.918,81	-95.695,77
LREN3	1.397.955,00	408.262,31	365.253,46	4,32%	279.591,00	-279.591,00	204.940,20	-206.617,75
MRFG3	960.300,00	261.116,61	197.671,44	2,34%	384.120,00	-288.090,00	140.779,98	-141.932,34
MULT3	676.396,00	49.679,68	44.256,55	0,52%	207.869,20	-166.243,00	99.159,65	-99.971,33
ONCO3	1.192.100,00	35.973,68	239.360,73	2,83%	417.235,00	-417.235,00	174.761,86	-176.192,38
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PETR3	3.441.934,00	196.571,81	-110.442,74	-1,31%	860.483,50	-1.032.580,20	504.587,52	-508.717,85
PETRA	7.722.049,16	394.271,49	-162.712,25	-1,81%	1.950.512,29	-2.316.814,75	1.152.052,41	-1.141.318,87
PRIO3	2.767.605,00	200.552,63	-98.342,70	-1,16%	1.660.563,00	-1.660.563,00	405.730,89	-409.052,02
RADL3	2.254.862,40	206.344,56	148.163,66	1,73%	450.972,48	-450.972,48	330.562,83	-333.265,66
RAIL3	1.138.320,00	59.907,09	16.868,39	0,20%	512.239,04	-375.650,56	166.877,71	-168.243,70
RDR3	569.448,00	115.976,29	108.770,78	1,29%	170.834,40	-170.834,40	83.481,08	-84.164,41
RENT1	4.420,00	4.431,96	4.038,11	0,05%	0,00	0,00	0,00	0,00
RENT3	3.917.760,00	648.135,54	631.162,51	7,47%	1.324.812,72	-1.000.839,84	574.343,62	-579.044,93
SFBG3	547.791,00	160.626,24	134.102,13	1,59%	164.337,30	-219.116,40	80.306,16	-80.963,51
SBSP3	1.831.491,00	174.246,82	143.643,28	1,70%	457.872,75	-457.872,75	268.496,68	-270.694,37
SUZB3	1.034.718,00	74.587,24	-9.079,48	-0,11%	258.679,50	-206.943,60	151.689,66	-152.931,32
TIMS3	675.961,00	36.417,79	26.242,16	0,31%	216.307,52	-155.471,03	99.095,88	-99.907,04
TOTS3	1.097.721,27	190.311,61	132.248,11	1,57%	219.544,25	-219.544,25	160.925,94	-162.243,20
VALE3	18.388.654,00	1.541.628,10	956.592,27	11,32%	4.597.163,50	-4.597.163,50	2.695.776,68	-2.717.843,06
VBR3	1.952.808,00	154.928,63	25.002,83	0,30%	488.202,00	-488.202,00	286.281,65	-288.625,02
WEGE3	1.723.697,00	209.934,32	145.808,73	1,73%	430.924,25	-430.924,25	252.693,98	-254.762,42
WING24	0,00	166.301,14	185.861,28	2,20%	492.019,55	-491.005,13	387.803,15	-389.665,18
YDUQ3	686.862,00	116.929,55	89.752,61	1,08%	267.569,38	-171.513,00	100.575,22	-101.398,49
Total Var:	115.700.647,62	12.317.112,16	8.449.168,69	99,96%	30.014.305,88	-30.329.131,78	16.489.627,51	-16.623.499,84

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2023



Relatório de Risco de Mercado

Data: 29/12/2023

FUNDO:	FIA RVA EMB III
CNPJ:	38452593000108

Dados Gerais					
PL:	118.731.496,96	VAR / PL:	7,9406%	Limite Fundo:	0,00%
VAR:	9.427.967,74	ETL / PL:	9,9578%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	11.823.051,91	VAR / CDT:	0,0878%	Benchmark:	Dutacion DC: 4,00 Dutacion DU: 1,00

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	33.992.045,90	Cenário Baixa - 10000 (+):	1.094.376,62	CENARIO BRADESCO 1 (+):	16.280.824,96	CENARIO BRADESCO 2 (+):	1.376.388,93
Cenário Alta - 09999 (-):	(1.025.559,45)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(32.837.714,07)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(1.368.928,30)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(16.414.411,99)
Cenário Alta - 09999:	32.966.486,45	Cenário Baixa - 10000:	(31.743.337,45)	CENARIO BRADESCO 1:	14.911.896,65	CENARIO BRADESCO 2:	(15.038.023,05)

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

Produto	Mtm	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
ALOSS	2.948.483,70	164.125,06	150.487,66	1,69%	0,00	0,00	0,00	0,00
ASAJ3	481.668,00	58.558,05	39.901,97	0,42%	134.867,04	-125.233,68	70.612,53	-71.190,53
AURE3	904.986,83	61.930,11	45.691,66	0,48%	226.246,71	-280.545,92	132.671,07	-133.757,05
BBAS3	3.159.777,94	188.427,32	134.848,57	1,43%	789.944,49	-789.944,49	463.223,45	-467.015,18
BBSE3	4.297.105,00	211.374,57	171.175,32	0,75%	859.408,23	-859.421,00	629.955,59	-635.112,12
BPAC11	3.104.931,16	349.363,56	322.021,89	3,42%	931.479,35	-1.086.725,91	455.182,91	-458.908,83
CAIXA	999,58	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CIEL3	1.993.250,00	403.908,13	333.584,94	3,54%	597.975,00	-498.312,50	292.210,45	-294.602,35
COMPROMISSADA_PRE	5.560.404,01	67,89	17,48	0,00%	-157,54	160,66	622,17	-946,96
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-837.793,09	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
DOLG24	-17.606,90	325.554,90	123.373,97	1,31%	-972.817,20	1.038.102,31	-1.298.726,85	1.305.804,89
ELET3	9.341.176,65	940.007,23	620.708,46	6,58%	2.802.353,00	-2.802.375,01	1.369.416,50	-1.380.625,91
ENAT3	1.149.148,00	278.891,60	-596,08	-0,01%	402.201,80	-402.201,80	168.465,10	-169.844,07
ENEV3	6.183.866,82	805.877,96	753.794,98	8,00%	2.288.030,72	-3.153.772,08	906.554,88	-913.975,52
ENIJ3	181.506,00	24.142,54	11.068,01	0,12%	81.677,70	-49.006,62	26.608,78	-26.928,59
EQTL3	10.648.739,40	635.122,69	390.290,74	4,14%	2.129.947,88	-2.129.947,88	1.561.251,80	-1.574.031,48
FLRY3	1.347.588,00	88.051,17	75.884,51	0,80%	269.517,60	-269.517,60	197.556,40	-199.173,51
HAPV3	1.661.322,95	249.771,79	145.240,09	1,54%	564.849,80	-564.849,80	243.549,94	-245.543,53
IGT11	9.381.594,66	1.170.047,54	1.061.059,07	11,25%	1.876.280,45	-1.876.318,93	1.375.341,78	-1.386.599,69
ITSA4	1.712.087,00	181.079,79	177.380,95	1,88%	325.296,53	-325.296,53	250.991,95	-253.046,46
ITUB4	6.522.341,91	545.820,58	530.316,95	5,62%	1.304.449,18	-1.239.244,96	956.175,32	-964.002,13
LREN3	2.419.237,34	706.520,18	652.934,08	6,93%	483.847,47	-483.847,47	354.660,19	-357.563,28
LWSA3	109.015,39	12.829,83	8.372,44	0,09%	43.606,16	-43.606,16	15.981,66	-16.112,48
MGLU3	413.856,00	191.974,45	176.158,54	1,87%	215.205,12	-186.235,20	60.671,29	-61.167,92
NTOC3	2.295.621,24	538.699,89	435.141,85	4,62%	573.905,31	-573.905,31	336.538,07	-339.292,82
ONCO3	651.300,00	183.558,14	150.614,95	1,60%	227.955,00	-227.955,00	95.480,58	-96.262,14
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PETR4	640.528,00	32.704,00	-11.839,03	-0,13%	160.132,00	-192.158,40	93.901,41	-94.670,04
PETZ3	175.380,00	39.190,63	34.605,95	0,37%	43.845,00	-43.845,00	25.710,71	-25.921,16
PRIO3	5.143.785,00	372.759,50	-179.556,90	-1,90%	3.086.271,00	-3.086.271,00	754.078,88	-750.251,42
RAI3	8.291.835,00	436.379,67	99.109,13	1,05%	3.731.289,62	-2.736.341,68	1.215.583,01	-1.225.533,21
RECV3	4.065.093,48	798.030,19	402.881,29	4,27%	2.439.056,09	-2.439.056,09	595.942,70	-600.820,82
RENT1	7.540,00	7.560,41	6.884,34	0,07%	0,00	0,00	0,00	0,00
RENT3	6.721.311,60	1.111.941,75	1.085.386,06	11,51%	2.272.849,56	-1.717.041,48	985.344,28	-993.409,85
SBSF3	2.230.952,00	212.251,27	187.262,80	1,99%	557.738,00	-557.738,00	327.057,56	-329.734,71
SCAR3	176.000,00	32.987,18	15.927,57	0,17%	105.600,00	-105.600,00	25.801,60	-26.012,80
SMFT3	2.472.850,00	416.143,04	397.271,95	4,21%	989.140,00	-989.140,00	362.519,81	-365.487,23
SOMA3	3.676.575,00	1.049.004,84	997.977,11	10,59%	1.102.972,50	-1.102.972,50	538.985,90	-543.397,79
SUZB3	9.496.430,41	684.546,47	-24.064,28	-0,26%	2.374.107,60	-1.899.286,08	1.392.176,70	-1.403.572,42
WDOG24	-951,72	17.597,56	6.668,86	0,07%	-52.584,71	56.113,64	-70.201,45	70.584,05
Total Var:	118.712.936,36	13.526.802,27	9.427.967,74	99,99%	32.966.486,45	-31.743.337,45	14.911.896,65	-15.038.023,05

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2023



Data: 29/12/2023

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIA RVA EMB IV
CNPJ: 38452613000132

Dados Gerais					
PL:	110.594.041,25	VAR / PL:	6,2017%	Limite Fundo:	0,00%
VAR:	6.858.745,47	ETL / PL:	7,7772%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	8.601.143,53	VAR / Cdt:	0,0686%	Benchmark:	Dutacion DC: 4,00 Dutacion DU: 1,00

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	29.694.229,91	Cenário Baixa - 10000 (+):	267,27	CENARIO BRADESCO 1 (+):	14.824.124,44
Cenário Alta - 09999 (-):	(262,06)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(27.825.191,72)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-
Cenário Alta - 09999:	29.693.967,85	Cenário Baixa - 10000:	(27.824.924,45)	CENARIO BRADESCO 1:	14.824.124,44
				CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	(14.945.999,72)
				CENARIO BRADESCO 2:	(14.945.999,72)

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
AJRES3	1.511.084,30	103.406,60	70.676,08	1,03%	377.771,08	-468.436,13	221.524,96	-223.336,26
CAXA	1.000,17	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	9.249.808,36	112,94	26,59	0,00%	-262,06	267,27	1.034,98	-1.575,29
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	226.370,16	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPLE3	2.495.737,14	179.584,86	173.326,30	2,53%	549.062,17	-549.062,17	365.875,07	-368.869,95
CPLE6	4.797.125,48	360.124,76	330.633,01	4,82%	1.055.321,30	-1.055.367,61	703.258,60	-709.015,15
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ENG11	9.265.865,56	896.794,44	729.301,76	10,63%	1.575.179,93	-2.038.490,42	1.358.375,89	-1.369.494,93
EQTL3	10.769.830,04	642.284,58	540.731,72	7,88%	2.153.966,01	-2.153.966,01	1.578.857,08	-1.591.780,88
GGPS3	6.939.929,10	890.270,66	696.609,41	10,16%	3.122.968,10	-3.122.968,10	1.017.393,61	-1.025.721,52
GMAT3	8.065.286,82	1.515.377,91	922.604,21	13,45%	1.451.639,30	-1.290.558,22	1.182.371,05	-1.192.049,39
HAPV3	6.065.172,00	911.869,00	732.745,96	10,68%	2.062.158,48	-2.062.158,48	889.154,22	-896.432,42
ITUB4	12.550.522,23	1.050.287,37	957.989,54	13,97%	2.510.067,50	-2.384.599,22	1.839.906,56	-1.854.967,19
MATD3	1.277.959,15	293.264,39	201.544,86	2,94%	383.387,75	-383.387,75	187.348,81	-188.882,36
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PRIO3	7.933.632,15	574.933,97	-290.432,57	-4,23%	4.760.179,29	-4.760.179,29	1.163.070,47	-1.172.590,83
RAIL3	9.960.913,45	523.693,05	241.014,12	3,51%	4.477.867,69	-3.283.844,80	1.488.803,91	-1.470.745,01
RENT1	4.380,00	4.391,86	3.683,13	0,05%	0,00	0,00	0,00	0,00
RENT3	3.882.970,80	642.380,18	596.657,06	8,70%	1.313.048,56	-991.952,51	569.243,52	-573.903,08
UGPA3	12.427.834,98	1.322.530,33	871.686,86	12,71%	3.106.958,75	-2.485.567,00	1.821.920,61	-1.836.834,01
VBBR3	3.178.616,08	252.179,75	79.946,43	1,17%	794.654,02	-794.654,02	465.985,12	-469.799,46
Total Var:	110.594.037,97	10.163.486,64	6.858.745,47	100,00%	29.693.967,85	-27.824.924,46	14.824.124,44	-14.945.999,72

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2023



Data: 29/12/2023

Relatório de Risco de Mercado

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

Dados Gerais		Limite Fundo:		0,00% Dutation DC:		9,54	
PL:	122.933.477,61	VAR / PL:	6,8969%	Status:	ENQUADRADO	Dutation DU:	4,83
VAR:	8.478.601,72	ETL / PL:	8,6490%	Benchmark:			
ETL:	10.632.508,61	VAR / CDT:	0,0763%				

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	31.445.203,70	Cenário Baixa - 10000 (-):	7.794,90	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	17.749.080,64	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	0,83
Cenário Alta - 09999 (-):	(5.088,38)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(31.777.819,08)	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	(0,55)	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(17.892.043,66)
Cenário Alta - 09999:	31.440.115,31	Cenário Baixa - 10000:	(31.770.024,18)	CENÁRIO BRADESCO 1:	17.749.080,09	CENÁRIO BRADESCO 2:	(17.892.042,82)

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
ABEV3	3.075.437,62	322.681,93	284.682,81	3,36%	430.561,27	-922.653,69	450.859,16	-454.549,68
ALOS3	720.832,50	40.124,76	36.969,63	0,44%	0,00	0,00	0,00	0,00
ALPA4	91.171,08	15.957,50	11.854,66	0,14%	22.792,77	-22.792,77	13.365,68	-13.475,09
ARZZ3	204.947,28	38.094,81	27.402,86	0,32%	61.484,18	-61.484,18	30.045,27	-30.291,21
ASAJ3	930.525,75	113.127,25	90.074,46	1,06%	260.547,21	-241.936,70	136.415,08	-137.531,71
AZUL4	267.350,99	63.913,26	36.940,48	0,44%	160.410,59	-93.572,85	39.193,66	-39.514,48
B3SA3	4.155.465,45	699.678,19	636.707,83	7,51%	1.038.866,36	-1.038.866,36	609.191,24	-614.177,79
BBAS3	4.012.008,48	239.248,45	159.322,19	1,88%	1.003.002,12	-1.003.002,12	588.160,44	-592.974,85
BBD33	1.168.904,72	144.296,49	123.588,23	1,46%	292.226,18	-292.226,18	171.361,43	-172.764,12
BBD43	4.483.441,87	510.776,60	433.311,16	5,11%	1.120.886,70	-1.120.886,70	657.272,58	-662.652,71
BBSF3	1.152.243,30	56.678,84	11.249,40	0,13%	230.445,24	-230.448,66	168.918,87	-170.301,56
BEF33	99.395,82	16.228,13	8.870,79	0,10%	24.848,96	-24.848,96	14.571,43	-14.690,70
BHIA3	55.022,30	120.474,56	-80.972,22	-0,96%	0,00	0,00	0,00	0,00
BPAC11	2.205.939,33	248.209,95	214.588,76	2,53%	661.781,80	-772.078,77	323.390,71	-326.037,83
BRAP4	328.319,70	37.986,83	29.223,92	0,34%	82.079,93	-82.079,93	48.131,67	-48.625,65
BRFS3	1.180.906,91	268.657,34	64.735,19	0,76%	295.226,73	-295.226,73	173.120,95	-174.536,04
BRKM5	296.268,68	55.920,94	41.265,85	0,49%	162.947,72	-88.881,93	43.432,97	-43.788,50
CAXA4	9.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CCRO3	719.450,66	77.363,54	68.543,86	0,81%	179.862,67	-179.862,67	105.471,47	-106.334,81
CIEL3	261.889,60	53.068,78	36.341,98	0,43%	78.566,88	-65.472,40	38.393,02	-38.707,28
CMG44	841.151,08	145.738,03	-15.093,39	-0,18%	210.287,77	-252.345,32	123.312,75	-124.322,13
CMN3	443.256,30	80.861,33	48.593,52	0,57%	155.139,71	-155.139,71	64.981,37	-65.513,23
COGN3	322.873,86	75.881,93	69.448,89	0,82%	80.718,47	-113.005,85	47.333,31	-47.720,76
COMPROMISSADA_PRE	3.602.130,13	43,98	10,05	0,00%	-102,06	104,08	403,05	-613,46
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	864.682,52	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPFE3	368.540,70	28.221,16	26.618,99	0,31%	73.707,18	-73.708,14	54.028,07	-54.470,32
CPLE6	886.847,08	66.576,45	61.934,24	0,73%	195.097,80	-195.106,36	130.011,78	-131.076,00
CRFB3	338.889,00	61.305,33	53.877,30	0,63%	84.722,25	-84.722,25	49.681,13	-50.087,79
CSAN3	1.152.752,48	145.310,12	120.491,87	1,42%	288.188,12	-288.188,12	168.993,51	-170.376,82
CSNA3	602.166,14	169.531,95	157.233,96	1,85%	240.866,46	-180.649,84	88.277,56	-89.000,16
CVCB3	93.768,50	13.536,97	5.641,62	0,07%	46.884,25	-46.884,25	13.746,46	-13.888,98
CYRE3	326.235,84	77.579,27	63.667,99	0,75%	104.395,47	-94.600,39	47.826,17	-48.217,66
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DXCO3	124.544,31	25.951,49	18.950,68	0,22%	37.363,29	-37.363,29	18.258,20	-18.407,65
EGE33	589.788,63	39.454,87	36.299,12	0,43%	106.161,95	-106.161,95	86.463,01	-87.170,76
ELT33	4.283.647,94	431.065,61	348.811,70	4,11%	1.285.094,38	-1.285.104,48	627.982,79	-633.123,17
ELT63	643.109,22	55.770,24	48.494,67	0,57%	192.932,77	-192.932,77	94.279,81	-95.051,54
EMBR3	838.438,33	150.224,95	117.048,30	1,38%	209.609,58	-209.609,58	122.915,06	-123.921,19
ENEV3	1.095.536,95	142.769,74	135.612,50	1,60%	405.348,67	-558.723,84	160.605,72	-161.920,36
ENGH1	796.791,66	77.117,28	54.368,05	0,64%	135.453,10	-175.294,17	116.809,66	-117.765,81
EQT33	1.994.854,84	118.967,94	86.176,06	1,02%	398.970,97	-398.970,97	292.445,72	-294.839,55
EZTC3	87.235,50	23.961,45	22.396,14	0,26%	17.446,63	-26.171,12	12.788,72	-12.893,41
FLRY3	221.459,04	14.470,10	11.897,96	0,14%	44.291,81	-44.291,81	32.465,90	-32.731,65
GGBR4	1.354.700,16	138.798,09	116.363,35	1,37%	338.675,04	-338.675,04	198.599,04	-200.224,68
GOAU4	365.591,04	40.604,18	33.711,96	0,40%	109.677,31	-91.397,76	53.595,65	-54.034,36
GOLL4	90.614,94	15.809,12	1.624,79	0,02%	54.366,96	-31.715,23	13.284,15	-13.392,89
HAPV3	996.791,10	149.862,68	109.890,10	1,29%	338.906,97	-338.906,97	146.129,58	-147.325,73
HYPE3	746.245,50	125.121,01	98.511,66	1,19%	173.311,97	-152.424,04	109.339,69	-110.295,09
IGTH1	270.447,34	33.729,47	28.127,69	0,33%	54.068,36	-54.068,47	39.647,58	-39.872,12
INDG24	0,00	363.287,23	363.102,54	4,28%	959.438,12	-957.460,00	756.216,14	-759.827,60
IRBR3	184.819,60	34.538,28	17.238,08	0,20%	120.132,74	-101.650,78	27.094,55	-27.316,34
ITSA4	2.840.073,38	300.381,86	290.334,80	3,42%	539.613,94	-539.613,94	416.354,76	-419.762,85
ITUB4	8.314.429,26	695.790,97	670.643,82	7,91%	1.662.861,38	-1.579.741,56	1.218.895,33	-1.228.872,65
JBS33	1.441.168,05	129.388,73	99.498,19	1,17%	504.408,82	-504.408,82	211.275,24	-213.004,64
KLBN11	800.497,72	68.255,84	-4.815,38	-0,06%	200.124,43	-160.099,54	117.352,97	-118.313,56
LFT20240301 - 210100	713.118,68	3,72	-1,51	0,00%	-262,92	283,15	-0,55	0,83
LFT20250901 - 210100	1.055.042,31	237,15	-190,42	0,00%	-4.723,41	7.407,67	94,71	-144,18
LREN3	844.748,06	246.702,36	215.236,86	2,54%	168.949,61	-168.949,61	123.840,07	-124.853,76
LWSA3	120.452,42	14.175,83	9.242,25	0,11%	48.180,97	-48.180,97	17.658,33	-17.802,87
MGLU3	315.738,00	146.460,67	135.406,19	1,60%	164.183,76	-142.082,10	46.287,19	-46.666,08
MRF33	164.056,10	44.808,74	35.109,10	0,41%	65.622,44	-49.216,83	24.050,62	-24.247,49
MIRVE3	215.346,48	52.540,96	46.532,34	0,55%	64.603,94	-64.603,94	31.569,79	-31.628,21
MULT3	388.984,64	28.969,99	28.068,28	0,39%	119.542,26	-95.903,70	57.025,13	-57.491,92
NTCO3	728.583,93	170.872,49	146.305,60	1,73%	182.145,98	-182.145,98	106.810,40	-107.684,71
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PCAR3	32.995,62	16.271,64	10.783,50	0,13%	8.248,91	-8.248,91	4.637,16	-4.876,75
PETR3	4.728.780,74	270.064,74	-151.226,77	-1,78%	1.182.195,19	-1.418.634,22	693.239,26	-698.913,79
PETRA	8.668.429,28	442.591,66	-172.381,53	-2,03%	2.167.107,32	-2.600.528,78	1.270.791,73	-1.281.193,85
PETZ3	62.362,60	13.935,62	12.542,26	0,15%	15.590,65	-15.590,65	9.142,36	-9.217,19
PRIO3	1.877.919,00	136.088,92	-67.123,38	-0,79%	1.126.751,40	-1.126.751,40	275.302,93	-277.556,43
RADL3	1.911.970,20	174.966,18	128.040,76	1,51%	382.394,04	-382.394,04	280.294,83	-282.589,20
RAIL3	1.425.309,75	75.010,68	22.012,43	0,26%	641.383,18	-470.358,43	208.950,41	-210.660,78
RAIZ4	245.084,45	37.220,28	7.618,73	0,09%	85.779,56	-85.779,56	35.929,38	-36.223,48
RDDR3	1.712.658,00	348.807,46	320.279,86	3,78%	513.797,40	-513.797,40	251.075,66	-253.130,85
RECV3	304.470,96	59.771,57	17.576,30	0,21%	182.682,58	-182.682,58	44.635,44	-45.000,81
RENT1	3.020,00	3.028,17	2.743,79	0,03%	0,00	0,00	0,00	0,00
RENT3	2.768.027,60	457.598,42	441.972,16	5,21%	935.347,89	-706.615,67	405.499,65	-408.818,88
RRRP3	315.701,64	60.650,64	-26.648,85	-0,31%	189.420,98	-189.420,98	46.281,86	-46.660,70
SANB1	564.694,00	45.363,43	28.987,24	0,34%	112.920,80	-112.920,80	32.770,95	-33.448,47
SBSF3	1.306.237,47	124.274,55	99.787,08	1,18%	326.559,37	-326.559,37	191.494,41	-193.061,90
SLE33	187.786,96	11.736,48	8.296,77	0,10%	56.984,36	-55.986,56	27.529,42	-27.754,77
SMT03	212.731,98	29.248,77	-18.104,15	-0,21%	63.819,59	-63.819,59	31.186,51	-31.441,79
SOMA3	188.373,25	53.746,88	48.542,43	0,57%	56.511,98	-56.511,98	27.615,52	-27.841,57
SUZB3	1.938.093,57	139.706,72	-19.872,29	-0,23%	484.523,39	-387.618,71	284.124,52	-286.450,23



Data: 29/12/2023

Relatório de Risco de Mercado

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

Dados Gerais					
PL:	122.933.477,61	VAR / PL:	6,8969%	Limite Fundo:	0,00%
VAR:	8.478.601,72	ETL / PL:	8,6490%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	10.632.508,61	VAR / Cdt:	0,0763%	Benchmark:	Dutacion DC: 9,54 Dutacion DU: 4,83

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	31.445.203,70	Cenário Baixa - 10000 (+):	7.794,90	CENARIO BRADESCO 1 (+):	17.749.080,64
Cenário Alta - 09999 (-):	(5.088,38)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(31.777.819,08)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(0,55)
Cenário Alta - 09999:	31.440.115,31	Cenário Baixa - 10000:	(31.770.024,18)	CENARIO BRADESCO 1:	17.749.080,09
				CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,83
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	(17.892.043,66)
				CENARIO BRADESCO 2:	(17.892.042,82)

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
TAEF1	427.591,58	24.992,11	21.995,65	0,26%	106.897,90	-106.897,90	62.684,93	-63.198,04
TIMS3	735.333,26	39.781,37	28.631,56	0,34%	236.285,84	-169.830,45	105.248,45	-109.134,52
TOTS3	882.913,53	153.070,51	112.927,36	1,33%	176.582,77	-176.582,77	129.435,17	-130.494,66
TRPL4	534.664,00	84.963,15	68.933,85	0,81%	106.932,80	-133.666,00	78.381,74	-79.023,34
UGPA3	1.468.097,29	156.230,20	84.622,15	1,00%	367.024,32	-293.619,46	215.223,06	-216.984,78
USIM5	243.936,82	51.188,01	46.819,45	0,55%	95.135,36	-53.666,10	35.761,14	-36.053,86
VALE3	16.515.782,00	1.384.614,32	911.693,44	10,75%	4.128.945,50	-4.128.945,50	2.421.213,64	-2.441.032,58
VAM03	216.303,60	51.093,35	48.597,42	0,57%	75.706,26	-86.521,44	31.710,11	-31.969,67
VBBR3	1.292.904,56	102.574,31	21.750,01	0,26%	323.226,14	-323.226,14	189.539,81	-191.091,29
VVT3	1.152.540,48	72.503,11	30.184,29	0,36%	183.793,97	-164.815,01	168.962,43	-170.345,48
WEGE3	2.787.553,93	339.504,70	223.293,66	2,63%	696.888,48	-696.888,48	408.655,41	-412.000,47
YDUQ3	330.672,58	55.925,48	41.274,39	0,49%	128.962,31	-82.668,15	48.476,60	-48.873,41
Total Var:	122.932.580,60	12.883.591,17	8.478.601,72	99,98%	31.440.115,31	-31.770.024,18	17.749.080,08	-17.892.042,82

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 – DEZEMBRO 2023



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

29/12/2023

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	18/05/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	634.371,59	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	234.536,77	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	140.722,06	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	20/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	468.741,82	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	25/08/17	25/08/17	15/08/24	PETR	9.245.175,26	AAA	Aaa.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	18/12/17	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	3.159.854,08	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	21/12/17	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	922.331,43	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/01/18	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	3.277.549,50	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB II	19/02/18	19/02/18	15/02/25	SABESP	9.873.513,55	brAAA	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/02/18	19/02/18	15/02/25	SABESP	6.127.593,74	brAAA	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	13/03/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	12.408.176,74	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB II	23/05/18	23/05/18	15/05/28	COMGAS	25.948.592,10	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	610.811,67	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	610.811,67	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	610.811,67	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	609.576,94	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	610.811,67	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	04/07/18	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	12.582.796,80	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/07/18	26/07/18	15/07/25	AEGEA SA	14.493.010,91	brA	Aa1.br	AA(bra)
FI RF EMB II	26/07/18	26/07/18	15/07/25	CSMG	10.820.136,85	-	Aa3.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/02/13	15/02/25	CEMG	1.401.112,15	brA+	A1.br	AA(bra)
FIM EMB I A	12/02/19	09/01/19	15/01/25	ITAUUBB	2.814.426,97	-	AAA.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	571.083,01	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	3.615.943,88	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	2.059.193,55	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	6.225.628,51	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	720.860,22	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	5.832.414,57	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	8.650.322,73	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	891.245,37	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	624.622,04	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	30/09/20	28/09/20	22/09/25	HAPVIDA	175.444,73	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB II A CRED PRIV	08/01/21	22/05/19	15/04/24	ECORODOV	1.354.309,36	-	-	AA(bra)
FI RF EMB II A CRED PRIV	05/02/21	07/08/19	15/07/24	COPEL GT	150.857,48	-	-	AA+(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	6.032.573,28	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	6.045.023,19	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	4.296.793,57	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/07/19	15/06/29	NEOENERG	623.518,65	brAA+	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/07/19	15/06/29	NEOENERG	6.198.086,54	brAA+	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	1.779.283,61	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	3.410.231,40	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	3.648.607,06	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	31/07/20	15/07/34	IGUA SAN	2.684.059,20	brAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	23/05/18	15/05/28	COMGAS	22.598.121,04	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	237.474,32	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	417.954,80	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	474.948,63	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	237.474,32	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	290.668,56	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	244.613,27	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	709.709,68	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	26/10/16	27/01/25	BRADESCO	14.422.824,08	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	12/12/17	15/11/24	CCR	3.126.238,62	brAAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	14/12/17	15/11/24	ECORODOV	2.083.604,05	brAA	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	19/02/18	15/02/25	SABESP	1.439.062,67	brAAA	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	23/05/18	15/05/28	COMGAS	10.043.473,50	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	28/06/18	15/06/27	JAGUARA	1.564.648,14	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	28/06/18	15/06/27	ENERGMIR	997.628,50	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	31/07/18	01/08/25	BRADESCO	4.655.244,09	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	179.239,16	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	294.120,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	22/12/20	15/12/26	IRB	2.631.493,90	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	144.000,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	873.799,36	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	67.500,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	1.347.125,98	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	07/04/21	15/03/31	LOCALIZA	5.494.008,71	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	1.620.849,79	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/06/21	06/01/21	15/11/25	QUATA	565.902,59	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	19.745,87	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	213.586,35	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	533.138,53	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	333.781,92	-	-	AAA(bra)

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2023



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

29/12/2023

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	333.781,92	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	318.776,68	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	647.920,09	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	638.201,29	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	867.473,65	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	216.615,95	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	133.284,63	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	333.564,19	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	1.000.658,98	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	14/06/21	19/06/19	19/06/24	BNBBM	594.161,71	brAAA	AAbR	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	14/06/21	12/06/19	12/06/24	BNBBM	900.627,34	brAAA	AAbR	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	15/06/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	73.080,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	16/06/21	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	397.116,01	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	17/06/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	824.225,55	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	17/06/21	18/03/21	15/02/26	CORSAN	792.989,31	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	18/06/21	18/06/21	15/12/30	MG050	512.443,61	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	44.100,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	745.612,90	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	228.600,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	85.182,86	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	25/06/21	25/06/21	20/06/26	OURO VER	1.417.008,90	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	3.154.920,60	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	01/07/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	2.759.503,89	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/07/21	01/03/21	18/02/25	RENNER	1.154.873,42	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/07/21	01/03/21	18/02/25	RENNER	244.239,41	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/07/21	07/04/21	15/03/29	CAGECE	1.261.819,63	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	08/07/21	08/07/21	15/06/31	VAMOS	265.903,92	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/07/21	07/04/21	15/03/29	CAGECE	2.875.748,13	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/07/21	08/07/21	15/06/31	VAMOS	5.275.871,49	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	12/07/21	12/07/21	12/07/26	BRADESCO	4.238.307,98	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	2.066.927,43	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/34	VIARONDO	223.224,22	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	1.003.936,18	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	263.160,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	522.046,81	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	232.200,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	340.560,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	170.280,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	1.878.162,44	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	293.600,33	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	4.133.854,86	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	381.506,15	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	381.506,15	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	1.360.152,36	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	917.345,24	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/07/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	3.038.186,97	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	19/07/21	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	629.964,23	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	291.240,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/07/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	2.038.865,17	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/07/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	747.104,98	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	11/06/18	15/05/25	INTERVIA	1.279.914,37	-	Aa2.br	-
FIM EMB I A	21/07/21	17/03/21	05/03/24	ENERG TR	1.319.316,50	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.170.446,98	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	935.860,81	-	-	AA-(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	20/09/19	20/08/26	VAMOS	1.075.484,02	brAA+	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	23/07/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.537.330,82	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/07/21	07/11/19	15/10/24	BKBR	1.028.840,37	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/07/21	23/12/20	15/12/26	RD COLIN	2.066.289,69	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	04/08/21	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	388.632,90	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	06/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	632.093,63	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	11/08/21	11/08/21	15/08/31	CSAN	1.072.879,44	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	11/08/21	19/11/19	15/06/27	AUTOPIST	1.100.223,28	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	17/08/21	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	2.746.423,41	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	18/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	1.172.452,00	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	18/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	909.812,70	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	27/08/21	27/08/21	20/08/31	S LUIZ A	1.052.352,48	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	697.456,53	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	62.458,79	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	312.293,97	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/06/19	15/06/24	PROLAGOS	1.103.046,39	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	12/05/21	15/04/26	ELETROB	2.027.213,65	brAAA	-	-

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2023



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

29/12/2023

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FIM EMB I A	18/09/21	22/10/19	21/10/26	AUTOBAN	545.912,43	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/09/21	20/09/21	15/09/29	MOV_PART	1.081.150,19	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.024.887,21	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.024.887,21	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	1.133.666,29	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	847.120,71	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	847.120,71	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	281.610,40	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	281.610,40	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	796.261,89	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	796.261,89	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	1.023.203,09	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	397.475,05	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	397.475,05	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	23/09/21	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	4.277.950,11	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	23/09/21	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	4.335.394,08	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	24/09/21	05/04/21	15/03/24	CCPR	41.459,67	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	27/09/21	28/12/20	15/01/26	LOCALIZA	1.933.088,24	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	27/09/21	29/03/21	01/04/24	CNH	2.480.068,58	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	30/09/21	30/09/21	15/09/31	SIMPAN	887.222,48	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	04/10/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	620.783,80	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/10/21	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	2.518.508,24	-	-	AA-(bra)
FIM EMB I A	20/10/21	20/10/21	20/10/25	DAYCOVAL	2.773.719,37	brAA+	AA.br	AA(bra)
FIM EMB I A	20/10/21	20/10/21	20/10/24	DAYCOVAL	1.538.051,57	brAA+	AA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/10/21	22/10/21	15/12/35	CART	2.332.594,82	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	22/10/21	22/10/21	15/12/35	CART	876.145,37	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	25/10/21	22/04/21	15/03/26	VIX LOGI	174.348,13	-	-	A+(bra)
FIM EMB I A	27/10/21	27/10/21	15/10/29	CONT GLO	1.998.162,85	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/10/21	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	1.286.158,20	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	04/11/21	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	3.516.202,47	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/11/21	10/11/21	15/10/28	LIGHT	356.341,80	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	12/11/21	12/11/21	15/10/31	VAMOS	2.209.820,25	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/11/21	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	12.047,94	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/11/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	2.266.788,39	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/11/21	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	2.344.528,31	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	03/12/21	11/06/19	11/06/24	BNBBM	594.791,15	brAAA	AA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/12/21	06/12/21	15/12/35	TESC	2.726.195,24	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/12/21	06/01/21	15/11/25	QUATA	2.534.849,05	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/12/21	20/12/21	15/11/35	ORIZON	2.170.042,12	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/01/22	22/04/21	15/03/26	VIX LOGI	1.003.284,77	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/01/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.275.654,45	brAA	-	-
FIM EMB I A	19/01/22	19/01/22	19/01/24	BES INV	1.304.676,68	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/01/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	372.204,39	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/01/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	2.215.922,01	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	364.112,36	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	352.733,85	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	3.018.527,36	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	842.009,84	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	750.981,75	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/03/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	1.075.880,67	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	19/04/22	19/04/22	16/04/29	VERT-10	653.293,13	-	-	AAAsf(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/04/22	26/04/22	15/04/24	LIGHT	950.304,20	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	112.857,03	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.303.406,18	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	12/05/22	12/05/22	15/04/27	BRKA	1.883.448,43	-	A+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	12/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.562.422,31	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	19/05/22	19/05/22	13/05/28	CEA.MODA	482.616,62	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/05/22	26/05/22	10/05/27	GUAR	2.370.884,91	-	-	A
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	2.560.559,92	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	552.843,84	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.201.649,84	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	03/03/22	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	3.319.398,84	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/03/22	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	2.560.131,50	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/03/22	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	1.055.151,81	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/03/22	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	3.386.787,80	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/03/22	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	2.710.881,57	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/06/22	06/12/21	15/12/35	TESC	848.434,91	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	442.275,07	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	06/12/21	15/12/35	TESC	532.168,25	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	274.692,94	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	30/09/21	15/09/31	SIMPAN	1.909.863,13	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	08/07/21	15/06/31	VAMOS	905.339,55	brAA+	-	AAA(bra)

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2023



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

29/12/2023

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	08/07/21	15/06/31	VAMOS	73.862,20	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	778.495,49	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	880.320,11	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/06/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	1.358.546,04	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	27/06/22	27/06/22	07/07/24	LAGE	2.452.606,61	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	3.331.229,32	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	12/11/21	15/10/31	VAMOS	2.136.896,18	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	11/11/21	15/10/31	VAMOS	1.602.119,68	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	25/07/22	25/07/22	22/07/27	CM HOSPI	1.036.401,07	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/07/22	10/01/22	10/01/28	AMBIPAR	2.519.870,15	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	27/07/22	25/03/22	15/03/44	GBS PART	1.454.256,57	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/07/22	28/07/22	18/07/25	1V11	1.740.697,36	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	29/07/22	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	1.830.962,96	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/08/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	1.232,90	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	451.714,42	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	07/04/21	15/03/29	CAGECE	1.559.669,10	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	07/04/21	15/03/29	CAGECE	2.598.678,86	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/08/22	30/08/22	15/08/29	TRBR	5.869.025,87	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/09/22	02/09/22	02/09/29	AEGEA SA	1.767.329,91	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	27/09/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	53.014,84	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/09/22	28/09/22	28/09/27	B.BRASIL	4.435.156,50	-	AAA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/10/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	36.987,10	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	03/11/22	06/04/21	15/03/29	ANET	2.011.778,43	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	08/11/22	08/11/22	27/10/27	CM HOSPI	1.007.285,65	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/11/22	08/11/22	15/06/42	BRK AMBI	5.470.252,36	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/11/22	02/05/22	15/04/38	RDVE	1.795.545,57	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/11/22	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	1.659.786,36	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	11/11/22	11/11/22	15/10/40	RAHOLD	2.955.057,64	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	11/11/22	11/11/22	15/10/40	RAHOLD	10.958.482,75	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	3.934.670,36	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	1.771.196,02	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	1.450.241,04	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.449.630,13	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.764.619,86	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.445.114,15	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	01/12/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	1.703.578,12	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	2.197.621,24	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	2.331.329,86	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	1.700.499,43	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/12/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	3.052.803,68	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	15/12/21	15/11/36	ITAPOA T	1.255.819,23	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	02/05/22	15/04/38	RDVE	2.077.894,80	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	3.201.136,55	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/01/23	26/01/23	20/01/26	CELG	3.288.172,36	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/03/23	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	311.804,51	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	1.221.887,53	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	15/12/21	15/11/36	ITAPOA T	3.812.878,34	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	27/07/22	15/04/36	BRV_VDR	8.938.504,38	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/03/23	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.018.488,43	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	14/04/23	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	721.544,94	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	17/04/23	17/04/23	17/03/30	VERO	2.959.890,64	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/04/23	12/05/22	15/04/27	BRKA	1.118.515,38	-	A+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/04/23	12/05/22	15/04/27	BRKA	30.876,20	-	A+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/04/23	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	2.288.985,39	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	1.874.293,10	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	2.267.411,10	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	18/06/21	15/12/30	MG050	3.108.482,91	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	08/11/22	15/06/42	BRK AMBI	1.360.800,25	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	08/07/21	15/06/31	VAMOS	1.768.472,12	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	794.737,61	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	22/10/21	15/12/35	CART	1.501.963,50	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	2.444.170,84	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	02/10/20	15/09/34	BRKA	300.312,78	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	02/10/20	15/09/34	BRKA	2.866.519,40	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	18/03/21	15/02/31	CORSAN	1.615.253,14	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	22/10/21	15/12/35	CART	648.575,15	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	10/02/21	15/12/31	METRORIO	4.958.730,52	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/05/23	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	225.724,29	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/05/23	08/11/22	15/06/42	BRK AMBI	2.380.518,34	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/05/23	22/10/21	15/12/35	CART	2.139.160,13	brAA+	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.215.601,27	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	16/05/23	23/12/20	15/12/27	SABESP	2.268.508,26	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	21/07/21	15/07/31	CACHOEIR	1.960.906,69	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	29/10/21	15/10/26	COELBA	1.852.821,06	brAAA	-	-



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

29/12/2023

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FIM EMB I A	16/05/23	04/05/22	15/04/27	LOCALIZA	2.884.813,89	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	16/05/23	23/12/21	21/12/28	SMARTIFI	3.098.130,80	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/05/23	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	62.458,86	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/06/23	25/06/21	20/06/26	OURO VER	284.202,35	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	19/06/23	25/03/22	15/03/44	GBS PART	2.976.447,53	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	19/06/23	26/07/21	15/06/33	ASA BRAN	2.749.222,51	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	23/06/23	23/06/23	15/05/43	IGUA RJ	1.317.806,23	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/06/23	08/07/21	15/06/31	VAMOS	1.043.567,38	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/06/23	28/07/22	18/07/25	1V11	394.983,93	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	10/07/23	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	1.568.411,37	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	10/07/23	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	1.020.997,02	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	10/07/23	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	1.020.997,02	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	10/07/23	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	1.568.411,37	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/07/23	28/07/22	18/07/25	1V11	1.197.727,54	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/07/23	28/07/22	18/07/25	1V11	292.777,84	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/07/23	23/12/20	15/12/26	RD COLIN	1.539.568,50	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	31/07/23	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	1.470.270,75	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	31/07/23	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	1.470.270,75	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	31/07/23	15/12/11	15/11/36	ITAPOA T	2.467.445,42	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	31/07/23	26/07/21	15/06/33	ASA BRAN	2.706.045,92	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	01/08/23	31/07/23	25/07/28	TIMS A	2.587.303,48	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	09/08/23	17/04/23	17/03/30	VERO	1.306.657,18	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	09/08/23	06/12/21	15/12/35	TESC	1.992.129,83	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	09/08/23	02/05/22	15/04/38	RDVE	3.089.951,80	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/08/23	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.304.721,60	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/08/23	05/06/18	05/06/28	BRADESCO	4.175.821,99	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/08/23	08/08/23	15/01/34	SPERIO4	2.467.802,85	brAA+	-	-
FIRF EMB II A CRED PRV	29/08/23	29/08/23	29/08/25	BRADESCO	10.435.798,72	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRV	30/08/23	30/08/23	01/09/25	VOLKSWAG	6.242.427,60	brAAA	AAA.br	-
FIRF EMB II A CRED PRV	06/09/23	06/09/23	08/09/25	BTG PACT	10.408.865,35	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRV	08/09/23	08/09/23	08/09/25	B VOTORA	6.239.901,11	brAAA	AA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	14/09/23	06/01/21	15/11/25	QUATA	2.465,81	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	19/09/23	21/08/23	21/08/25	ABC	5.195.199,50	brAAA	AA+.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	19/09/23	13/09/23	15/09/25	PANAMERI	5.140.451,52	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/09/23	21/09/23	15/09/28	ELETROB	2.639.299,43	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/09/23	28/09/23	15/09/30	CSMG	2.542.674,06	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/09/23	23/12/21	21/12/28	SMARTIFI	2.402.569,05	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/09/23	19/05/21	10/05/30	RODO BR	2.554.692,70	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/09/23	06/09/21	20/08/31	S LUIZ A	1.502.132,35	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/09/23	13/09/23	15/09/25	B VOTORA	5.139.501,90	brAAA	AA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/10/23	14/11/22	10/10/31	CORREDOR	2.338.688,98	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/10/23	20/10/23	20/10/28	SANTANDE	3.999.850,60	-	AAA.br	A-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	07/11/23	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	3.032.608,16	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	07/11/23	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	2.948.871,64	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	07/11/23	18/03/21	15/02/31	CORSAN	3.015.291,82	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	07/11/23	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	3.061.381,13	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	16/11/23	18/06/21	15/12/30	MG050	932.647,36	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	17/11/23	23/08/22	15/08/32	PETRJ	4.574.318,78	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	23/11/23	29/09/22	15/09/28	VERT5	2.501.747,84	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	23/11/23	10/12/21	17/11/28	DESKTOP	2.553.323,81	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	04/12/23	12/02/21	15/12/35	MS 306	984.335,23	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	04/12/23	30/08/22	15/08/29	TRBR	2.027.935,75	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	04/12/23	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.021.740,86	-	Aa3.br	-
FIRF EMB II A CRED PRV	26/12/23	27/12/22	02/06/26	BRADESCO	10.019.619,07	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIM EMB VII A CRED PRV	-	-	-	FIDC VERDECARD SN3	528.666,67	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VII A CRED PRV	-	-	-	FIDC CREDZ SN6	2.261.438,84	brAA(sf)	-	A+(sf)(bra)
FIM EMB VI A CRED PRV	-	-	-	FIDC VERDECARD SN5	145.833,33	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRV	-	-	-	VERDECARD FIDC SN6	1.127.777,78	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRV	-	-	-	FIDC VERDECARD SN8	1.375.000,00	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRV	-	-	-	RB CAP CREDIT AL SN3	671.881,29	brAA-(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRV	-	-	-	BR ELETRO FIDC S1	2.256.620,27	-	-	Aas(f)(bra)
FIM EMB VI A CRED PRV	-	-	-	INSS CONS PDL I FIDC	1.906.341,91	-	-	AAAsf(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	-	-	-	DRIVER SIX FIDC SN	1.438.254,06	-	AAA.br	-

Observação: Em dezembro 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 **4.786.554.326,25**

Tópico do Enquadramento	Limite	Aplicação Atual	Valor Limite	% Aplicado	Status
% do Segmento RF/PL PLANO	100,00%	4.174.742.835,79	4.786.554.326,25	87,22%	Enquadrado
% do PL em Títulos de Emissão do Tesouro Nacional e/ou do BACEN	100,00%	3.424.855.084,04	4.786.554.326,25	71,55%	Enquadrado
% do PL em Títulos RF1, exceto títulos do Tesouro Nacional	80,00%	749.887.751,74	3.829.243.518,06	15,67%	Enquadrado
% do PL em FIDC	20,00%	Verificar Rel. de Diversificação de FIDC's	957.310.879,52	0,00%	Enquadrado
% do PL em uma mesma pessoa jurídica não-financeira	10,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Não Financ.	478.655.439,76	0,00%	Enquadrado
% do PL em Instituições Financeiras	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Financ.	1.196.638.581,56	0,00%	Enquadrado
% de uma mesma Série de Debêntures	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Debêntures	1.196.638.581,56	0,00%	Enquadrado
% do PL em RV	70,00%	516.808.265,63	3.350.587.971,31	10,80%	Enquadrado
% do capital votante de uma empresa	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação RV	1.196.638.581,56	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Imobiliários	20,00%	78.541.801,69	957.310.879,52	1,64%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Empréstimos	15,00%	24.954.938,88	717.983.177,47	0,52%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Estruturados	20,00%	0,00	957.310.879,52	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos no Exterior	10,00%	0,00	478.655.439,76	0,00%	Enquadrado

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

6.2. Relatório de Túnel de Preços

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE DEZEMBRO DE 2023 À 29 DE DEZEMBRO DE 2023



FIM EMB I A												
DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	FONTE ANBIMA				FORA DO TÚNEL
								TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	
01/12/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Compra	5,4990%	5,4782%	5,2526%	5,7478%	0,0208%	NÃO
01/12/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Compra	5,4990%	5,4782%	5,2526%	5,7478%	0,0208%	NÃO
01/12/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Compra	5,4990%	5,4782%	5,2526%	5,7478%	0,0208%	NÃO
08/12/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/09/2025	Compra	0,0237%	0,0235%	0,0083%	0,0518%	0,0002%	NÃO
13/12/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/09/2026	Compra	0,0816%	0,0800%	0,0658%	0,0978%	0,0016%	NÃO
14/12/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	5,6305%	5,5864%	5,4666%	5,7988%	0,0441%	NÃO
18/12/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Venda	5,2810%	5,1915%	4,9958%	5,4920%	0,0895%	NÃO
18/12/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Venda	5,2510%	5,1915%	4,9958%	5,4920%	0,0595%	NÃO
18/12/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Venda	5,2510%	5,1915%	4,9958%	5,4920%	0,0595%	NÃO
18/12/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Venda	5,2510%	5,1915%	4,9958%	5,4920%	0,0595%	NÃO
18/12/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Venda	5,2510%	5,1915%	4,9958%	5,4920%	0,0595%	NÃO
18/12/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Venda	5,2510%	5,1915%	4,9958%	5,4920%	0,0595%	NÃO
18/12/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Venda	5,2510%	5,1915%	4,9958%	5,4920%	0,0595%	NÃO
18/12/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Venda	5,2510%	5,1915%	4,9958%	5,4920%	0,0595%	NÃO
18/12/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Venda	5,2510%	5,1915%	4,9958%	5,4920%	0,0595%	NÃO
18/12/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Venda	5,2510%	5,1915%	4,9958%	5,4920%	0,0595%	NÃO
18/12/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Venda	5,2510%	5,1915%	4,9958%	5,4920%	0,0595%	NÃO
18/12/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Venda	5,2510%	5,1915%	4,9958%	5,4920%	0,0595%	NÃO
18/12/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Venda	5,2510%	5,1915%	4,9958%	5,4920%	0,0595%	NÃO
18/12/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Venda	5,2510%	5,1915%	4,9958%	5,4920%	0,0595%	NÃO
18/12/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Venda	5,2510%	5,1915%	4,9958%	5,4920%	0,0595%	NÃO
18/12/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Venda	5,2510%	5,1915%	4,9958%	5,4920%	0,0595%	NÃO
18/12/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Venda	5,2510%	5,1915%	4,9958%	5,4920%	0,0595%	NÃO
18/12/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Venda	5,2510%	5,1915%	4,9958%	5,4920%	0,0595%	NÃO
18/12/2023	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2026	Venda	5,2510%	5,1915%	4,9958%	5,4920%	0,0595%	NÃO

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE DEZEMBRO DE 2023 À 29 DE DEZEMBRO DE 2023



FIRF EMB II A CRED PRIV												
DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	FONTE ANBIMA				FORA DO TÚNEL
								TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	
18/12/2023	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	CAPITAL	LTN	01/04/2025	Venda	9,8839%	9,9026%	9,6408%	10,3065%	-0,0187%	NÃO
18/12/2023	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	CAPITAL	LTN	01/10/2025	Compra	9,7713%	9,7904%	9,4465%	10,2151%	-0,0191%	NÃO
18/12/2023	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2025	Compra	5,5573%	5,5800%	5,3218%	5,9250%	-0,0227%	NÃO
19/12/2023	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	LFT	01/03/2026	Venda	0,0416%	0,0410%	0,0287%	0,0781%	0,0006%	NÃO
19/12/2023	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2025	Compra	5,5795%	5,5540%	5,2720%	5,8751%	0,0255%	NÃO
19/12/2023	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2025	Compra	5,5173%	5,5540%	5,2720%	5,8751%	-0,0367%	NÃO
19/12/2023	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2025	Compra	5,5173%	5,5540%	5,2720%	5,8751%	-0,0367%	NÃO
19/12/2023	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2025	Compra	5,5173%	5,5540%	5,2720%	5,8751%	-0,0367%	NÃO
19/12/2023	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2028	Compra	5,2391%	5,2545%	5,0191%	5,5082%	-0,0154%	NÃO
19/12/2023	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2028	Compra	5,2391%	5,2545%	5,0191%	5,5082%	-0,0154%	NÃO
20/12/2023	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	CAPITAL	LTN	01/04/2025	Venda	9,8339%	9,8760%	9,5891%	10,2529%	-0,0421%	NÃO
20/12/2023	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	CAPITAL	LTN	01/10/2025	Compra	9,7063%	9,7314%	9,3946%	10,1620%	-0,0251%	NÃO
21/12/2023	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	TERRA	LTN	01/04/2025	Venda	9,8560%	9,8856%	9,5807%	10,2435%	-0,0296%	NÃO
21/12/2023	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	TERRA	LTN	01/10/2025	Compra	9,7190%	9,7353%	9,3737%	10,1405%	-0,0163%	NÃO
21/12/2023	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	CAPITAL	LTN	01/10/2025	Compra	9,7063%	9,7353%	9,3737%	10,1405%	-0,0290%	NÃO
26/12/2023	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	CAPITAL	LTN	01/07/2025	Venda	9,7810%	9,7592%	9,4591%	10,1723%	0,0218%	NÃO

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2023

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

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



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
01-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	AZUL4	17,07	5.800,00	98.978,35	16,86	17,09	17,34	16.140,00
01-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	BBSE3	31,01	5.800,00	179.858,00	30,77	30,94	31,34	35.307,00
01-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	BBSE3	31,00	28.800,00	892.859,46	30,77	30,94	31,34	35.307,00
01-12-23	FIA RVA EMB II	Compra	CIEL3	4,33	111.700,00	483.655,76	4,07	4,25	4,35	35.072,00
01-12-23	FIA RVA EMB II	Compra	CIEL3	4,25	167.700,00	712.981,08	4,07	4,25	4,35	35.072,00
01-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	HAPV3	4,31	99.200,00	427.536,08	4,24	4,38	4,48	60.677,00
01-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	KLBN11	21,22	18.600,00	394.692,00	21,15	21,41	22,13	34.361,00
01-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	TOTS3	33,40	10.400,00	347.346,18	33,00	33,57	33,93	15.138,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	25,41	800,00	20.324,41	24,89	25,25	25,65	25.041,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	12,91	1.400,00	18.078,97	12,52	12,83	13,04	24.828,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	14,93	2.100,00	31.353,00	14,68	14,85	14,98	10.110,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	14,87	6.400,00	95.174,21	14,68	14,85	14,98	10.110,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	14,88	2.700,00	40.188,96	14,68	14,85	14,98	10.110,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	54,25	3.500,00	189.873,85	53,88	54,25	54,80	31.712,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	30,95	1.000,00	30.952,77	30,77	30,94	31,34	35.307,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	30,95	2.700,00	83.559,14	30,77	30,94	31,34	35.307,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	35,07	1.000,00	35.066,30	34,59	35,24	35,52	25.911,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	4,31	3.600,00	15.516,00	4,07	4,25	4,35	35.072,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	4,25	118.600,00	503.640,19	4,07	4,25	4,35	35.072,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	41,07	1.600,00	65.717,89	40,31	40,95	41,38	22.406,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENAT3	15,44	2.200,00	33.962,70	15,32	15,42	15,55	5.856,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,87	1.800,00	23.163,00	12,45	12,73	12,95	20.921,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,64	6.000,00	75.825,16	12,45	12,73	12,95	20.921,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,88	6.900,00	88.883,95	12,45	12,73	12,95	20.921,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,81	3.700,00	47.399,63	12,45	12,73	12,95	20.921,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	52,37	600,00	31.419,50	51,93	52,52	53,19	12.927,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	52,40	700,00	36.680,00	51,93	52,52	53,19	12.927,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENJU3	1,54	9.900,00	15.214,83	1,51	1,52	1,57	1.471,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	33,90	2.100,00	71.186,23	33,70	33,94	34,17	26.859,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	33,88	4.300,00	145.692,68	33,70	33,94	34,17	26.859,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	17,31	700,00	12.118,80	17,11	17,33	17,50	13.537,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,38	14.700,00	64.428,59	4,24	4,38	4,48	60.677,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,42	6.700,00	29.589,29	4,24	4,38	4,48	60.677,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	23,32	3.000,00	69.964,92	22,61	23,19	23,47	21.894,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	31,36	1.900,00	59.591,53	31,13	31,32	31,68	52.267,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	16,47	1.500,00	24.702,18	16,18	16,45	16,75	40.883,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	16,79	1.300,00	21.822,29	16,07	16,68	17,02	27.499,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	10,96	3.600,00	39.458,50	10,77	10,99	11,16	13.755,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	PETR4	35,78	900,00	32.203,90	35,53	35,76	36,00	58.333,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	PETZ3	4,29	2.900,00	12.429,00	4,09	4,22	4,34	12.094,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	44,79	700,00	31.350,67	44,27	44,94	46,08	39.619,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	44,57	3.500,00	155.999,81	44,27	44,94	46,08	39.619,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,74	2.400,00	54.583,68	22,34	22,76	23,10	21.235,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,70	6.300,00	142.999,18	22,34	22,76	23,10	21.235,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	20,67	1.400,00	28.941,89	20,03	20,56	20,91	14.943,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	60,21	800,00	48.168,86	59,25	60,04	60,74	23.236,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	SBS3	68,02	400,00	27.208,16	66,95	67,94	68,66	12.265,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	SCAR3	23,95	500,00	11.974,80	23,30	23,92	24,79	156,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	23,88	4.100,00	97.923,39	22,94	23,83	24,36	13.413,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	23,92	1.400,00	33.489,59	22,94	23,83	24,36	13.413,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	23,88	2.700,00	64.470,58	22,94	23,83	24,36	13.413,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	24,23	2.800,00	67.837,80	22,94	23,83	24,36	13.413,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	6,35	4.100,00	26.023,26	5,91	6,22	6,42	22.879,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	6,06	2.300,00	13.946,43	5,91	6,22	6,42	22.879,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	52,17	5.800,00	302.582,45	51,37	52,03	53,87	39.700,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	52,17	1.000,00	52.173,10	51,37	52,03	53,87	39.700,00
01-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	23,73	10.700,00	253.961,85	23,09	23,66	24,20	35.811,00
01-12-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	BTGL11	100,84	2.257,00	227.600,48	99,63	100,47	101,00	10.349,00
04-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	ARZZ3	57,59	4.200,00	241.860,20	57,50	58,23	59,82	8.751,00
04-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	ENEV3	12,54	48.100,00	603.071,21	12,49	12,61	13,05	15.694,00
04-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	52,73	12.100,00	638.058,96	52,54	52,92	53,49	9.472,00
04-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	25,17	500,00	12.582,84	25,03	25,24	25,63	10.722,00
04-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	14,91	7.000,00	104.399,65	14,86	14,92	15,00	13.411,00
04-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	54,14	300,00	16.243,36	53,96	54,29	54,81	19.683,00
04-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	30,89	500,00	15.447,24	30,82	30,92	31,14	26.997,00
04-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	35,04	400,00	14.016,99	34,87	35,04	35,35	16.360,00
04-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	CIEL3	4,33	3.200,00	13.870,97	4,28	4,34	4,42	26.998,00
04-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	40,69	1.000,00	40.687,67	40,47	40,74	41,23	15.734,00
04-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENAT3	14,81	1.900,00	28.142,15	14,66	14,84	15,37	6.612,00
04-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,57	2.600,00	32.694,10	12,49	12,61	13,05	15.694,00
04-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,59	3.600,00	45.317,93	12,49	12,61	13,05	15.694,00
04-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	52,73	800,00	42.180,32	52,54	52,92	53,49	9.472,00
04-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	33,81	1.400,00	47.338,78	33,72	33,88	34,09	15.390,00
04-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	33,81	1.300,00	43.951,84	33,72	33,88	34,09	15.390,00
04-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	23,36	400,00	9.344,00	23,15	23,40	23,62	10.575,00
04-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	23,41	2.600,00	60.866,00	23,15	23,40	23,62	10.575,00
04-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	23,41	1.500,00	35.112,92	23,15	23,40	23,62	10.575,00
04-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	31,46	1.300,00	40.897,44	31,31	31,50	31,75	30.081,00
04-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	LREN3	16,09	1.300,00	20.919,74	15,93	16,14	16,44	36.799,00
04-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	16,72	3.400,00	56.857,44	16,40	16,71	16,88	29.818,00
04-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	44,28	300,00	13.284,62	43,74	44,18	44,56	26.680,00
04-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,63	1.300,00	29.418,19	22,48	22,61	22,84	16.597,00
04-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	20,25	1.100,00	22.273,24	20,05	20,32	20,91	13.761,00
04-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	60,61	600,00	36.366,96	60,15	60,54	61,00	13.727,00
04-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	23,71	800,00	18.971,74	23,33	23,66	24,38	7.991,00
04-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	52,02	600,00	31.214,86	51,76	51,99	52,45	30.042,00
04-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	23,29	2.000,00	46.579,27	23,02	23,26	24,05	33.646,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2023

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

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



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
04-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	14,90	5.779,00	86.125,38	14,86	14,92	15,00	13.411,00
04-12-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	BTGL11	100,23	10.549,00	1.057.294,11	99,90	100,21	100,71	9.612,00
04-12-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	GALG11	9,17	50.389,00	462.151,70	9,16	9,17	9,23	6.186,00
05-12-23	FIA RVA EMB II	Compra	CIEL3	4,39	37.100,00	162.717,36	4,34	4,41	4,48	21.426,00
05-12-23	FIA RVA EMB II	Compra	CMIG4	11,09	142.200,00	1.577.261,06	10,97	11,06	11,14	17.336,00
05-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	CPFE3	37,48	9.600,00	359.798,64	37,09	37,44	37,63	5.448,00
05-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	CPL6	9,45	54.800,00	518.028,89	9,22	9,39	9,50	19.802,00
05-12-23	FIA RVA EMB II	Compra	CURY3	16,85	7.000,00	117.982,67	16,65	16,86	17,22	6.960,00
05-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	ELET6	45,33	13.500,00	611.917,27	44,37	45,21	45,59	5.700,00
05-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	MRF3	9,61	38.500,00	369.985,00	9,48	9,66	10,03	19.888,00
05-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	MRVE3	9,08	69.400,00	629.907,48	8,94	9,14	9,33	36.922,00
05-12-23	FIA RVA EMB II	Compra	SBFG3	11,51	40.400,00	464.877,79	11,08	11,43	11,73	9.605,00
05-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	54,29	1.000,00	54.286,52	54,01	54,30	54,54	16.873,00
05-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	41,56	2.200,00	91.436,50	40,51	41,35	41,79	23.535,00
05-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENAT3	14,61	2.800,00	40.921,15	14,29	14,55	14,96	9.205,00
05-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,56	1.000,00	12.561,21	12,35	12,52	12,71	15.022,00
05-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	52,81	1.400,00	73.927,61	52,27	52,83	53,26	8.625,00
05-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	34,31	2.200,00	75.484,11	33,78	34,36	34,56	17.091,00
05-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	17,67	6.000,00	106.041,13	17,38	17,58	17,70	11.765,00
05-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	31,87	4.800,00	152.961,42	31,52	31,77	31,96	39.647,00
05-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	16,19	3.900,00	63.139,80	16,00	16,23	16,62	28.690,00
05-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	11,40	500,00	5.698,88	11,11	11,37	11,55	9.559,00
05-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	11,46	900,00	10.314,00	11,11	11,37	11,55	9.559,00
05-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	11,36	3.500,00	39.770,76	11,11	11,37	11,55	9.559,00
05-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETRA	34,86	6.000,00	209.148,26	34,68	34,86	35,17	76.456,00
05-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	43,35	4.800,00	208.081,89	42,80	43,45	44,44	40.952,00
05-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	6,41	10.400,00	66.619,62	6,23	6,41	6,52	21.810,00
05-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	23,00	900,00	20.699,97	21,72	22,31	23,42	45.104,00
05-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	22,74	3.471,00	78.933,40	21,72	22,31	23,42	45.104,00
05-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	22,31	4.215,00	94.027,02	21,72	22,31	23,42	45.104,00
05-12-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	BTGL11	100,47	4.589,00	461.040,45	100,10	100,43	100,71	8.374,00
05-12-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	NEWL11	108,15	28.390,00	3.070.428,00	108,06	108,15	108,30	57,00
05-12-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	NEWU11	82,48	10.912,00	900.021,76	82,48	82,48	83,95	3,00
06-12-23	FIA RVA EMB II	Compra	AZUL4	16,30	8.500,00	138.550,00	16,13	16,38	16,55	15.530,00
06-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	B3SA3	13,23	18.000,00	238.140,00	13,15	13,26	13,60	39.436,00
06-12-23	FIA RVA EMB II	Compra	CBAV3	4,15	54.100,00	224.515,00	4,08	4,12	4,22	12.361,00
06-12-23	FIA RVA EMB II	Compra	CMIG4	11,19	28.900,00	323.387,98	11,08	11,16	11,29	21.342,00
06-12-23	FIA RVA EMB II	Compra	CURY3	16,35	21.700,00	354.795,00	16,16	16,48	17,03	6.526,00
06-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	MRF3	9,34	6.000,00	56.055,20	9,20	9,41	9,59	18.178,00
06-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	PETR3	35,34	8.600,00	303.924,00	35,30	35,59	36,23	18.332,00
06-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	PRI03	41,59	4.400,00	183.016,83	41,15	41,87	42,80	55.570,00
06-12-23	FIA RVA EMB II	Compra	SBFG3	11,39	9.000,00	102.510,00	11,28	11,47	11,68	7.970,00
06-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	UGPA3	25,44	21.000,00	534.246,35	24,91	25,50	25,70	24.540,00
06-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	53,20	2.400,00	127.676,32	52,90	53,29	54,48	28.449,00
06-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	30,62	2.300,00	70.420,26	30,60	30,74	31,00	12.838,00
06-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	30,70	4.500,00	138.170,62	30,60	30,74	31,00	12.838,00
06-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	41,40	2.500,00	103.489,62	41,17	41,41	41,96	14.858,00
06-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	52,66	700,00	36.862,10	51,90	52,62	53,68	9.556,00
06-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	34,05	7.300,00	248.595,16	33,87	34,05	34,67	19.699,00
06-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	23,39	3.800,00	88.886,12	22,97	23,26	23,72	13.721,00
06-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	23,22	4.400,00	102.187,65	22,97	23,26	23,72	13.721,00
06-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	31,48	2.700,00	85.003,08	31,32	31,53	32,00	37.700,00
06-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	16,37	6.400,00	104.776,53	16,25	16,40	16,66	26.851,00
06-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	17,44	2.800,00	48.822,73	17,00	17,31	17,68	33.096,00
06-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	17,49	4.600,00	80.437,13	17,00	17,31	17,68	33.096,00
06-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	17,45	1.100,00	19.195,00	17,00	17,31	17,68	33.096,00
06-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	17,49	7.000,00	122.431,78	17,00	17,31	17,68	33.096,00
06-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETRA	34,32	4.300,00	147.584,35	33,50	33,95	34,80	90.617,00
06-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	42,16	3.500,00	147.574,40	41,15	41,87	42,80	55.570,00
06-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,42	2.800,00	62.770,15	22,24	22,49	22,70	20.084,00
06-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	6,56	15.900,00	104.240,52	6,47	6,62	6,81	28.594,00
06-12-23	FIA RVA EMB IV	Compra	PRI03	42,32	6,00	253,89	41,15	41,87	42,80	55.570,00
06-12-23	FIA RVA EMB IV	Compra	PRI03	41,65	15,00	624,77	41,15	41,87	42,80	55.570,00
06-12-23	FIA RVA EMB IV	Compra	PRI03	41,99	12,00	503,91	41,15	41,87	42,80	55.570,00
06-12-23	FIA RVA EMB IV	Compra	PRI03	42,10	35,00	1.473,33	41,15	41,87	42,80	55.570,00
06-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	21,82	1.172,00	25.569,30	21,49	21,90	22,43	38.447,00
06-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	21,85	47,00	1.026,95	21,49	21,90	22,43	38.447,00
06-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	21,86	124,00	2.710,64	21,49	21,90	22,43	38.447,00
06-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	21,74	5.397,00	117.343,61	21,49	21,90	22,43	38.447,00
06-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	22,03	2.837,00	62.500,95	21,49	21,90	22,43	38.447,00
07-12-23	FIA RVA EMB II	Compra	AZUL4	16,75	5.700,00	95.455,00	16,40	16,70	16,89	9.539,00
07-12-23	FIA RVA EMB II	Compra	CVCB3	3,75	120.100,00	450.622,84	3,66	3,77	3,92	17.565,00
07-12-23	FIA RVA EMB II	Compra	ENEV3	12,46	30.800,00	383.834,09	12,25	12,42	12,60	13.984,00
07-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	ITUB4	31,42	36.100,00	1.134.123,49	31,21	31,46	31,62	29.798,00
07-12-23	FIA RVA EMB II	Compra	LIQ03	5,44	85.900,00	467.090,74	5,09	5,40	5,57	8.209,00
07-12-23	FIA RVA EMB II	Compra	RENT3	61,13	4.100,00	250.646,54	60,75	61,25	61,83	17.317,00
07-12-23	FIA RVA EMB II	Compra	SBFG3	11,66	9.000,00	104.924,00	11,34	11,59	11,83	8.304,00
07-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	UGPA3	25,56	30.000,00	766.800,00	25,31	25,53	25,77	13.131,00
07-12-23	FIA RVA EMB II	Compra	VALE3	72,79	5.400,00	393.075,00	72,42	72,75	73,08	32.736,00
07-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	25,26	900,00	22.738,00	24,96	25,24	25,38	9.262,00
07-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	53,66	400,00	21.463,00	53,00	53,59	53,89	15.740,00
07-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	31,26	800,00	25.006,32	30,70	31,04	31,47	16.971,00
07-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	34,20	700,00	23.942,47	33,68	34,17	34,85	17.259,00
07-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	CIEL3	4,36	3.600,00	15.685,00	4,29	4,36	4,47	13.725,00
07-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	41,53	1.600,00	66.442,86	41,31	41,54	41,81	11.529,00
07-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,42	4.600,00	57.130,54	12,25	12,42	12,60	13.984,00
07-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,44	4.000,00	49.768,32	12,25	12,42	12,60	13.984,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2023

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE DEZEMBRO DE 2023 À 29 DE DEZEMBRO 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
07-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	33,99	2.200,00	74.782,98	33,82	34,06	34,22	15.568,00
07-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	17,40	1.300,00	22.623,71	17,16	17,37	17,59	8.047,00
07-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,26	14.700,00	62.617,45	4,22	4,29	4,41	29.963,00
07-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	23,21	800,00	18.570,00	23,10	23,23	23,42	11.418,00
07-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	31,45	2.100,00	66.039,40	31,21	31,46	31,62	29.798,00
07-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	16,77	100,00	1.676,82	16,32	16,51	16,90	23.663,00
07-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	17,37	1.200,00	20.842,00	17,18	17,37	17,57	32.184,00
07-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRIO3	42,22	800,00	33.775,00	41,61	42,18	42,63	31.411,00
07-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,48	2.800,00	62.932,20	22,38	22,50	22,66	12.689,00
07-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	19,97	1.500,00	29.961,49	19,33	19,94	20,18	11.099,00
07-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	61,06	900,00	54.953,64	60,75	61,25	61,83	17.317,00
07-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT9	47,13	12,00	565,56	60,75	61,25	61,83	17.317,00
07-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	SBSF3	67,79	400,00	27.117,00	67,28	67,93	69,18	22.069,00
07-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	24,00	2.200,00	52.800,00	23,49	23,99	24,20	10.819,00
07-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	24,01	2.500,00	60.029,61	23,49	23,99	24,20	10.819,00
07-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	23,99	3.100,00	74.370,67	23,49	23,99	24,20	10.819,00
07-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	6,66	300,00	1.999,23	6,50	6,84	6,96	19.308,00
07-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	6,89	3.100,00	21.348,00	6,50	6,84	6,96	19.308,00
07-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	51,01	2.500,00	127.522,73	50,67	51,00	51,59	19.891,00
07-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	51,03	1.400,00	71.435,37	50,67	51,00	51,59	19.891,00
07-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	21,94	2.600,00	57.041,56	21,77	21,93	22,16	19.026,00
07-12-23	FIA RVA EMB IV	Compra	PRIO3	42,34	1.712,00	72.487,35	41,61	42,18	42,63	31.411,00
07-12-23	FIA RVA EMB IV	Compra	PRIO3	42,36	1.265,00	53.585,48	41,61	42,18	42,63	31.411,00
07-12-23	FIA RVA EMB IV	Compra	PRIO3	42,46	1.470,00	62.419,64	41,61	42,18	42,63	31.411,00
07-12-23	FIA RVA EMB IV	Compra	PRIO3	42,15	5.566,00	234.612,83	41,61	42,18	42,63	31.411,00
07-12-23	FIA RVA EMB IV	Compra	PRIO3	42,01	23,00	966,23	41,61	42,18	42,63	31.411,00
07-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	RENT9	47,13	12,00	565,56	60,75	61,25	61,83	17.317,00
07-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	21,87	1.273,00	27.842,12	21,77	21,93	22,16	19.026,00
07-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	21,99	2.753,00	60.538,47	21,77	21,93	22,16	19.026,00
07-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	21,93	6.991,00	153.317,01	21,77	21,93	22,16	19.026,00
07-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	21,93	3.204,00	70.250,57	21,77	21,93	22,16	19.026,00
08-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	RDO33	26,33	30.000,00	790.047,00	25,32	26,20	26,64	29.664,00
08-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	UGPA3	25,56	14.800,00	378.257,00	25,40	25,72	25,93	18.074,00
08-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	54,28	900,00	48.855,26	53,66	54,29	54,60	22.053,00
08-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	31,21	5.200,00	162.268,01	30,76	31,16	31,36	12.384,00
08-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	31,26	1.600,00	50.015,54	30,76	31,16	31,36	12.384,00
08-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	31,85	4.400,00	140.121,74	31,44	31,88	32,12	27.986,00
08-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	16,96	1.200,00	20.347,44	16,63	16,94	17,53	31.818,00
08-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETRA	34,13	1.900,00	64.842,26	33,48	34,10	34,54	66.653,00
08-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRIO3	43,65	1.900,00	82.931,34	42,25	43,94	44,79	44.380,00
08-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,15	4.000,00	88.611,15	22,06	22,24	22,61	22.013,00
08-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	24,71	5.800,00	143.295,12	23,91	24,45	24,88	11.675,00
08-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	22,39	258,00	5.777,88	21,75	22,21	22,84	25.861,00
08-12-23	FIA RVA EMB IV	Compra	PRIO3	44,15	4.543,00	200.595,34	42,25	43,94	44,79	44.380,00
08-12-23	FIA RVA EMB IV	Compra	PRIO3	44,23	12.066,00	533.706,54	42,25	43,94	44,79	44.380,00
08-12-23	FIA RVA EMB IV	Compra	PRIO3	44,64	978,00	43.653,84	42,25	43,94	44,79	44.380,00
08-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	21,95	2.715,00	59.594,67	21,75	22,21	22,84	25.861,00
08-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	21,94	10.646,00	233.577,31	21,75	22,21	22,84	25.861,00
08-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	21,88	587,00	12.841,45	21,75	22,21	22,84	25.861,00
08-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	22,20	539,00	11.967,69	21,75	22,21	22,84	25.861,00
08-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	21,99	199,00	4.375,93	21,75	22,21	22,84	25.861,00
11-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	BPAC11	34,40	30.000,00	1.032.129,00	34,03	34,47	34,66	11.250,00
11-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	31,33	2.700,00	84.589,86	31,05	31,27	31,46	8.747,00
11-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,64	6.900,00	87.186,16	12,53	12,65	12,88	10.888,00
11-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,25	20.100,00	85.342,76	4,20	4,25	4,35	23.607,00
11-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	22,10	2.807,00	62.032,95	21,93	22,08	22,38	17.629,00
11-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	22,03	2.147,00	47.298,41	21,93	22,08	22,38	17.629,00
11-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	21,96	6.441,00	141.473,99	21,93	22,08	22,38	17.629,00
11-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	22,07	2.764,00	61.002,18	21,93	22,08	22,38	17.629,00
12-12-23	FIA RVA EMB II	Compra	BBSE3	31,32	14.300,00	447.859,53	31,20	31,28	31,41	12.808,00
12-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	BRFS3	13,62	1.500,00	20.430,00	13,37	13,61	13,87	15.967,00
12-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	BRFS3	13,59	36.100,00	490.498,80	13,37	13,61	13,87	15.967,00
12-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	GMAT3	6,15	41.600,00	255.840,00	6,15	6,17	6,24	2.317,00
12-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	PRIO3	43,92	25.000,00	1.098.110,00	43,46	43,82	44,67	27.239,00
12-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	31,31	3.100,00	97.056,80	31,20	31,28	31,41	12.808,00
12-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	31,31	1.000,00	31.309,60	31,20	31,28	31,41	12.808,00
12-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,73	14.300,00	182.056,89	12,60	12,75	12,86	10.363,00
12-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,75	10.600,00	135.195,96	12,60	12,75	12,86	10.363,00
12-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,75	3.300,00	42.075,00	12,60	12,75	12,86	10.363,00
12-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,11	3.400,00	13.969,43	4,03	4,14	4,25	48.912,00
12-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	21,64	2.366,00	51.202,18	21,25	21,46	22,07	27.186,00
12-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	21,49	1.460,00	31.375,40	21,25	21,46	22,07	27.186,00
12-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	21,36	3.271,00	69.873,48	21,25	21,46	22,07	27.186,00
12-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	21,40	7.445,00	159.317,20	21,25	21,46	22,07	27.186,00
13-12-23	FIA RVA EMB II	Compra	ABEV3	14,70	24.100,00	354.270,00	14,14	14,53	14,80	50.273,00
13-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	BBDC4	16,39	26.800,00	439.370,00	16,25	16,63	17,01	124.059,00
13-12-23	FIA RVA EMB II	Compra	GGPS3	19,58	23.100,00	452.298,00	19,16	19,49	19,76	5.487,00
13-12-23	FIA RVA EMB II	Compra	LIQO3	5,42	17.200,00	93.179,99	5,30	5,45	5,65	9.209,00
13-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	LREN3	15,99	36.100,00	577.224,00	15,95	16,33	16,82	35.559,00
13-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	WEGE3	34,87	8.100,00	282.438,00	34,62	35,48	36,15	19.565,00
13-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	30,75	900,00	27.675,00	30,13	30,58	31,12	46.961,00
13-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	30,50	10.700,00	326.347,52	30,13	30,58	31,12	46.961,00
13-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	30,68	800,00	24.542,39	30,13	30,58	31,12	46.961,00
13-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	35,75	1.800,00	64.351,25	34,20	35,29	36,00	27.941,00
13-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	41,31	1.100,00	45.439,70	40,53	41,48	42,00	23.645,00
13-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	13,06	7.600,00	99.258,07	12,68	13,10	13,42	30.852,00
13-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	13,12	15.900,00	208.666,23	12,68	13,10	13,42	30.852,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2023

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE DEZEMBRO DE 2023 À 29 DE DEZEMBRO 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
13-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	34,41	1.600,00	55.057,17	33,90	34,42	34,83	47.847,00
13-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	34,19	2.400,00	82.059,69	33,90	34,42	34,83	47.847,00
13-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	32,26	8.200,00	264.503,75	31,64	32,18	32,77	86.782,00
13-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	LREN3	16,21	2.000,00	32.427,93	15,95	16,33	16,82	35.559,00
13-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	16,96	5.600,00	94.999,20	16,74	17,10	17,35	28.289,00
13-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	44,71	500,00	22.353,71	43,92	44,90	45,76	32.561,00
13-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	21,97	1.600,00	35.147,01	21,56	22,02	22,41	47.260,00
13-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	21,87	5.000,00	109.356,92	21,56	22,02	22,41	47.260,00
13-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	20,42	1.100,00	22.462,69	20,07	20,58	21,10	13.750,00
13-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	63,11	2.300,00	145.151,88	60,35	62,00	63,62	24.801,00
13-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	SBS3	71,05	200,00	14.210,32	69,40	70,91	71,93	19.317,00
13-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	25,59	800,00	20.470,79	24,76	25,47	25,82	14.286,00
13-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	25,54	1.000,00	25.535,57	24,76	25,47	25,82	14.286,00
13-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	25,48	1.500,00	38.220,44	24,76	25,47	25,82	14.286,00
13-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	25,82	500,00	12.910,00	24,76	25,47	25,82	14.286,00
13-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	6,96	27.700,00	192.924,12	6,57	6,88	7,11	28.913,00
13-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	51,54	900,00	46.388,57	50,95	51,64	52,06	20.783,00
13-12-23	FIA RVA EMB IV	Compra	CPL6	9,71	9.669,00	93.847,07	9,56	9,73	9,86	25.891,00
13-12-23	FIA RVA EMB IV	Compra	CPL6	9,74	1.176,00	11.457,00	9,56	9,73	9,86	25.891,00
13-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	GGPS3	19,53	4.125,00	80.578,89	19,16	19,49	19,76	5.487,00
13-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	GGPS3	19,55	1.347,00	26.332,23	19,16	19,49	19,76	5.487,00
13-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	21,59	1.010,00	21.801,23	21,38	21,58	21,77	34.009,00
13-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	21,54	8.469,00	182.437,35	21,38	21,58	21,77	34.009,00
13-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	21,59	273,00	5.894,07	21,38	21,58	21,77	34.009,00
13-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	21,55	4.690,00	101.063,68	21,38	21,58	21,77	34.009,00
13-12-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	XPLG11	106,45	2.654,00	282.526,39	106,25	106,48	106,79	5.875,00
14-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	ENGI11	51,95	25.300,00	1.314.222,42	51,08	51,82	53,26	18.512,00
14-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	EQTL3	33,84	25.000,00	846.099,18	33,72	34,38	35,21	36.959,00
14-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	TOTS3	34,04	13.600,00	462.994,00	33,47	33,89	34,55	17.975,00
14-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	26,74	500,00	13.371,25	26,24	26,77	27,15	20.568,00
14-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ASA3	13,37	900,00	12.031,40	13,02	13,40	13,84	40.077,00
14-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	13,43	1.700,00	22.827,29	13,21	13,39	13,49	10.321,00
14-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	53,16	1.200,00	63.786,91	52,40	53,06	53,56	37.707,00
14-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	31,69	2.600,00	82.398,96	31,15	31,61	31,99	29.463,00
14-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	36,79	2.500,00	91.963,16	35,84	36,63	37,12	26.318,00
14-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	CIEL3	4,53	9.900,00	44.844,17	4,48	4,53	4,60	34.029,00
14-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	41,37	3.400,00	140.649,27	41,00	41,49	42,16	32.717,00
14-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENAT3	15,29	1.900,00	29.059,26	14,98	15,25	15,43	5.418,00
14-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	13,42	9.700,00	130.204,79	13,30	13,42	13,60	18.597,00
14-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	34,20	4.900,00	167.564,28	33,72	34,38	35,21	36.959,00
14-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	18,39	3.100,00	57.017,29	18,30	18,40	18,55	16.270,00
14-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,51	6.900,00	31.144,79	4,46	4,53	4,63	55.455,00
14-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	24,47	1.400,00	34.257,19	24,11	24,47	24,88	20.019,00
14-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	32,84	400,00	13.137,17	32,41	32,77	33,04	63.424,00
14-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	17,33	9.000,00	155.929,45	16,86	17,29	17,49	40.656,00
14-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	LWSA3	6,27	2.000,00	12.531,19	6,08	6,20	6,49	22.395,00
14-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	16,62	1.900,00	31.580,03	16,21	16,71	17,66	39.400,00
14-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ONCO3	11,43	1.300,00	14.859,00	11,16	11,50	11,84	11.526,00
14-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	PETRA	35,32	400,00	14.129,22	34,84	35,31	35,74	82.572,00
14-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	4,58	1.900,00	8.702,00	4,19	4,42	4,73	19.062,00
14-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	4,56	5.800,00	26.444,03	4,19	4,42	4,73	19.062,00
14-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	46,94	1.800,00	84.491,85	45,97	46,86	47,40	40.971,00
14-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	23,15	5.800,00	134.250,00	22,42	23,09	23,59	33.417,00
14-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	21,10	3.100,00	65.401,67	20,55	21,03	21,44	19.841,00
14-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	65,11	8.000,00	520.865,72	63,00	65,03	65,84	55.031,00
14-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	SBS3	71,06	500,00	35.528,35	70,60	71,34	72,62	13.330,00
14-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	25,67	2.000,00	51.341,93	25,13	25,76	26,51	18.688,00
14-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	7,21	3.700,00	26.664,78	6,96	7,11	7,33	21.802,00
14-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	52,18	2.800,00	146.098,86	51,66	52,27	52,60	22.391,00
14-12-23	FIA RVA EMB IV	Compra	CPL6	9,95	15.436,00	153.621,49	9,86	9,95	10,08	50.631,00
14-12-23	FIA RVA EMB IV	Compra	CPL6	9,96	6.352,00	63.265,92	9,86	9,95	10,08	50.631,00
14-12-23	FIA RVA EMB IV	Compra	EQTL3	34,36	4.552,00	156.426,69	33,72	34,38	35,21	36.959,00
14-12-23	FIA RVA EMB IV	Compra	EQTL3	34,41	2.938,00	101.096,10	33,72	34,38	35,21	36.959,00
14-12-23	FIA RVA EMB IV	Compra	EQTL3	33,83	14.880,00	503.435,87	33,72	34,38	35,21	36.959,00
14-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	ITUB4	32,87	3.174,00	104.329,38	32,41	32,77	33,04	63.424,00
14-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	ITUB4	32,70	3.174,00	103.796,86	32,41	32,77	33,04	63.424,00
14-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	ITUB4	32,76	10.090,00	330.512,96	32,41	32,77	33,04	63.424,00
14-12-23	FIA RVA EMB IV	Compra	PRI03	46,79	3.541,00	165.672,86	45,97	46,86	47,40	40.971,00
14-12-23	FIA RVA EMB IV	Compra	PRI03	46,79	7.902,00	369.763,48	45,97	46,86	47,40	40.971,00
14-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	RENT3	65,30	4.355,00	284.377,72	63,00	65,03	65,84	55.031,00
14-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	RENT3	65,09	1.361,00	88.587,49	63,00	65,03	65,84	55.031,00
14-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	RENT3	65,20	1.361,00	88.737,20	63,00	65,03	65,84	55.031,00
14-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	RENT3	64,97	1.987,00	129.095,98	63,00	65,03	65,84	55.031,00
14-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	RENT3	64,95	816,00	52.999,20	63,00	65,03	65,84	55.031,00
14-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	21,58	3.096,00	66.808,62	21,37	21,73	22,28	44.084,00
14-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	21,54	2.600,00	56.004,62	21,37	21,73	22,28	44.084,00
14-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	21,70	4.623,00	100.304,82	21,37	21,73	22,28	44.084,00
14-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	21,58	3.550,00	76.607,76	21,37	21,73	22,28	44.084,00
15-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	ABEV3	14,45	5.300,00	76.585,00	14,39	14,46	14,57	70.400,00
15-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	ARZZ3	65,43	100,00	6.543,00	65,36	66,28	69,03	10.994,00
15-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	AZUL4	16,14	400,00	6.455,00	15,90	16,41	17,07	21.633,00
15-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	B3SA3	14,57	7.000,00	101.994,00	14,50	14,69	14,95	39.453,00
15-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	BBAS3	54,06	1.700,00	91.908,00	52,82	54,18	54,61	34.465,00
15-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	BBDC4	17,41	6.300,00	109.661,00	17,23	17,39	17,51	96.524,00
15-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	BBSE3	32,12	900,00	28.911,00	31,64	32,02	32,24	19.214,00
15-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	BPAC11	36,27	1.400,00	50.782,00	35,88	36,50	37,24	18.816,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2023

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE DEZEMBRO DE 2023 À 29 DE DEZEMBRO 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
15-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	BRFS3	13,58	2.100,00	28.525,00	13,55	13,64	13,90	13.388,00
15-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	CIEL3	4,55	1.400,00	6.370,00	4,43	4,52	4,57	26.325,00
15-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	CMIG4	11,43	1.800,00	20.582,00	11,35	11,46	11,75	34.426,00
15-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	CPFE3	37,83	200,00	7.565,00	37,00	37,81	38,19	9.637,00
15-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	CPLE6	9,82	2.100,00	20.622,00	9,75	9,87	10,07	20.162,00
15-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	CRFB3	11,68	700,00	8.177,00	11,53	11,67	12,03	18.382,00
15-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	CSAN3	18,59	1.500,00	27.892,00	18,42	18,64	19,02	15.161,00
15-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	CVCB3	3,72	600,00	2.232,00	3,69	3,78	3,91	10.826,00
15-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	CXSE3	12,03	45.000,00	541.379,00	11,98	12,01	12,09	6.902,00
15-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	ELET3	40,94	2.400,00	98.245,00	40,62	40,91	41,95	20.648,00
15-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	ELET6	45,45	300,00	13.634,00	45,18	45,37	46,52	6.111,00
15-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	ENEV3	13,29	2.000,00	26.576,00	13,20	13,27	13,64	12.794,00
15-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	ENGI11	50,44	300,00	15.132,00	50,22	50,61	51,94	17.544,00
15-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	EQTL3	34,11	1.300,00	44.347,00	34,03	34,27	34,78	20.375,00
15-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	GOAU4	10,63	900,00	9.567,00	10,47	10,56	10,75	14.587,00
15-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	HAPV3	4,48	5.300,00	23.767,00	4,38	4,47	4,64	49.657,00
15-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	ITSA4	10,09	6.700,00	67.602,00	9,98	10,11	10,19	44.216,00
15-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	ITUB4	32,74	5.900,00	193.177,00	32,30	32,72	33,04	36.938,00
15-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	JBSS3	23,58	1.400,00	33.014,00	23,46	23,68	24,23	18.965,00
15-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	KLBN11	21,90	900,00	19.712,00	21,56	21,81	22,16	12.680,00
15-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	LREN3	17,21	1.200,00	20.652,00	16,98	17,40	17,96	28.222,00
15-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	MRF3	9,37	400,00	3.748,00	9,16	9,26	9,69	21.799,00
15-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	MULT3	28,62	400,00	11.446,00	28,52	28,73	29,96	11.331,00
15-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	PETR3	37,10	3.100,00	114.997,00	36,89	37,25	37,98	15.536,00
15-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	PETRA	35,30	5.500,00	194.139,00	35,00	35,37	35,79	61.223,00
15-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	PRI03	46,81	900,00	42.127,00	46,12	47,39	47,85	23.529,00
15-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	RADL3	29,43	1.600,00	47.093,00	29,12	29,53	29,79	18.734,00
15-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	RAIL3	22,92	1.500,00	34.386,00	22,82	23,09	23,43	19.400,00
15-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	RDOR3	28,43	1.500,00	42.643,00	27,80	28,29	29,00	14.481,00
15-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	RENT3	64,63	1.000,00	64.632,00	64,00	64,53	66,10	22.067,00
15-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	SBS3	71,46	400,00	28.585,00	70,77	71,24	72,28	10.969,00
15-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	SUZB3	53,26	800,00	42.605,00	52,31	52,84	53,46	17.839,00
15-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	TIMS3	18,02	1.000,00	18.015,00	17,93	18,12	18,51	16.278,00
15-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	TOTS3	34,26	600,00	20.555,00	33,40	34,15	34,75	11.209,00
15-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	73,75	5.400,00	398.239,00	73,51	73,84	74,30	34.398,00
15-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	VBRR3	21,79	1.400,00	30.504,00	21,52	21,82	22,20	23.632,00
15-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	WEGE3	36,58	1.800,00	65.852,00	36,03	36,36	36,77	18.130,00
15-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	YDUO3	22,57	400,00	9.026,00	22,32	22,63	23,12	11.933,00
15-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	26,58	500,00	13.288,11	26,42	26,69	26,98	10.613,00
15-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	54,05	300,00	16.214,13	52,82	54,18	54,61	34.465,00
15-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	32,08	700,00	22.458,09	31,64	32,02	32,24	19.214,00
15-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	36,36	400,00	14.542,31	35,88	36,50	37,24	18.816,00
15-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	40,88	1.100,00	44.964,11	40,62	40,91	41,95	20.648,00
15-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	13,27	10.000,00	132.746,36	13,20	13,27	13,64	12.794,00
15-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	34,17	1.500,00	51.260,00	34,03	34,27	34,78	20.375,00
15-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	18,57	5.700,00	105.851,01	18,30	18,66	18,96	12.467,00
15-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	24,45	5.300,00	129.607,67	24,25	24,61	24,87	12.599,00
15-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	32,70	3.900,00	127.537,71	32,30	32,72	33,04	36.938,00
15-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	LREN3	17,25	700,00	12.072,56	16,98	17,40	17,96	28.222,00
15-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ONCO3	11,75	5.900,00	69.335,93	11,54	11,70	11,92	5.577,00
15-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	PETRA	35,36	600,00	21.216,99	35,00	35,37	35,79	61.223,00
15-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	46,98	3.700,00	173.819,41	46,12	47,39	47,85	23.529,00
15-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	47,70	1.800,00	85.860,00	46,12	47,39	47,85	23.529,00
15-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,97	1.700,00	39.051,05	22,82	23,09	23,43	19.400,00
15-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	20,93	200,00	4.185,46	20,27	20,54	21,45	10.355,00
15-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	64,49	700,00	45.143,09	64,00	64,53	66,10	22.067,00
15-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	SBS3	71,25	200,00	14.249,21	70,77	71,24	72,28	10.969,00
15-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	25,27	500,00	12.634,32	25,12	25,37	25,87	6.996,00
15-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	6,84	3.100,00	21.212,00	6,72	6,82	7,14	17.771,00
15-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	53,11	800,00	42.485,62	52,31	52,84	53,46	17.839,00
15-12-23	FIA RVA EMB IV	Compra	CPLE6	9,84	66.006,00	649.542,57	9,75	9,87	10,07	20.162,00
15-12-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	50,75	1.257,00	63.790,40	50,22	50,61	51,94	17.544,00
15-12-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	50,50	29.938,00	1.511.732,87	50,22	50,61	51,94	17.544,00
15-12-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GGPS3	19,12	35.058,00	670.308,96	18,97	19,11	19,24	5.203,00
15-12-23	FIA RVA EMB IV	Compra	PRI03	46,81	24.100,00	1.128.092,00	46,12	47,39	47,85	23.529,00
15-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	22,99	2.644,00	60.791,63	22,82	23,09	23,43	19.400,00
15-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	23,00	5.649,00	129.927,00	22,82	23,09	23,43	19.400,00
15-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	23,00	5.649,00	129.927,00	22,82	23,09	23,43	19.400,00
15-12-23	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	25,58	19.780,00	505.877,75	25,27	25,59	26,28	15.709,00
15-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	21,82	58.400,00	1.274.392,00	21,52	21,82	22,20	23.632,00
18-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	KLBN11	20,94	27.600,00	577.967,93	20,75	21,01	21,32	15.481,00
18-12-23	FIA RVA EMB II	Compra	VALE3	74,68	6.300,00	470.496,00	73,71	74,44	74,93	43.181,00
18-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	41,26	3.100,00	127.892,02	40,75	41,31	41,73	26.257,00
18-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	18,01	3.400,00	61.235,77	17,78	18,01	18,48	11.306,00
18-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	13,35	1.164,00	15.542,48	13,35	13,42	13,60	7.481,00
18-12-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	51,40	183,00	9.407,02	50,21	50,94	51,61	21.272,00
18-12-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	51,38	1.065,00	54.719,70	50,21	50,94	51,61	21.272,00
18-12-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	50,67	2.954,00	149.679,60	50,21	50,94	51,61	21.272,00
18-12-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	51,39	91,00	4.676,49	50,21	50,94	51,61	21.272,00
18-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	22,60	35.966,00	812.820,31	22,12	22,42	22,93	28.596,00
18-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	22,39	4.070,00	91.119,08	22,12	22,42	22,93	28.596,00
18-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	22,21	1.464,00	32.515,44	22,12	22,42	22,93	28.596,00
18-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	21,87	9.858,00	215.593,85	21,74	21,93	22,19	18.290,00
19-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	ABEV3	14,70	108.300,00	1.592.010,00	14,55	14,69	14,78	68.893,00
19-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	ARZZ3	66,47	11.100,00	737.817,00	65,90	66,56	67,19	7.845,00
19-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	B3SA3	14,55	120.900,00	1.759.095,00	14,52	14,64	14,91	35.668,00
19-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	BBAS3	54,85	34.900,00	1.914.265,00	54,30	54,67	54,92	22.342,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2023

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE DEZEMBRO DE 2023 À 29 DE DEZEMBRO 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
19-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	B8DC4	17,55	105.100,00	1.844.505,00	17,39	17,56	17,74	62.786,00
19-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	BPAC11	37,02	28.200,00	1.044.103,00	36,68	37,05	37,48	15.623,00
19-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	BRFS3	14,24	18.200,00	259.168,00	13,75	14,06	14,24	23.803,00
19-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	CIEL3	4,55	27.000,00	122.850,00	4,52	4,58	4,64	17.015,00
19-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	CMIG4	11,69	20.900,00	244.321,00	11,50	11,60	11,69	42.932,00
19-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	CPFE3	38,55	10.100,00	389.351,00	38,07	38,46	38,71	5.974,00
19-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	CPL66	10,03	71.800,00	720.154,00	9,90	10,00	10,09	20.224,00
19-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	CRFB3	12,03	34.900,00	419.681,00	11,77	12,01	12,15	16.279,00
19-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	CVCB3	3,90	11.000,00	42.900,00	3,82	3,88	3,96	8.376,00
19-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	ELET3	41,90	35.500,00	1.487.450,00	41,34	41,70	41,91	18.425,00
19-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	ELET6	46,52	14.800,00	688.491,00	45,88	46,33	46,66	5.783,00
19-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	ENEV3	13,53	38.900,00	526.317,00	13,33	13,49	13,62	16.208,00
19-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	EQTL3	34,78	40.000,00	1.391.140,00	34,48	34,77	35,05	21.556,00
19-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	GOAUI4	10,62	16.300,00	173.106,00	10,54	10,60	10,75	22.519,00
19-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	HAPV3	4,46	106.500,00	474.990,00	4,40	4,48	4,68	42.175,00
19-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	ITSA4	10,12	134.500,00	1.361.140,00	10,05	10,11	10,18	26.133,00
19-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	ITUB4	32,93	141.000,00	4.642.547,00	32,83	33,03	33,35	31.829,00
19-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	JBSS3	24,22	35.700,00	864.654,00	23,63	23,98	24,22	14.775,00
19-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	KLBN11	21,28	21.200,00	451.136,00	21,04	21,28	21,45	13.813,00
19-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	LREN3	17,34	70.700,00	1.225.938,00	17,25	17,32	17,51	24.111,00
19-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	MULT3	28,81	6.600,00	190.146,00	28,55	28,74	28,99	10.059,00
19-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	ONCO3	11,86	28.700,00	340.435,00	11,67	11,82	11,97	3.899,00
19-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	PETR3	38,04	49.500,00	1.882.980,00	37,52	37,88	38,09	20.034,00
19-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	PETRA	36,25	112.500,00	4.078.125,00	35,81	36,07	36,25	45.863,00
19-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	PRIO3	46,77	13.200,00	617.355,00	46,12	46,64	46,96	13.608,00
19-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	RADL3	29,33	31.100,00	912.163,00	29,03	29,35	29,60	15.886,00
19-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	RAIL3	22,40	30.000,00	672.000,00	21,95	22,34	22,63	24.145,00
19-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	RENT3	64,55	30.400,00	1.962.287,00	64,29	64,59	65,08	20.381,00
19-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	SBSPP3	72,73	10.900,00	792.798,00	71,92	72,80	73,60	11.534,00
19-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	SUZB3	52,97	16.700,00	884.599,00	52,56	53,04	53,43	18.825,00
19-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	TIMS3	18,16	19.900,00	361.384,00	18,06	18,19	18,40	12.947,00
19-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	TOTS3	34,45	12.700,00	437.515,00	33,64	34,14	34,45	11.501,00
19-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	74,82	129.400,00	9.681.194,00	74,37	74,77	75,09	79.886,00
19-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	VBBR3	21,79	52.800,00	1.150.534,00	21,48	21,81	22,10	21.255,00
19-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	WEGE3	36,42	15.200,00	553.584,00	36,05	36,37	36,62	14.995,00
19-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	YDUQ3	22,82	27.300,00	622.893,00	22,75	22,98	23,39	15.770,00
19-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	26,26	300,00	7.876,52	26,11	26,39	26,95	16.123,00
19-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	24,40	300,00	7.320,38	24,35	24,46	24,70	10.262,00
19-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	33,01	5.600,00	184.874,83	32,83	33,03	33,35	31.829,00
19-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,01	700,00	15.407,00	21,95	22,34	22,63	24.145,00
19-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	13,33	1.742,00	23.220,86	13,29	13,35	13,45	7.642,00
19-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	13,33	1.587,00	21.154,71	13,29	13,35	13,45	7.642,00
19-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	13,35	534,00	7.128,90	13,29	13,35	13,45	7.642,00
19-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	13,34	1.800,00	24.012,00	13,29	13,35	13,45	7.642,00
19-12-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	51,97	5,00	259,85	51,32	51,94	52,16	7.727,00
19-12-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	51,98	125,00	6.497,50	51,32	51,94	52,16	7.727,00
19-12-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	52,08	104,00	5.416,32	51,32	51,94	52,16	7.727,00
19-12-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	52,09	1.990,00	103.659,10	51,32	51,94	52,16	7.727,00
19-12-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	52,06	1,00	52,06	51,32	51,94	52,16	7.727,00
19-12-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	52,15	1.360,00	70.924,00	51,32	51,94	52,16	7.727,00
19-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	EQTL3	34,73	423,00	14.690,79	34,48	34,77	35,05	21.556,00
19-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	EQTL3	34,71	364,00	12.634,44	34,48	34,77	35,05	21.556,00
19-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	EQTL3	34,80	365,00	12.702,00	34,48	34,77	35,05	21.556,00
19-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	EQTL3	34,72	640,00	22.220,80	34,48	34,77	35,05	21.556,00
19-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	EQTL3	34,70	2,00	69,40	34,48	34,77	35,05	21.556,00
19-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	EQTL3	34,76	501,00	17.414,76	34,48	34,77	35,05	21.556,00
19-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	EQTL3	34,78	4.400,00	153.032,00	34,48	34,77	35,05	21.556,00
19-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	EQTL3	34,76	125,00	4.345,00	34,48	34,77	35,05	21.556,00
19-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	EQTL3	34,77	22,00	764,94	34,48	34,77	35,05	21.556,00
19-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	EQTL3	34,75	508,00	17.653,00	34,48	34,77	35,05	21.556,00
19-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	EQTL3	34,74	193,00	6.704,82	34,48	34,77	35,05	21.556,00
19-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	22,41	801,00	17.950,41	21,95	22,34	22,63	24.145,00
19-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	22,40	26.846,00	601.350,40	21,95	22,34	22,63	24.145,00
19-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	22,43	557,00	12.493,51	21,95	22,34	22,63	24.145,00
19-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	22,42	1.022,00	22.913,24	21,95	22,34	22,63	24.145,00
19-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	21,82	58,00	1.265,56	21,48	21,81	22,10	21.255,00
19-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	21,80	1.346,00	29.342,80	21,48	21,81	22,10	21.255,00
19-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	21,81	1,00	21,81	21,48	21,81	22,10	21.255,00
19-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	21,82	962,00	20.990,84	21,48	21,81	22,10	21.255,00
19-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	21,60	1.349,00	29.138,40	21,48	21,81	22,10	21.255,00
19-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	21,81	11,00	239,91	21,48	21,81	22,10	21.255,00
19-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	21,84	1.114,00	24.329,76	21,48	21,81	22,10	21.255,00
19-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	21,83	388,00	8.470,04	21,48	21,81	22,10	21.255,00
19-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	21,85	30,00	655,50	21,48	21,81	22,10	21.255,00
19-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	21,83	1.603,00	34.993,49	21,48	21,81	22,10	21.255,00
19-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	21,83	300,00	6.549,00	21,48	21,81	22,10	21.255,00
19-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	21,82	2.671,00	58.281,22	21,48	21,81	22,10	21.255,00
20-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	26,11	1.800,00	46.993,04	25,68	26,02	26,40	15.205,00
20-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	4,61	23.300,00	107.307,06	4,56	4,60	4,67	21.897,00
20-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	41,15	2.800,00	115.233,12	40,90	41,41	42,20	28.604,00
20-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	13,57	1.600,00	21.712,00	13,42	13,53	13,64	11.294,00
20-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENJU3	1,86	3.800,00	7.053,62	1,60	1,71	1,87	2.438,00
20-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	35,39	4.400,00	155.732,50	34,56	35,22	35,80	28.470,00
20-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	18,14	900,00	16.326,00	18,06	18,18	18,51	10.754,00
20-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	18,14	2.200,00	39.911,67	18,06	18,18	18,51	10.754,00
20-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	18,17	600,00	10.899,80	18,06	18,18	18,51	10.754,00
20-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,26	17.000,00	72.492,05	4,14	4,29	4,44	63.243,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2023

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE DEZEMBRO DE 2023 À 29 DE DEZEMBRO 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
20-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	24,21	1.800,00	43.580,15	23,79	24,14	24,58	12.994,00
20-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	22,68	41.013,00	930.326,13	22,29	22,62	22,83	15.431,00
21-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	4,59	7.700,00	35.363,00	4,55	4,59	4,65	9.971,00
21-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	41,30	1.000,00	41.296,25	41,07	41,43	41,66	19.475,00
21-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	35,41	1.200,00	42.490,33	34,98	35,34	35,77	20.544,00
21-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	12,19	6.300,00	76.797,00	11,85	12,20	12,40	9.800,00
21-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	12,21	200,00	2.442,98	11,85	12,20	12,40	9.800,00
21-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	7,33	12.400,00	90.871,15	6,98	7,24	7,43	23.420,00
21-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	7,25	9.000,00	65.250,00	6,98	7,24	7,43	23.420,00
21-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	EQLT3	35,55	9.084,00	322.936,20	34,98	35,34	35,77	20.544,00
21-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	EQLT3	35,40	3.028,00	107.191,20	34,98	35,34	35,77	20.544,00
21-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	EQLT3	35,14	8.151,00	286.402,75	34,98	35,34	35,77	20.544,00
22-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	ABEV3	13,71	27.300,00	374.180,00	13,66	13,75	13,83	23.886,00
22-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	B3SA3	14,45	35.400,00	511.558,00	14,38	14,49	14,65	29.857,00
22-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	BBAS3	54,31	8.800,00	477.895,00	54,07	54,38	54,62	17.478,00
22-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	BBDC4	16,68	32.000,00	533.722,00	16,54	16,75	16,92	37.697,00
22-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	BPAC11	36,44	7.200,00	262.386,00	36,18	36,64	36,88	18.315,00
22-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	BRFS3	13,72	27.300,00	374.630,00	13,49	13,75	14,06	16.646,00
22-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	CPFE3	38,54	1.200,00	46.249,00	38,38	38,63	38,88	5.615,00
22-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	CPL66	10,12	10.500,00	106.247,00	10,06	10,15	10,21	11.095,00
22-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	CRFB3	12,47	13.000,00	162.096,00	12,28	12,36	12,61	11.018,00
22-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	CSAN3	19,10	7.300,00	139.457,00	18,96	19,16	19,30	19.880,00
22-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	CURY3	17,63	8.400,00	148.054,00	17,49	17,63	17,78	3.818,00
22-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	CXSE3	12,63	12.600,00	159.120,00	12,52	12,61	12,70	5.458,00
22-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	DIRR3	21,26	5.200,00	110.532,00	21,13	21,49	21,65	4.878,00
22-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	ECOR3	9,70	20.400,00	197.837,00	9,63	9,70	9,82	5.606,00
22-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	ELET3	41,56	12.300,00	511.170,00	41,29	41,93	42,34	17.414,00
22-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	ELET6	46,46	1.600,00	74.331,00	46,24	46,86	47,30	3.937,00
22-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	ENEV3	13,48	9.800,00	132.064,00	13,42	13,62	13,72	10.072,00
22-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	EQLT3	35,30	6.800,00	240.021,00	34,71	35,14	35,65	17.786,00
22-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	HAPV3	4,29	94.300,00	404.363,00	4,25	4,28	4,35	57.541,00
22-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	ITSA4	10,13	33.900,00	343.289,00	10,10	10,25	10,35	23.936,00
22-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	ITUB4	32,93	29.800,00	981.426,00	32,80	33,24	33,54	44.474,00
22-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	JBSS3	24,76	7.100,00	175.814,00	24,63	24,86	25,03	11.127,00
22-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	LREN3	17,45	28.300,00	493.944,00	17,11	17,55	17,71	20.280,00
22-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	MULT3	28,93	4.900,00	141.747,00	28,55	28,75	29,12	13.196,00
22-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	ONCO3	12,28	16.100,00	197.702,00	12,14	12,31	12,59	7.530,00
22-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	PETR3	38,26	9.300,00	355.831,00	38,11	38,44	38,62	16.211,00
22-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	PETRA	36,53	24.500,00	894.983,00	36,37	36,63	36,80	42.995,00
22-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	PRI03	45,44	4.900,00	222.679,00	45,11	45,46	45,74	19.798,00
22-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	RADL3	28,97	7.900,00	228.896,00	28,80	28,95	29,23	14.084,00
22-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	RAIL3	22,81	7.600,00	173.365,00	22,76	22,86	22,97	11.632,00
22-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	RENT3	64,27	5.200,00	334.207,00	63,95	64,58	65,18	18.998,00
22-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	SBS3	74,90	2.100,00	157.296,00	73,94	74,91	75,62	13.102,00
22-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	SUZB3	54,64	4.200,00	229.488,00	54,35	55,03	55,44	15.378,00
22-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	TIIMS3	17,63	5.100,00	89.938,00	17,60	17,78	17,89	10.658,00
22-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	TOTS3	33,25	3.200,00	106.403,00	32,78	32,96	33,65	9.874,00
22-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	76,77	27.400,00	2.103.581,00	76,29	76,96	78,20	49.671,00
22-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	VBBR3	22,22	7.000,00	155.544,00	22,03	22,34	22,52	28.161,00
22-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	WEGE3	36,23	9.200,00	333.310,00	36,17	36,38	36,55	13.382,00
22-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	YDUQ3	22,28	24.000,00	534.735,00	22,18	22,44	22,94	11.159,00
22-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	YDUQ3	22,74	2.100,00	47.750,00	22,18	22,44	22,94	11.159,00
22-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	26,40	600,00	15.837,00	26,16	26,40	26,68	19.688,00
22-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	54,31	300,00	16.292,00	54,07	54,38	54,62	17.478,00
22-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	33,28	600,00	19.969,89	33,12	33,31	33,47	9.757,00
22-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	36,67	400,00	14.666,00	36,18	36,64	36,88	18.315,00
22-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	CIEL3	4,59	4.500,00	20.648,07	4,56	4,59	4,64	13.489,00
22-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	42,11	1.100,00	46.320,15	41,29	41,93	42,34	17.414,00
22-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENAT3	17,99	2.200,00	39.570,18	16,69	17,77	18,45	16.924,00
22-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	13,66	2.300,00	31.422,07	13,42	13,62	13,72	10.072,00
22-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	35,29	1.500,00	52.930,11	34,71	35,14	35,65	17.786,00
22-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,28	2.900,00	12.415,00	4,25	4,28	4,35	57.541,00
22-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,28	52.600,00	225.271,80	4,25	4,28	4,35	57.541,00
22-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	24,13	2.200,00	53.095,62	23,95	24,11	24,35	11.930,00
22-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	33,23	8.000,00	265.873,95	32,80	33,24	33,54	44.474,00
22-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	LREN3	17,59	800,00	14.069,00	17,11	17,55	17,71	20.280,00
22-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	16,31	3.100,00	50.549,00	16,16	16,33	16,69	16.758,00
22-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	16,30	4.700,00	76.626,88	16,16	16,33	16,69	16.758,00
22-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	16,29	800,00	13.029,00	16,16	16,33	16,69	16.758,00
22-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	45,52	2.600,00	118.345,65	45,11	45,46	45,74	19.798,00
22-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	45,52	1.200,00	54.618,27	45,11	45,46	45,74	19.798,00
22-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	45,50	700,00	31.848,50	45,11	45,46	45,74	19.798,00
22-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,87	1.900,00	43.459,10	22,76	22,86	22,97	11.632,00
22-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	21,47	1.900,00	40.797,44	21,28	21,46	21,66	9.122,00
22-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	21,44	2.100,00	45.031,30	21,28	21,46	21,66	9.122,00
22-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	64,46	600,00	38.674,29	63,95	64,58	65,18	18.998,00
22-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	25,53	3.000,00	76.585,23	25,14	25,53	25,73	6.151,00
22-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	7,46	5.000,00	37.279,84	7,20	7,43	7,54	25.863,00
22-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	7,50	3.000,00	22.500,00	7,20	7,43	7,54	25.863,00
22-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	55,01	600,00	33.007,19	54,35	55,03	55,44	15.378,00
22-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	EQLT3	35,14	10.733,00	377.208,80	34,71	35,14	35,65	17.786,00
22-12-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	6,92	77.800,00	538.162,00	6,84	6,91	7,08	7.241,00
22-12-23	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	26,28	20.700,00	544.079,00	26,03	26,27	26,50	18.249,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	ABEV3	13,77	113.000,00	1.556.010,00	13,69	13,76	13,81	10.454,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	ARZZ3	66,40	1.300,00	86.320,00	65,71	66,32	67,20	7.859,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	AZUL4	16,26	12.500,00	203.250,00	16,10	16,19	16,36	9.858,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	B3SA3	14,66	100.600,00	1.474.796,00	14,52	14,67	14,74	18.253,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2023

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

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



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBVBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	BBAS3	54,94	20.000,00	1.098.800,00	54,30	54,71	54,96	12.200,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	BBDC4	16,88	85.900,00	1.449.992,00	16,80	16,87	16,93	17.467,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	BBSE3	33,61	13.400,00	450.374,00	33,32	33,53	33,62	6.344,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	BPAC11	37,11	34.200,00	1.269.213,00	36,60	37,17	37,37	11.249,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	BRFS3	13,81	37.100,00	512.252,00	13,68	13,79	13,99	8.851,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	CIEL3	4,68	139.200,00	651.795,00	4,58	4,67	4,72	18.625,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	CMIG4	11,22	45.200,00	507.137,00	11,03	11,19	11,27	12.965,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	CPFE3	38,53	14.300,00	550.918,00	38,34	38,62	38,96	4.202,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	CPL6	10,30	50.500,00	520.150,00	10,15	10,33	10,41	14.975,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	CRFB3	12,27	34.000,00	417.180,00	12,13	12,22	12,35	9.420,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	CSAN3	19,25	25.800,00	496.650,00	19,07	19,25	19,41	16.597,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	CURY3	17,69	26.500,00	468.872,00	17,56	17,67	17,82	4.857,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	CVCB3	3,98	65.500,00	260.690,00	3,91	3,97	4,02	5.289,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	CXSE3	12,70	36.000,00	457.180,00	12,60	12,69	12,78	3.783,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	DIRR3	21,52	16.900,00	363.688,00	21,29	21,42	21,72	5.539,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	ECOR3	9,66	47.900,00	462.714,00	9,61	9,67	9,81	4.936,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	ELET3	42,09	19.900,00	837.591,00	41,92	42,08	42,25	10.464,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	ELET6	47,00	15.200,00	714.400,00	46,92	47,10	47,39	3.164,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	ENEV3	13,58	34.900,00	473.942,00	13,57	13,63	13,74	6.763,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	ENGI11	52,95	1.800,00	95.310,00	52,27	52,81	53,07	8.371,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	EQLT3	35,21	36.300,00	1.278.123,00	35,01	35,24	35,46	10.264,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	GMAT3	6,97	36.800,00	256.434,00	6,80	7,01	7,20	7.513,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	GOAU4	10,81	53.200,00	575.092,00	10,73	10,77	10,84	7.617,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	HAPV3	4,31	95.700,00	412.467,00	4,31	4,35	4,42	24.576,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	ITSA4	10,28	84.000,00	863.520,00	10,19	10,24	10,29	15.098,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	ITUB4	33,66	112.900,00	3.800.093,00	33,23	33,58	33,78	31.346,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	JBSS3	25,00	31.700,00	792.500,00	24,85	24,97	25,08	7.388,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	LEN3	17,49	39.600,00	692.454,00	17,33	17,48	17,75	15.983,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	MRF3	9,78	6.500,00	63.570,00	9,71	9,79	9,96	6.175,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	MULT3	28,48	9.400,00	267.712,00	28,32	28,51	28,87	10.506,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	ONCO3	12,55	37.000,00	464.533,00	12,39	12,48	12,64	3.884,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	PETR3	39,20	29.000,00	1.136.800,00	38,65	39,07	39,24	10.003,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	PETRA	37,33	86.600,00	3.232.778,00	36,83	37,17	37,37	36.804,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	PRI03	45,92	20.300,00	932.176,00	45,54	46,07	46,38	19.926,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	RADL3	29,42	38.900,00	1.144.438,00	28,86	29,31	29,62	8.814,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	RAIL3	22,91	22.400,00	513.184,00	22,69	22,85	23,02	10.260,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	RENT3	64,11	28.800,00	1.846.444,00	63,65	64,18	64,92	15.208,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	SFBG3	12,07	11.700,00	141.219,00	11,93	12,20	12,26	3.720,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	SBS3	74,15	10.300,00	763.745,00	73,88	74,39	75,60	5.807,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	SUZB3	55,22	15.100,00	833.822,00	54,81	55,28	56,02	9.775,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	TIMS3	17,85	17.900,00	319.515,00	17,71	17,83	18,01	8.275,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	TOTS3	33,53	11.300,00	378.889,00	32,90	33,24	33,53	5.942,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	76,66	96.100,00	7.367.026,00	76,66	77,08	77,45	28.488,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	VBBR3	22,20	31.900,00	708.260,00	21,98	22,24	22,42	16.081,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	WEGE3	36,72	20.000,00	734.400,00	36,45	36,66	36,92	8.849,00
26-12-23	FIA RVA EMB II	Venda	YDUQ3	22,40	18.100,00	405.440,00	22,17	22,40	22,55	5.318,00
26-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	26,58	700,00	18.603,56	26,34	26,59	26,80	12.606,00
26-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	AURE3	13,32	1.100,00	14.648,96	13,26	13,31	13,38	8.642,00
26-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	54,75	300,00	16.425,90	54,30	54,71	54,96	12.200,00
26-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	33,57	800,00	26.853,82	33,32	33,53	33,62	6.344,00
26-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	37,07	600,00	22.243,98	36,60	37,17	37,37	11.249,00
26-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	CIEL3	4,69	2.700,00	12.673,88	4,58	4,67	4,72	18.625,00
26-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	42,06	1.400,00	58.887,03	41,92	42,08	42,25	10.464,00
26-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENAT3	19,97	1.500,00	29.959,46	19,40	20,07	20,47	20.517,00
26-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENAT3	20,20	6.600,00	133.344,90	19,40	20,07	20,47	20.517,00
26-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	13,65	2.800,00	38.227,28	13,57	13,74	13,74	6.763,00
26-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	35,18	1.900,00	66.839,95	35,01	35,24	35,46	10.264,00
26-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	18,50	1.100,00	20.352,00	18,35	18,48	18,65	7.269,00
26-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	24,39	2.400,00	58.530,58	24,09	24,35	24,53	9.724,00
26-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	33,51	1.600,00	53.620,82	33,23	33,58	33,78	31.346,00
26-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	LEN3	17,48	800,00	13.983,20	17,33	17,48	17,75	15.983,00
26-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ONCO3	12,51	1.300,00	16.269,00	12,39	12,48	12,64	3.884,00
26-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	46,18	600,00	27.709,03	45,54	46,07	46,38	19.926,00
26-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,88	2.300,00	52.622,43	22,69	22,85	23,02	10.260,00
26-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	22,03	1.300,00	28.641,07	21,44	21,96	22,15	7.196,00
26-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	64,11	600,00	38.465,33	63,65	64,18	64,92	15.208,00
26-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	SBS3	74,65	1.300,00	97.048,75	73,88	74,39	75,60	5.807,00
26-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	25,76	1.000,00	25.755,48	25,47	25,78	26,04	6.235,00
26-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	25,69	5.400,00	138.746,70	25,47	25,78	26,04	6.235,00
26-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	7,34	1.700,00	12.476,38	7,28	7,35	7,51	13.724,00
26-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	55,17	1.000,00	55.169,65	54,81	55,28	56,02	9.775,00
26-12-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	52,78	2.926,00	154.448,20	52,27	52,81	53,07	8.371,00
26-12-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	6,93	36.406,00	252.226,83	6,80	7,01	7,20	7.513,00
26-12-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	AIEC11	56,76	3.524,00	200.022,24	56,18	56,80	57,50	887,00
26-12-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	BMLC11	106,00	4.717,00	500.002,00	104,61	105,99	107,00	11,00
26-12-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	PATC11	39,11	25.568,00	1.000.017,56	39,02	39,11	39,49	241,00
26-12-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	XPIN11	82,90	12.063,00	1.000.022,70	82,75	82,89	82,98	881,00
27-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	4,77	4.000,00	19.094,34	4,66	4,75	4,81	12.441,00
27-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENAT3	20,23	4.400,00	89.031,78	19,73	20,22	20,64	7.677,00
27-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	10,34	78.000,00	806.409,27	10,23	10,33	10,40	14.340,00
27-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	10,33	31.900,00	329.566,89	10,23	10,33	10,40	14.340,00
27-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	33,81	9.700,00	327.935,40	33,57	33,82	33,95	21.988,00
27-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	33,82	23.900,00	808.314,51	33,57	33,82	33,95	21.988,00
27-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	33,83	3.400,00	115.013,99	33,57	33,82	33,95	21.988,00
27-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	MGLU3	2,15	139.600,00	299.687,19	2,09	2,17	2,27	20.766,00
27-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	12,79	300,00	3.837,00	12,41	12,67	12,79	3.637,00
27-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	46,28	700,00	32.394,35	45,68	46,23	46,70	17.500,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2023

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

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



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
27-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	21,97	1.500,00	32.949,95	21,76	21,97	22,28	6.095,00
27-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	26,00	3.400,00	88.395,66	25,75	26,01	26,18	5.927,00
27-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	26,03	900,00	23.423,47	25,75	26,01	26,18	5.927,00
27-12-23	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	53,63	1.324,00	71.010,77	52,67	53,61	53,94	7.647,00
28-12-23	FIA EMB VIII ETF	Compra	BOVA11	130,39	38.300,00	4.993.937,00	129,86	130,27	130,52	38.232,00
28-12-23	FIA EMB VIII ETF	Compra	BOVV11	136,60	36.600,00	4.999.560,00	136,19	136,46	136,75	1.692,00
28-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	55,14	300,00	16.541,00	54,69	55,13	55,39	11.071,00
28-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	33,53	500,00	16.767,00	33,34	33,56	33,65	8.319,00
28-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	42,40	800,00	33.920,00	42,22	42,41	42,69	11.726,00
28-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	ENAT3	20,25	1.200,00	24.305,32	19,65	20,16	20,43	6.861,00
28-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	13,53	1.800,00	24.354,00	13,47	13,55	13,64	14.199,00
28-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	35,61	1.200,00	42.729,00	35,42	35,67	35,79	10.835,00
28-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,44	15.700,00	69.719,28	4,34	4,43	4,49	28.774,00
28-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,45	3.600,00	16.014,00	4,34	4,43	4,49	28.774,00
28-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	24,37	1.000,00	24.368,00	24,24	24,36	24,54	8.751,00
28-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	10,32	55.200,00	569.664,00	10,30	10,35	10,40	23.983,00
28-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	33,77	16.200,00	547.076,58	33,74	33,87	33,97	22.510,00
28-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	MGLU3	2,17	52.000,00	112.986,74	2,15	2,18	2,23	22.956,00
28-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	16,89	5.500,00	92.912,51	16,69	16,93	17,17	21.349,00
28-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	12,89	1.600,00	20.620,25	12,75	12,91	13,00	7.703,00
28-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	12,85	10.000,00	128.476,40	12,75	12,91	13,00	7.703,00
28-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	12,89	5.500,00	70.895,00	12,75	12,91	13,00	7.703,00
28-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	45,66	500,00	22.831,00	45,32	45,70	46,05	15.635,00
28-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	45,60	400,00	18.238,92	45,32	45,70	46,05	15.635,00
28-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,87	1.400,00	32.015,00	22,78	22,90	23,05	11.425,00
28-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	21,49	700,00	15.040,00	21,24	21,51	21,80	10.996,00
28-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	63,57	500,00	31.783,00	63,21	63,56	63,90	12.938,00
28-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	SBSF3	74,90	1.300,00	97.371,09	74,46	75,07	75,37	5.845,00
28-12-23	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	25,88	1.800,00	46.592,22	25,62	25,95	26,26	10.422,00
28-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	7,39	1.800,00	13.299,00	7,28	7,41	7,57	17.345,00
28-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	7,39	16.100,00	118.961,98	7,28	7,41	7,57	17.345,00
28-12-23	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	55,72	700,00	39.004,00	55,42	55,70	55,94	10.385,00
28-12-23	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	7,20	33.971,00	244.610,11	6,98	7,16	7,23	8.296,00
28-12-23	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	22,87	21.285,00	486.847,85	22,78	22,90	23,05	11.425,00
28-12-23	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	22,57	11.050,00	249.351,11	22,32	22,63	22,81	15.979,00
28-12-23	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	TRFX11	111,07	3.601,00	399.953,41	110,78	111,07	112,00	7.149,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ABEV3	13,73	2.645,00	36.319,14	13,73	13,76	13,85	22.769,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ALOS3	26,56	321,00	8.524,24	26,40	26,61	26,91	16.929,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ALPA4	10,12	1.517,00	15.353,64	10,00	10,18	10,29	14.650,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ARZZ3	64,77	38,00	2.461,26	64,53	65,07	66,66	8.272,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ASAI3	13,53	790,00	10.691,46	13,41	13,52	13,58	11.217,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	AZUL4	16,03	197,00	3.158,73	15,92	16,10	16,63	11.313,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	B3SA3	14,55	1.249,00	18.172,75	14,45	14,54	14,67	26.252,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBAS3	55,39	855,00	47.357,02	54,69	55,13	55,39	11.071,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBDC3	15,28	904,00	13.813,62	15,21	15,28	15,36	5.078,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBDC4	17,09	3.097,00	52.928,09	16,95	17,06	17,13	15.499,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBSE3	33,65	404,00	13.595,89	33,34	33,56	33,65	8.319,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BEEF3	7,47	157,00	1.173,39	7,45	7,47	7,54	6.453,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BHIA3	11,38	76,00	864,91	11,25	11,38	11,61	5.047,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BPAC11	37,61	692,00	26.029,52	37,43	37,77	38,12	15.475,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRAP4	25,66	151,00	3.874,56	25,44	25,59	25,66	2.823,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRF53	13,81	1.010,00	13.948,70	13,72	13,83	13,99	8.919,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRKM5	21,86	180,00	3.934,73	21,54	21,76	21,89	5.584,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CCRO3	14,18	600,00	8.509,60	14,16	14,20	14,33	6.852,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CIEL3	4,69	659,00	3.090,88	4,65	4,72	4,79	17.057,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CMIG4	11,48	865,00	9.930,20	11,25	11,41	11,48	10.623,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CMIN3	7,83	668,00	5.231,36	7,71	7,83	7,95	8.650,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	COGN3	3,49	1.062,00	3.704,93	3,44	3,48	3,52	14.786,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CPFE3	38,52	113,00	4.352,56	38,14	38,31	38,51	4.718,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CPL6	10,36	1.011,00	10.473,96	10,31	10,34	10,42	12.486,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CRFB3	12,45	453,00	5.641,89	12,32	12,43	12,58	7.052,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CSAN3	19,37	703,00	13.614,88	19,36	19,43	19,64	10.698,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CSNA3	19,66	362,00	7.116,52	19,40	19,57	19,66	5.646,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CVCB3	3,50	4.430,00	15.505,92	3,47	3,61	4,02	29.813,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CYRE3	24,09	160,00	3.853,90	23,84	24,03	24,28	11.347,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	DXCO3	8,07	167,00	1.347,89	7,96	8,07	8,16	5.102,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	EGIE3	45,34	154,00	6.982,50	45,10	45,27	45,44	3.679,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ELET3	42,43	1.192,00	50.579,62	42,22	42,41	42,69	11.726,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ELET6	46,99	92,00	3.617,91	46,98	47,14	47,57	2.670,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	EMBR3	22,39	442,00	9.897,99	22,24	22,42	22,75	22.569,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ENEV3	13,61	960,00	13.068,12	13,47	13,55	13,64	14.199,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ENGI11	53,80	172,00	9.253,84	53,69	54,02	54,30	5.024,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	EQLT3	35,72	660,00	23.574,00	35,42	35,67	35,79	10.835,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	EZTC3	18,74	55,00	1.030,70	18,70	18,87	19,30	4.523,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	FLRY3	18,04	5.116,00	92.292,73	17,98	18,06	18,50	13.746,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	GGBR4	23,76	673,00	15.989,04	23,44	23,69	23,76	8.709,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	GDAU4	10,86	397,00	4.311,72	10,75	10,84	10,88	8.146,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	GOLL4	8,98	119,00	1.068,99	8,95	9,01	9,18	4.997,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	HAPV3	4,45	6.187,00	27.533,50	4,34	4,43	4,49	28.774,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	HYPE3	35,73	247,00	8.825,65	35,55	35,84	36,18	3.952,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	IGTI11	24,40	131,00	3.196,77	24,24	24,36	24,54	8.751,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	IRBR3	44,14	50,00	2.207,00	44,08	44,50	45,20	5.167,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ITSA4	10,37	4.196,00	43.510,82	10,30	10,35	10,40	23.983,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ITUB4	33,97	2.890,00	98.174,32	33,74	33,87	33,97	22.510,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	JBSS3	24,92	683,00	17.019,97	24,87	24,95	25,13	6.333,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	KIBN11	22,22	425,00	9.443,50	21,91	22,11	22,22	7.716,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	LREN3	17,44	573,00	9.990,66	17,30	17,43	17,66	22.668,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2023

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

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



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	LWSA3	6,01	1.374,00	8.256,98	5,92	6,01	6,28	13.285,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	MGLU3	2,16	1.726,00	3.728,64	2,15	2,18	2,23	22.956,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	MRFG3	9,70	2.175,00	21.097,54	9,60	9,69	9,80	7.989,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	MRVE3	11,23	227,00	2.548,28	11,06	11,30	11,58	18.574,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	MULT3	28,40	239,00	6.786,62	28,27	28,40	28,53	7.107,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	NTCO3	16,89	842,00	14.220,48	16,69	16,93	17,17	21.349,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PCAR3	4,07	96,00	390,84	4,05	4,10	4,18	9.143,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	PETR3	38,98	8.915,00	347.508,74	38,83	38,99	39,17	13.163,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PETR4	37,24	2.749,00	102.372,85	37,04	37,24	37,36	23.682,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	PETZ3	3,95	788,00	3.112,80	3,95	4,01	4,14	8.989,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PRI03	46,05	569,00	26.200,95	45,32	45,70	46,05	15.635,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RADL3	29,40	1.383,00	40.666,05	29,15	29,48	29,77	8.982,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RAIL3	22,95	734,00	16.845,22	22,78	22,90	23,05	11.425,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RAIZ4	4,03	687,00	2.768,95	3,96	4,03	4,07	8.321,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RDOR3	28,77	703,00	20.223,05	28,63	28,77	28,98	9.891,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RECV3	21,76	168,00	3.655,41	21,24	21,51	21,80	10.996,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RENT3	63,60	427,00	27.157,77	63,21	63,56	63,90	12.938,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RRRP3	26,31	142,00	3.736,20	26,04	26,20	26,49	10.325,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SANB11	32,28	206,00	6.650,23	31,95	32,18	32,30	4.074,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SBSP3	75,37	204,00	15.375,38	74,46	75,07	75,37	5.845,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	SLCE3	18,82	280,00	5.269,39	18,79	18,85	19,05	4.676,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SMTO3	29,10	40,00	1.164,00	28,92	29,25	29,48	4.356,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SOMA3	7,46	299,00	2.231,18	7,28	7,41	7,57	17.345,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SUZB3	55,64	412,00	22.923,61	55,42	55,70	55,94	10.385,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	TAE11	38,39	131,00	5.028,74	37,90	38,27	38,46	8.200,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	TIMS3	17,93	486,00	8.713,17	17,86	17,93	18,10	8.450,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	TOTS3	33,77	309,00	10.433,67	33,25	33,55	34,27	9.728,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	TRPL4	26,50	20.176,00	534.665,05	26,05	26,49	26,68	11.906,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	UGPA3	26,51	654,00	17.338,98	26,32	26,49	26,59	10.396,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	USIM5	9,29	310,00	2.879,83	9,20	9,25	9,32	12.012,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	VALE3	77,20	9.070,00	700.204,00	76,75	77,23	77,46	20.092,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VAMO3	10,10	254,00	2.564,53	9,82	10,06	10,22	19.896,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VBBR3	22,76	670,00	15.250,44	22,32	22,63	22,81	15.979,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VIVT3	53,43	255,00	13.624,96	53,35	53,55	54,00	5.284,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	WEGE3	36,93	892,00	32.937,98	36,71	36,97	37,22	8.807,00
28-12-23	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	YDUQ3	22,43	174,00	3.903,42	22,32	22,51	22,99	6.713,00

7. RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS

Para o acompanhamento da rentabilidade dos investimentos dos Planos que administra, a EMBRAER PREV adotará a variação do valor da cota do Plano, dos segmentos de aplicação e dos fundos de investimentos e/ou carteiras onde o(s) Plano(s) aplica(m) seus recursos. A periodicidade da avaliação será no mínimo, mensal, com foco no resultado do semestre e ano. A rentabilidade dos segmentos, fundos de investimentos e/ou carteiras deve ser monitorada e comparada com indicadores de mercado e índices de referência definidos na Política de Investimento dos respectivos Planos.

Mensalmente são disponibilizados no portal da Entidade, www.embraerprev.com.br, os seguintes relatórios:

- 7.1. **Composição da Carteira de Investimentos:** Indica a composição da carteira de investimento da EMBRAER PREV, por segmento de aplicação (Renda Fixa, Renda Variável ou outros), bem como todos os títulos, ações e outros investimentos que sejam realizados pela Entidade.
- 7.2. **Rentabilidade e Resultados dos Investimentos:** Apresenta os principais resultados da administração da EMBRAER PREV e do Plano Embraer Prev, tais como fatos relevantes, benefícios concedidos, inscrições de novos Participantes, estatísticas de atendimento, rentabilidade dos investimentos e evolução patrimonial.

8. GLOSSÁRIO

Administrador

Atividade profissional aprovada pelos órgãos governamentais competentes para a administração de fundos e carteiras de investimentos. Nessa atividade, o administrador realiza a contabilização de ativos e passivos e todas as demais atividades correlatas para o bom funcionamento de um fundo ou carteira de investimentos.

Carteira

Conjunto composto por títulos, ações e contratos. A título de exemplo, a carteira de investimentos da EMBRAER PREV compõe-se de todos os investimentos vinculados aos Planos que a Entidade administra.

Dados Gerais

Compõem-se dos indicadores de risco de mercado, considerando os parâmetros definidos para seu cálculo e a composição dos investimentos de cada carteira ou fundo, como por exemplo: *Var (Value at Risk)* sobre o PL (Patrimônio Líquido), *ETL (Expected Tail Loss)* sobre o PL (Patrimônio Líquido) e o *Var (Value at Risk)* sobre a variação do CDI.

Vide também glossário de *Value at Risk*, Patrimônio Líquido e *Expected Tail Loss*.

Duration

É o cálculo do prazo médio de vencimento de um título, fundo ou carteira, ajustado pelo fluxo de recebimento de juros e do valor principal, calculado pelo seu valor presente.

Vide também glossário de Valor Presente.

ETL (Expected Tail Loss)

Expressão em inglês, também chamada de “Risco de Cauda”, que representa o cálculo de probabilidade de perdas de um título, fora do intervalo de confiança determinado como parâmetro.

Fundo de Investimento

É um tipo de aplicação financeira que reúne recursos de um conjunto de investidores, regido por um regulamento, destinado à aplicação em títulos, valores mobiliários ou em quaisquer outros ativos disponíveis no mercado financeiro e de capitais.

Índice de Referência (*Benchmark*)

Indicador usado para comparar a rentabilidade entre investimentos, produtos, serviços e taxas. No mercado de ações, por exemplo, o índice BOVESPA é o *benchmark* mais utilizado.

LDI (*Liability Driven Investments*)

É uma técnica de construção de carteira de investimento para Planos de Aposentadoria, que busca imunizar os compromissos (pagamento de benefícios) do Plano, aumentando a segurança para o cumprimento desse objetivo.

Parâmetros do Cálculo do *VaR* (*Value at Risk*)

É a etapa inicial para o cálculo do Var, onde são definidos os métodos estatísticos e os elementos de análise do ativo, fundo ou carteira, para medir seu risco de mercado.

Patrimônio de Cobertura

É o total de recursos do Plano para cobertura de suas obrigações.

Patrimônio Líquido (PL)

Para fins de entendimento desse relatório, trata-se do somatório de todos os títulos e direitos de um fundo ou uma carteira de investimentos.

Rating

Expressão em inglês que significa classificação do risco oferecido por um banco, um fundo de investimento, uma empresa ou um país. Feito por agências especializadas, é utilizado como referência aos investidores na hora de decidirem onde aplicar os recursos. A classificação é expressa em termos de qualidade (excelente à péssima) ou nível de risco (grau de investimento à inadimplente). Entre as maiores agências, estão as norte-americanas *Standard & Poor's*, *Fitch IBA* e *Moody's Investors*.

Stress Testing

É uma simulação para avaliar o desempenho de um ativo, fundo ou carteira, sob um conjunto específico de condições adversas de mercado, que podem ser definidas pelo seu Administrador, nesse caso chamado de “cenário próprio”, ou pelo cenário disponibilizado pela BM&F Bovespa.

Tracking Error

Termo em inglês que define a diferença entre os retornos de uma carteira e o retorno do seu índice de referência (*benchmark*). É o desvio padrão da diferença calculada entre esses retornos.

Túnel de Preços

É o intervalo de preços estabelecido pelo administrador, que determina se a operação de compra ou venda de um determinado ativo foi realizada em condições de mercado, no momento daquela negociação.

Valor Presente

É o valor de uma série de fluxos de caixa futuros, descontados por uma taxa de juros (taxa de desconto).

Value at Risk (VaR)

Expressão em inglês para o cálculo de probabilidade de perdas de uma aplicação em vários cenários adversos da economia. Avalia a perda máxima que uma carteira poderá ter dentro de um horizonte e intervalo de confiança determinados.