



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO

Abril/2024

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 – ABRIL 2024



Relatório de Risco de Mercado

Data: 30/04/2024

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

Dados Gerais				Limite Fundo:		0,00% Dutation DC:		1.642,99	
PL:	4.797.663,841,57	VAR / PL:	1,0702%	Status:	ENQUADRADO	Dutation DU:			
VAR:	51.346.913,93	ETL / PL:	1,3421%	Benchmark:					1.131,16
ETL:	64.391.101,59	VAR / CDI:	0,0117%						

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	147.471.723,74	Cenário Baixa - 10000 (+):	286.193.605,27	CENARIO BRADESCO 1 (+):	430.513.300,55	CENARIO BRADESCO 2 (+):	17.245.176,78
Cenário Alta - 09999 (-):	-239.794.099,02	Cenário Baixa - 10000 (-):	-212.445.482,02	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-161.189.969,94	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-319.348.702,68
Cenário Alta - 09999:	-92.322.375,28	Cenário Baixa - 10000:	73.748.123,26	CENARIO BRADESCO 1:	269.323.330,62	CENARIO BRADESCO 2:	-302.103.525,90

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
17H0164854	7.215.057,35	31.604,73	27.153,55	0,05%	0,00	0,00	0,00	0,00
AFCP23	15.558.355,75	41.485,68	16.074,12	0,03%	-419.848,70	-142.006,34	71.406,89	-95.233,03
CCRDD1	3.269.057,98	6.099,90	1.809,10	0,00%	389.472,97	-834.607,61	407.833,73	-411.172,07
CMDT33	709.056,89	1.602,67	411,07	0,00%	-545.692,67	-260.593,26	38.852,90	-52.525,79
CSMG33	8.371.953,78	17.044,52	6.361,16	0,01%	-5.811,38	4.814,29	7.386,82	-10.221,71
ELT42	14.894.194,57	124.019,59	115.969,24	0,23%	945.331,20	-945.331,20	277.171,11	-279.439,90
ENJG21	1.700.158,14	6.689,24	5.590,09	0,01%	0,00	0,00	0,00	0,00
ENM21	1.085.710,27	4.460,77	3.747,42	0,01%	116.119,14	-116.119,14	68.092,26	-68.649,63
ENTY12	32.010.066,90	325.549,76	315.033,50	0,61%	-1.342.528,66	-58.867,98	552.748,33	-685.845,51
ERDV17_VENCIMENTO	13.625.526,63	40.475,43	14.421,76	0,03%	-137.149,62	-39.455,56	29.229,22	-38.651,14
ERDV36	2.179.556,17	4.225,99	1.218,16	0,00%	-95,44	77,15	123,02	-180,02
GASP17	60.711.050,22	1.429.109,15	1.062.492,95	2,07%	-363.153,23	-48.027,42	121.176,47	-156.561,03
GRRB24_VENCIMENTO	16.649.001,68	142.064,38	133.344,99	0,26%	-316,58	256,49	403,62	-582,73
IGSN15	2.666.952,52	38.761,93	35.877,12	0,07%	-1.165,21	946,45	1.499,38	-2.175,55
IFSN1600GM	15.327.371,67	32.703,13	2.077,11	0,00%	12.647,71	-12.647,71	6.180,52	-6.231,11
IFSN1800DC5	5.143.047,18	23.761,41	15.791,61	0,03%	-621.853,14	-103.106,38	196.449,19	-252.584,65
INEO16	7.838.700,36	65.777,84	61.914,83	0,12%	114.447,33	-106.272,53	59.921,35	-80.411,84
NTNB20240815 - 760199_VENCIMENTO	126.142.115,66	269.273,05	-146.224,19	-0,28%	-447.117,26	20.905,54	215.895,34	-260.316,27
NTNB20260815 - 760199_VENCIMENTO	42.905.875,05	260.325,59	220.825,36	0,43%	959.507,13	-1.189.788,84	562.654,98	-567.260,61
NTNB20300815 - 760199_VENCIMENTO	26.273.567,42	303.053,65	299.246,16	0,58%	43.447,95	-25.344,64	10.615,78	-10.702,68
NTNB20350515 - 760199_VENCIMENTO	236.985.742,69	3.156.799,23	3.058.147,79	5,96%	1.045.070,85	-1.045.070,85	612.829,54	-617.845,88
NTNB20400815 - 760199_VENCIMENTO	29.062.770,61	417.775,11	397.894,06	0,77%	1.530.138,83	-1.530.138,83	897.273,41	-904.610,07
NTNB20450515 - 760199_VENCIMENTO	225.097.998,34	3.397.363,20	3.197.199,56	6,23%	122.367,09	-122.367,09	71.756,06	-72.343,42
NTNB20500815 - 760199_VENCIMENTO	700.908.665,73	12.147.455,52	11.491.438,12	22,38%	1.218.717,50	-1.218.717,50	714.655,94	-720.505,79
NTNB20550515 - 760199_VENCIMENTO	223.904.777,42	4.052.915,73	3.847.345,05	7,49%	633.683,12	-633.683,12	464.489,73	-468.291,83
OMGE31	13.783.745,75	77.761,22	57.834,44	0,11%	0,00	0,00	0,00	0,00
PETRA5	9.625.390,03	39.821,27	-3.176,94	-0,01%	-24,09	19,93	33,77	-50,21
SBSPC2	8.672.607,76	19.602,29	5.027,84	0,01%	-346,79	282,61	467,12	-692,53
TAEES3	4.324.189,24	8.468,00	2.296,20	0,00%	4.389,57	-4.389,57	2.574,04	-2.595,11
O20913	1.023.676,63	32.611,63	-18.179,28	-0,04%	0,00	0,00	0,00	0,00
ASB13	2.781.948,05	79.433,93	1.732,66	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
AEGP11	1.882.112,39	1.542,25	1.455,66	0,00%	3.601.239,84	-3.601.239,84	527.941,76	-532.263,25
AIEC11	1.890.662,40	145.866,72	-102.813,02	-0,20%	2.545.310,46	-2.969.628,87	1.243.808,38	-1.253.989,62
ALOS3	5.478.953,76	566.823,84	477.270,77	0,53%	2.903.900,00	-2.903.900,00	425.711,74	-429.196,42
ALPA4	464.476,54	59.191,76	24.831,77	0,05%	17.235,07	-10.936,23	7.798,12	-7.861,95
ANEM11	10.890.174,42	209.186,04	192.105,47	0,37%	0,00	0,00	0,00	0,00
ANET11	1.915.528,42	11.124,31	10.228,68	0,02%	351.770,86	-351.779,20	206.283,32	-207.971,86
ANHB10	453.656,90	25,46	23,94	0,00%	258.397,29	-258.410,70	80.602,15	-81.261,92
APPSA2	3.354.414,67	43.999,17	42.440,10	0,08%	35.229,04	-19.215,84	9.390,14	-9.467,00
APRB28	1.168.666,76	84,87	79,74	0,00%	-1.417.240,87	-119.609,26	549.883,76	-694.940,11
ARTRA1	2.577.813,10	313,12	294,25	0,00%	-4.703,33	3.798,86	5.860,00	-8.415,21
ARZZ3	42.159,04	7.471,92	6.408,81	0,01%	100.170,00	-100.170,00	58.739,69	-59.220,50
ASAB11	6.380.002,11	75.664,24	71.288,51	0,14%	-686.040,66	-19.399,08	276.781,64	-354.306,44
ASAJ3	408.740,48	50.739,85	44.806,73	0,09%	-463,27	381,51	637,73	-943,34
ASER12	2.737.758,58	72.794,69	68.397,66	0,13%	-805.450,31	-200.186,49	197.955,32	-260.960,46
AURE3	3.838.028,50	182.639,33	-58.422,53	-0,11%	0,00	0,00	0,00	0,00
AZUL4	72.413,25	24.234,41	16.667,64	0,03%	-1.254.040,37	-142.734,92	446.407,07	-567.727,36
B3SA3	4.180.283,38	200.749,78	118.596,16	0,23%	-202.318,93	175.545,71	259.872,00	-334.960,63
BBAS3	6.120.555,30	304.291,62	187.961,14	0,37%	-1.903.021,31	-216.635,67	677.776,27	-864.942,42
BBDC4	489.468,36	47.551,13	-17.850,18	-0,03%	-574.019,60	-60.124,42	208.963,22	-266.142,88
BBDC4	4.874.870,00	493.530,44	-219.083,87	-0,43%	-70.495,67	-19.391,00	12.757,99	-17.231,57
BBSE3	3.168.415,60	100.668,93	-10.866,80	-0,02%	43.441,67	-43.441,67	25.474,20	-25.682,72
BBTOPIND	334.570.932,07	4.290.564,57	4.225.217,07	8,23%	0,00	0,00	0,00	0,00
BCBF14	172.718,17	6,22	5,85	0,00%	-2.035,35	1.659,85	2.565,99	-3.648,89
BCBF15	2.098.700,15	89,40	84,23	0,00%	227.783,40	-303.718,09	111.310,16	-112.221,29
BEEF3	17.558,28	2.361,42	1.715,18	0,00%	-1.048,11	842,04	1.315,48	-1.910,07
BHIA3	15.289,20	4.613,78	1.494,66	0,00%	-679,35	954,06	915,27	-1.351,71
BKBR18	2.524.319,38	0,00	0,00	0,00%	324.357,10	-324.357,10	95.101,50	-95.875,96
BMLC11	3.691.239,84	282.408,61	179.062,13	0,35%	-8.428,39	6.968,55	10.696,99	-14.849,22
BPAAC11	8.484.368,20	858.397,52	725.499,51	1,41%	46.990,17	-39.150,14	22.957,64	-23.145,56
BPML11	2.903.900,00	210.283,09	-163.038,10	-0,32%	-793.649,64	-88.948,16	283.451,08	-359.648,40
BRAP4	53.193,17	6.064,72	-5.219,10	-0,01%	-15.599,07	13.205,10	20.371,27	-27.186,32
BRELETRO	1.673.398,32	26.340,66	16.506,07	0,03%	-22.368,22	-5.905,88	3.436,91	-4.637,58
BRFS3	1.407.116,80	121.438,62	34.211,58	0,07%	1.760.247,72	-195.674,69	393.625,47	-396.847,51
BRIT3	549.810,00	114.550,18	27.017,52	0,05%	26.424,31	-26.424,31	11.068,01	-11.158,61
BRKM5	64.052,80	19.032,97	11.398,66	0,02%	157.517,61	-157.517,61	46.184,16	-46.562,21
BRKP28	10.440.838,39	238.513,87	210.150,17	0,41%	-1.235.750,80	-101.678,63	472.667,29	-596.312,17
BRKPA0	3.252.036,24	1.272,89	1.195,63	0,00%	15.514,42	-21.720,18	9.097,65	-9.172,12
BRSR6	400.680,00	70.904,25	53.530,55	0,10%	-32.745,57	33.397,95	117.706,84	-179.158,66
BTOW15	5.442.132,00	106.216,70	98.903,01	0,19%	0,00	0,00	0,00	0,00
CAEC11	2.524.151,45	121,93	114,61	0,00%	-843.752,04	-211.431,37	208.158,27	-273.722,91
CAEC21	9.117.399,74	71.175,79	65.738,45	0,13%	190.028,08	-82.057,58	91.805,16	-92.556,63
CABA	57.000,00	0,00	0,00	0,00%	27,83	-28,32	0,00	104,91
CART13	11.104.894,85	176.937,05	163.560,02	0,32%	833.193,64	-833.193,64	555.209,94	-559.754,63
CBAN22	10.548.723,18	53.796,61	50.095,44	0,10%	1.719.915,99	-1.719.915,99	1.146.089,47	-1.155.470,83
CBAN32	16.289.842,08	267.319,87	247.651,32	0,48%	0,00	0,00	0,00	0,00
CBAN72	4.779.312,48	83.553,48	76.802,50	0,15%	0,05	-0,05	-0,16	0,25
CCRO3	173.766,69	16.435,80	14.172,73	0,03%	0,01	-0,01	-0,05	0,07
CDB323RSIT1	6.576.820,98	0,00	0,00	0,00%	0,18	-0,18	-0,63	0,95
CEAB22	1.724.113,03	545,96	513,96	0,00%	-4.455,21	3.748,17	5.789,74	-7.817,32
CEAB3	759.278,00	96.361,30	5.343,58	0,01%	0,00	0,00	0,00	0,00
CEEBA3	1.856.649,73	282,96	265,58	0,00%	67.006,04	-67.006,04	39.292,34	-39.613,97
CELGI2	2.463.630,48	176,12	165,44	0,00%	-828.904,86	-169.141,92	230.223,68	-299.472,27
CEOC11	648.714,20	20.931,54	4.792,09	0,01%	-5.257,82	4.465,40	6.894,82	-9.161,54
CGBP13	4.458.940,34	2.237,74	2.109,85	0,00%	231.952,88	-231.952,88	136.017,17	-137.130,54

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – ABRIL 2024



Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: **EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS** Data: 30/04/2024
 CNPJ: **10679245000140**

Dados Gerais			
PL:	4.797.663,841,57	VAR / PL:	1,0702%
VAR:	51.346.913,93	ETL / PL:	1,3421%
ETL:	64.391.101,59	VAR / CDI:	0,0117%
Limite Fundo:	0,00%	Dutação DC:	1,642,99
Status:	ENQUADRADO	Dutação DU:	1,131,16
Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	147.471.723,74	Cenário Baixa - 10000 (+):	286.193.605,27	CENARIO BRADESCO 1 (+):	430.513.300,55	CENARIO BRADESCO 2 (+):	17.245.176,78
Cenário Alta - 09999 (-):	-239.794.099,02	Cenário Baixa - 10000 (-):	-212.445.482,02	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-161.189.969,94	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-319.348.702,68
Cenário Alta - 09999:	-92.322.375,28	Cenário Baixa - 10000:	73.748.123,26	CENARIO BRADESCO 1:	269.323.330,62	CENARIO BRADESCO 2:	-302.103.525,90

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
CIEL3	166.600,55	9.243,19	1.934,49	0,00%	-260.881,80	-52.210,64	72.974,44	-95.416,31
CJEN13	7.179.867,70	112.507,65	103.712,31	0,20%	-273.411,48	-118.598,68	25.909,52	-35.007,56
CLH2	2.473.143,47	4.039,33	3.808,37	0,01%	52.316,93	-39.237,70	19.174,15	-19.331,11
CMC4	2.685.030,48	225.850,90	-92.833,97	-0,18%	189.336,00	-189.336,00	92.522,19	-93.279,54
CMN3	75.498,02	4.497,09	-2.340,28	0,00%	5.602,88	-5.602,88	1.642,76	-1.656,21
CNES11	315.035,22	425.920,01	-97.950,74	-0,19%	285.055,20	-199.897,20	171.492,97	-172.896,74
CNRD11	10.171.314,84	192.662,45	174.020,52	0,34%	74.671,52	-67.671,07	34.208,89	-34.488,91
COGN3	62.057,66	11.222,29	3.234,23	0,01%	-723.623,36	673.435,07	494.921,00	-493.617,64
COMPROMISSADA_PRE	1.145.475.873,48	16.851,07	4.412,70	0,01%	-1.382.645,86	1.220.018,22	1.218.754,21	-1.189.820,35
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	6.346.396,91	0,00	0,00	0,00%	-385.872,29	335.976,56	372.759,98	-356.369,41
CONX12	9.523.196,96	76.052,21	71.854,74	0,14%	105.706,69	-97.170,80	-114.702,20	102.742,05
CPFE3	626.228,90	43.106,01	-29.438,32	-0,06%	-205.619,80	195.429,75	183.623,98	-184.446,30
CPGT16	147.048,47	6,45	-5,63	0,00%	-1.759.936,55	1.557.011,74	1.510.926,94	-1.486.700,34
CPL3	3.787.243,80	214.652,07	165.046,13	0,32%	-1.357.464,30	1.196.947,39	1.267.740,84	-1.221.256,98
CPL6	7.817.799,96	507.975,11	439.652,53	0,86%	142.013,17	-124.621,06	-139.225,40	131.385,86
CPMK24C099250	-0,20	0,27	-0,09	0,00%	-106.548,54	94.539,29	109.732,77	-101.246,16
CPMK24C099500	-293,36	379,19	-335,15	0,00%	-4,05	4,13	14,11	-21,44
CPMK24C099750	-75,82	207,82	191,01	0,00%	-3.947,81	3.234,53	4.988,04	-7.033,48
CPMK24C100000	-1.031,55	1.877,38	1.516,59	0,00%	-2.001.644,19	1.556.918,13	2.719.095,85	-4.051.290,02
CPT212	1.910.134,13	1.158,61	1.092,68	0,00%	-1.186.777,49	897.890,82	1.034.889,71	-2.023.480,18
CREDZM24	210.806,29	0,00	0,00	0,00%	-579.790,10	454.005,75	697.889,08	-971.450,79
CRFB3	268.024,15	61.570,31	46.203,80	0,09%	11.291,29	-9.204,05	-14.259,46	19.137,55
CRMG15	9.475.762,30	85.805,32	83.008,65	0,16%	235.525,56	-196.175,08	-308.583,89	399.254,46
CSAN23	1.122.278,42	1.357,15	1.278,99	0,00%	1.448.801,23	-1.252.692,43	-2.026.851,49	2.436.355,53
CSAN3	927.811,50	72.881,72	54.061,33	0,11%	187.518,20	-168.660,76	-277.482,42	310.264,22
CSMGB8	2.809.359,65	25.556,72	24.546,13	0,05%	3.600,50	-3.672,23	-12.942,31	19.699,17
CSNA3	130.792,32	8.891,13	5.883,52	0,01%	252.867,57	-258.017,43	-882.160,03	1.339.133,09
CURY3	631.120,00	83.814,75	67.951,92	0,13%	1.256.652,72	-975.060,66	-1.495.317,95	2.119.035,73
CVCB3	11.205,75	5.084,57	4.489,16	0,01%	-4.372.564,13	3.939.337,27	7.428.676,37	-11.156.125,68
CXSE3	1.169.800,00	137.753,02	92.135,17	0,18%	383.380,90	-383.380,28	187.345,42	-188.876,94
CYR53	233.348,50	41.084,35	36.322,92	0,07%	-748.136,52	761.183,35	-968.598,64	974.804,67
DAPK25	-26.908,06	153.223,04	-53.843,56	-0,11%	6.329,87	-7.595,84	3.711,83	-3.742,22
DAPK27	-157.788,28	372.017,25	349.906,24	0,68%	30.441,46	-30.441,87	24.793,21	-24.996,16
DAPK29	-27.035,18	90.504,44	89.264,28	0,17%	-898,63	723,95	1.157,31	-1.699,04
DAPK35	14.267,35	19.975,12	-19.482,07	-0,04%	-4.373,51	3.589,70	5.500,04	-7.716,94
DAPQ24	-4.652,88	152.102,22	-69.306,71	-0,13%	4.396.701,09	-4.100.614,11	2.054.462,41	-2.071.279,30
DAPQ26	-195.942,94	436.347,62	348.575,15	0,68%	-1.354.491,15	-294.176,82	362.909,16	-476.754,22
DAPQ28	-127.423,18	344.284,16	338.853,73	0,66%	74.170,00	-55.970,00	30.463,48	-30.712,84
DAPQ30	10.097,04	30.746,47	-30.362,83	-0,06%	53.376,68	-53.376,68	31.300,08	-31.556,29
DAPQ32	-11.787,58	21.754,71	21.371,85	0,04%	2.277.355,22	-3.139.057,20	902.325,07	-909.711,09
DASAA2	1.359.856,31	0,81	0,61	0,00%	1.784.563,25	-2.309.434,80	1.538.923,37	-1.551.520,29
DESK13	2.798.206,50	1.054,89	993,71	0,00%	12,19	-12,19	2,23	-2,25
DHF25	-153.814,79	515.072,78	484.768,26	0,94%	-91.562,37	-32.775,91	14.357,69	-19.171,72
DHF28	-116.871,58	320.246,31	299.490,03	0,58%	-60.499,24	-21.622,45	9.539,40	-12.705,51
DHF29	-151.785,34	154.975,77	145.517,20	0,28%	-3.108.265,37	551.047,43	924.536,28	-1.203.957,73
DHF29	967,28	2.928,17	-2.757,77	-0,01%	4.581.158,40	-4.581.158,40	3.357.989,11	-3.385.476,06
DHF29	20.025,39	59.299,59	-55.643,53	-0,11%	-333.896,68	166.452,94	-18.433,67	-24.929,87
DHF31	116.854,33	348.667,27	-324.663,56	-0,63%	-448.183,46	-223.426,77	24.743,18	-33.462,91
DHF33	14.513,65	44.372,43	-41.043,57	-0,08%	-48.133,49	-13.153,97	8.755,96	-11.826,27
DHK24	21,06	1.852,84	-485,19	0,00%	-323.516,07	-116.189,60	44.217,55	-59.432,84
DHM24	12.501,85	55.360,70	-42.075,53	-0,08%	2.685,05	-4.027,73	1.968,22	-1.984,33
DHN26	116.556,93	340.732,03	-319.256,70	-0,62%	705.966,61	-705.966,61	517.473,52	-521.709,32
DHV24	-328.901,19	1.179.565,87	1.098.363,40	2,14%	476.708,75	-476.708,75	139.771,01	-140.915,11
DIRR3	1.277.936,00	190.134,38	171.599,95	0,33%	-1.545.231,82	1.815.107,27	1.330.437,53	-1.753.230,60
DOLM24	-99.330,52	219.641,75	168.467,77	0,33%	-1.402.492,61	93.347,54	669.206,14	-805.474,07
DXCO3	25.319,46	3.260,89	2.329,35	0,00%	713.354,29	-713.354,29	418.310,96	-421.735,06
EGIE3	169.121,50	9.380,12	-4.900,36	-0,01%	3.342.650,63	-3.342.650,63	1.088.961,29	-1.097.875,03
ELET13	2.009.591,76	239,23	224,85	0,00%	1.573.913,61	-1.398.945,43	1.281.763,75	-1.292.276,84
ELT24	2.853.417,16	1.171,99	1.118,63	0,00%	289.970,29	-241.641,91	141.698,16	-142.850,70
ELET3	14.014.068,30	1.739.620,86	1.579.386,64	3,08%	-169,11	137,77	225,24	-330,55
ELT6	207.800,00	12.201,46	20.249,99	0,04%	-894.866,46	-196.840,57	238.990,20	-313.863,23
EMBR3	213.506,70	45.572,49	18.303,73	0,04%	-1.554.308,36	-341.895,64	415.106,04	-545.154,24
ENEV3	6.155.014,12	332.303,51	16.269,87	0,03%	-1.996,15	1.615,88	2.532,63	-3.662,98
ENGH1	10.497.430,90	349.067,70	184.081,74	0,36%	-1.293,18	1.069,90	1.635,17	-2.262,99
ENGL4	15,24	0,76	0,55	0,00%	3.128.760,37	-3.129.009,76	1.349.047,86	-1.360.090,54
EQTL3	22.905.792,00	1.067.150,44	800.377,87	1,56%	-1.212.456,11	-68.660,33	485.183,35	-607.416,93
ERDV17	10.151.017,34	30.154,20	10.744,21	0,02%	-1.429.443,60	-121.991,10	539.959,01	-684.624,08
ERDV38	5.881.916,54	31.630,03	22.171,42	0,04%	60.379,02	-55.129,49	38.485,63	-38.800,66
EZTC3	13.425,75	2.473,77	2.034,27	0,00%	-276.412,79	-31.651,46	98.181,52	-124.705,36
FLRY3	3.529.833,04	153.847,38	-65.043,73	-0,13%	-29.881,28	5.377.931,57	12.584.626,41	-29.881,28
FVPP11	953.417,50	41.426,60	31.809,73	0,06%	38.265,80	-5.611.508,72	-12.824.739,63	38.265,80
GBSP11	9.210.693,33	219.059,59	208.008,63	0,41%	29,27	-199.389,07	-3.083.968,77	29,27
GGBR4	2.853.417,16	229.559,29	-118.934,16	-0,23%	-8,66	102.851,49	397.986,16	-8,66
GGPS3	7.428.112,50	827.527,16	219.117,63	0,43%	-20,61	405.908,36	2.578.701,99	-20,61
GMAT3	8.743.408,94	1.665.555,03	1.546.341,10	3,01%	-27,40	801.892,23	3.598.919,05	-27,40
GOAL4	966.567,64	86.677,40	-59.469,78	-0,12%	-177,60	462.959,59	1.715.155,67	-177,60
GRRB14	1.077.399,36	44,53	41,80	0,00%	7.946,10	-2.874.310,00	-9.100.885,85	7.946,10
GRRB24	9.585.378,00	81.791,14	76.771,10	0,15%	-30.426,50	1.124.203,72	3.201.304,97	-30.426,50
GUAR15	2.728.237,50	536,12	503,98	0,00%	-321.791,72	1.096.332,97	3.008.261,79	-321.793,08
HAPV22	565.147,26	343,94	324,18	0,00%	993.472,38	-2.197.638,98	-6.022.448,96	994.455,84
HAPV3	9.202.236,39	1.148.713,05	-32.489,96	-0,06%	-964.303,43	1.590.448,86	4.355.972,29	-974.242,43
HARG11	10.001.287,57	192.574,45	174.564,20	0,34%	734.520,84	-981.873,58	-2.688.640,51	759.264,30
HVRD15	11.400.539,17	210.539,11	193.955,31	0,38%	-1.526.546,57	1.788.706,10	4.897.894,02	-1.671.353,10
HYPE3	262.521,36	38.573,93	31.685,17	0,06%	2.360.994,20	-2.956.912,29	-7.108.223,56	2.843.739,73
HZTC14	2.519.949,54	39.141,59	36.099,87	0,07%	-1.219.167,13	1.298.586,19	3.555.831,73	-1.631.623,02

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – ABRIL 2024



Relatório de Risco de Mercado

Data: 30/04/2024

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

Dados Gerais			
PL:	4.797.663,841,57	VAR / PL:	1,0702%
VAR:	51.346.913,93	ETL / PL:	1,3421%
ETL:	64.391.101,59	VAR / CDI:	0,0117%
Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	1,642,99
Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1,131,16
Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	147.471.723,74	Cenário Baixa - 10000 (+):	286.193.605,27	CENARIO BRADESCO 1 (+):	430.513.300,55	CENARIO BRADESCO 2 (+):	17.245.176,78
Cenário Alta - 09999 (-):	-239.794.099,02	Cenário Baixa - 10000 (-):	-212.445.482,02	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-161.189.969,94	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-319.348.702,68
Cenário Alta - 09999:	-92.322.375,28	Cenário Baixa - 10000:	73.748.123,26	CENARIO BRADESCO 1:	269.323.330,62	CENARIO BRADESCO 2:	-302.103.525,90

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
IDIF25P419600	29.881,28	93.461,89	87.765,96	0,17%	-615,67	2.128.843,36	6.366.731,98	-615,67
IDIF25P419700	-38.265,80	115.823,58	-108.766,72	-0,21%	1.252,57	-2.330.879,09	-6.571.852,57	1.252,57
IDIN24P400300	-23,27	67,41	-73,14	0,00%	4.918,40	-5.059.634,99	-13.533.648,52	4.918,40
IDIN24P400400	8,66	90,18	25,25	0,00%	-4.560,60	2.670.975,13	6.815.560,70	-4.560,60
IDIN24P400500	20,61	86,60	72,46	0,00%	-4.777,50	1.694.252,39	4.144.168,61	-4.777,50
IDIN24P400600	27,40	145,93	122,10	0,00%	-5.991,12	1.391.306,89	3.275.760,78	-5.991,12
IDIN24P400700	177,60	851,80	712,71	0,00%	-44.109,84	4.763.117,76	10.503.389,22	-44.109,84
IDIN24P400800	-7.946,10	35.611,26	-29.796,44	-0,06%	65.662,60	-5.048.256,16	-10.823.965,73	65.662,60
IDIN24P400900	30.426,50	94.606,71	79.158,78	0,15%	91.963,41	-5.204.837,16	-10.879.828,34	91.963,41
IDIN24P401100	321.793,08	225.381,70	188.580,06	0,37%	-166.818,50	7.219.343,08	14.746.445,33	-166.818,50
IDIN24P401200	994.455,84	464.841,57	-388.939,52	-0,76%	65.249,58	-1.804.876,54	-3.621.998,11	65.249,58
IDIN24P401300	-774.242,43	340.162,45	284.618,74	0,55%	-1.371.511,82	17.166.984,62	33.647.295,50	-1.371.511,82
IDIN24P401400	-759.264,30	210.826,55	-176.401,56	-0,34%	3.727.690,32	-34.935.012,87	-67.903.648,36	3.727.690,32
IDIN24P401500	1.671.353,10	384.210,38	321.474,26	0,63%	-2.415.537,16	17.708.669,38	34.196.993,99	-2.415.537,16
IDIN24P401600	-2.843.739,73	557.604,96	-466.555,96	-0,91%	-285.660,48	-38.239,88	97.252,28	-285,66
IDIN24P401700	1.631.623,02	278.339,94	233.393,00	0,45%	1.080,11	-979,70	-1.883,78	2.070,52
IDIN24P410000	815,67	3.191,92	2.973,86	0,00%	1.532.046,91	-1.532.046,91	1.122.990,39	-1.132.182,67
IDIV24P410100	-1.252,57	6.142,01	-5.722,42	-0,01%	507.422,55	-506.516,48	401.360,35	-403.452,04
IDIV24P410200	-4.918,40	22.728,68	-21.175,97	-0,04%	0,00	0,00	0,00	0,00
IDIV24P410300	4.560,60	19.789,73	18.437,79	0,04%	229.600,00	-160.720,00	67.318,72	-67.869,76
IDIV24P410400	4.777,50	19.546,64	18.211,31	0,04%	-793.254,02	-111.114,62	264.300,63	-337.009,97
IDIV24P410500	5.991,12	23.379,04	21.781,89	0,04%	-832.745,61	-310.406,34	127.045,90	-169.833,73
IDIV24P410700	44.109,84	156.837,43	146.123,07	0,28%	114.341,29	-96.750,32	25.788,36	-25.999,45
IDIV24P410800	-65.662,60	223.713,76	-208.430,73	-0,41%	-519.321,33	20.261,57	247.627,34	-299.657,17
IDIV24P410900	-91.963,41	302.410,62	-281.751,40	-0,55%	-1.214.923,09	63.882,77	491.649,66	-616.505,16
IDIV24P411000	166.818,50	536.816,16	500.143,50	0,97%	2.070.468,95	-2.070.468,95	1.597.530,25	-1.610.606,90
IDIV24P411100	-65.249,58	183.063,28	-170.557,29	-0,33%	3.644.132,35	-3.461.925,73	2.671.149,01	-2.693.013,81
IDIV24P411300	1.371.511,82	2.732.767,82	2.546.078,48	4,96%	-652,50	529,67	856,88	-1.260,33
IDIV24P411400	-3.727.690,32	6.409.330,49	-5.971.476,36	-11,63%	-37,72	32,49	58,90	-88,20
IDIV24P411500	2.415.537,16	3.618.090,42	3.370.920,16	6,56%	847.292,71	-847.292,71	354.894,61	-357.799,61
IGTA37	2.080.650,02	289,59	-289,18	0,00%	-360.846,94	-42.137,82	124.566,05	-160.461,67
IGTI11	7.680.234,55	719.274,42	600.325,16	1,17%	55.393,92	-44.315,14	32.483,00	-32.748,89
INDM24	-28.556,00	59.047,81	19.509,84	0,04%	-673.812,79	-11.547,16	273.867,60	-351.053,44
INSSN1	1.085.242,85	162.656,05	105.938,08	0,21%	-3.338,32	2.696,35	4.159,30	-5.972,93
INTB3	469.200,00	65.489,77	36.201,99	0,07%	-2.075.931,44	-230.651,21	725.778,69	-934.492,75
IPIL11	8.030.659,30	102.480,69	95.937,22	0,19%	-480.533,04	-108.062,32	128.285,87	-168.601,97
IRBR12	11.900.223,06	66.031,70	57.080,33	0,11%	0,00	0,00	0,00	0,00
IRBR3	175.909,68	24.134,18	-15.867,71	-0,03%	0,00	0,00	0,00	0,00
IRJS14	3.221.393,64	84.415,32	79.191,06	0,15%	0,00	0,00	0,00	0,00
ITPO14	9.107.560,53	194.488,50	176.800,42	0,34%	0,00	0,00	0,00	0,00
ITSA4	10.897.205,00	1.120.286,73	1.061.171,13	2,07%	0,00	0,00	0,00	0,00
ITUB8	18.220.661,76	1.668.610,02	1.695.749,74	3,11%	0,00	0,00	0,00	0,00
IUA18	2.693.114,10	172,97	162,82	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
IUA35	1.338.104,10	9,72	9,09	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
IJBSS3	2.420.836,32	234.581,46	-112.726,42	-0,22%	0,00	0,00	0,00	0,00
JSMLB5	3.275.846,45	46.294,13	44.256,07	0,09%	0,00	0,00	0,00	0,00
KLEN11	221.675,68	27.837,34	12.275,32	0,02%	0,00	0,00	0,00	0,00
LAMEA6	5.516.697,59	102.775,86	96.515,85	0,19%	0,00	0,00	0,00	0,00
LCAMC3	2.949.776,31	903,47	848,63	0,00%	-393.071,18	322.281,76	484.527,37	-674.214,85
LCAMD1	18.517.409,30	270.320,58	258.029,44	0,50%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF001800FAU	4.651.674,83	44.317,37	41.062,67	0,08%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002100HDP	1.600.987,79	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002100HDQ	2.916.582,43	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002200IO9	2.550.129,98	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002200U5M	10.506.502,91	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002200U5N	11.015.431,06	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306J16	10.923.418,34	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306U55	6.563.728,83	0,00	0,00	0,00%	142,29	-145,32	-446,48	679,98
LF002306Z9P	5.406.474,11	0,00	0,00	0,00%	225,84	-230,80	-700,19	1.066,38
LF002306ZK1	5.423.618,80	0,00	0,00	0,00%	183,91	-188,10	-542,32	826,04
LF0024000XE	10.506.267,09	0,00	0,00	0,00%	-8.091,82	6.589,94	10.221,74	-14.638,15
LF0024000XG	10.487.410,23	0,00	0,00	0,00%	-435.772,71	-105.277,23	73.144,30	-98.705,55
LF0024000XN	10.464.386,09	0,00	0,00	0,00%	-323.976,28	-156.484,40	22.209,26	-29.986,95
LF0024002C7	6.542.150,44	106.660,54	100.198,85	0,20%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024002SX	4.500.011,04	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024002TZ	10.451.279,21	0,00	0,00	0,00%	-1.164,70	1.327,71	0,00	0,00
LF00240033U	6.693.662,35	0,00	0,00	0,00%	-121.930,55	154.400,20	-23,11	35,18
LF0024003QF	11.012.295,87	0,00	0,00	0,00%	-115.314,24	173.810,06	2.029,03	-3.088,88
LF0024006R2	11.055.855,34	0,00	0,00	0,00%	-582.315,72	1.007.534,07	21.000,55	-31.965,90
LF0024007F1	6.743.895,58	0,00	0,00	0,00%	-176.627,74	339.074,99	9.094,88	-13.841,60
LF0024009LF	6.636.655,83	0,00	0,00	0,00%	-7.149,84	18.646,85	882,87	-1.342,99
LFSC1900089	3.775.154,94	0,00	0,00	0,00%	-42.160,17	114.890,56	7.606,33	-11.557,16
LFSC190054B	924.626,65	0,00	0,00	0,00%	-64.685,51	157.555,26	11.918,29	-18.065,18
LFSC190059S	1.411.101,45	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFSC19005L1	933.489,41	0,00	0,00	0,00%	-1.704,11	1.399,40	2.139,84	-2.996,37
LFSC22002IX	4.873.651,83	2.200,24	2.066,92	0,00%	-1.737,97	1.398,49	2.238,22	-3.279,16
LFNSN210029N	4.595.270,42	0,00	0,00	0,00%	-718.051,32	-65.665,81	258.520,65	-332.792,12
LFNSN2301ERT	4.464.986,23	0,00	0,00	0,00%	308.393,61	-308.393,61	226.052,62	-227.902,88
LFT20240901 - 210100	1.535.723,17	103,72	8,12	0,00%	-19,71	19,08	40,27	-60,71
LFT20250301 - 210100	53.159.738,59	5.559,33	1.464,81	0,00%	-21.844,05	17.069,76	26.274,80	-37.864,50
LFT20260901 - 210100	31.784.493,27	3.131,25	196,11	0,00%	-1.228.578,79	1.003.064,53	1.501.218,34	-2.126.645,96
LFT20260301 - 210100	124.857.854,52	13.720,85	-1.145,01	0,00%	-10.972,05	9.523,29	14.315,98	-19.198,86
LFT20260901 - 210100	31.313.870,13	3.361,70	182,55	0,00%	31.533,92	-31.533,92	11.557,18	-11.651,78
LFT20270301 - 210100	1.296.004,57	162,28	28,33	0,00%	2.392.617,52	-2.392.617,52	701.486,14	-707.228,18
LFT20290301 - 210100	4.222.962,19	1.447,90	321,74	0,00%	-9.266,32	7.766,85	11.946,29	-16.214,05

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – ABRIL 2024



Relatório de Risco de Mercado

Data: 30/04/2024

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

Dados Gerais					
PL:	4.797.663.841,57	VAR / PL:	1,0702%	Limite Fundo:	0,00%
VAR:	51.346.913,93	ETL / PL:	1,3421%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	64.391.101,59	VAR / CDI:	0,0117%	Benchmark:	ENQUADRADO
				Dutação DC:	1,642,99
				Dutação DU:	1,131,16

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	147.471.723,74	Cenário Baixa - 10000 (+):	286.193.605,27	CENARIO BRADESCO 1 (+):	430.513.300,55
Cenário Alta - 09999 (-):	-239.794.099,02	Cenário Baixa - 10000 (-):	-212.445.482,02	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-161.189.969,94
Cenário Alta - 09999:	-92.322.375,28	Cenário Baixa - 10000:	73.748.123,26	CENARIO BRADESCO 1:	269.323.330,62
				CENARIO BRADESCO 2 (+):	17.245.176,78
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	-319.348.702,68
				CENARIO BRADESCO 2:	-302.103.525,90

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
LFT20300301 - 210100	4.530.883,83	3.411,08	-2.790,27	-0,01%	268.316,18	-268.331,34	126.230,61	-127.263,77
LIGHB4	4.090.342,06	0,00	0,00	0,00%	959.022,72	-959.022,72	281.185,46	-283.487,12
LICHHD	978.208,65	456,57	430,00	0,00%	1.234.142,50	-1.088.007,93	347.933,25	-350.781,27
LIMPH7	2.750.221,66	462,83	434,63	0,00%	-4.243,42	3.516,44	5.390,72	-7.453,72
LORTA7	6.399.346,16	95.920,17	91.433,15	0,18%	-959.184,55	-110.824,32	332.036,73	-427.716,49
LTREN3	1.541.968,05	144.577,34	20.331,11	0,04%	670.643,82	-502.982,67	245.790,96	-247.802,89
LTREN1	688.924,60	5,14	4,70	0,00%	10.186,68	-10.187,19	4.977,89	-5.018,64
LTN20260101 - 100000	590.473,72	5.888,84	5.505,77	0,01%	-1.074.819,88	-203.339,16	312.307,99	-405.317,48
LTN20260701 - 100000	25.510.544,11	332.708,46	312.017,92	0,61%	1.516.782,96	-1.263.985,80	741.201,27	-747.268,41
LTN20280101 - 100000	134.809,11	2.693,73	2.536,67	0,00%	-711.126,19	-152.468,43	192.749,99	-252.969,65
LWSA3	78.834,80	16.315,21	13.545,82	0,03%	3.498.643,96	-3.498.643,96	1.025.802,41	-1.034.199,16
MALL11	4.785.035,04	167.897,71	151.145,06	0,29%	1.800.283,52	-1.800.283,52	263.921,56	-266.081,90
MANT12	2.504.657,24	2.425,26	2.287,41	0,00%	755.321,96	-755.340,17	442.920,80	-446.546,34
MATD3	861.053,92	82.561,72	-21.293,91	-0,04%	-262.670,47	-64.043,69	65.100,41	-85.334,05
MAXR11	1.918.045,44	94.832,01	75.367,12	0,15%	-89.696,12	92.182,75	73.556,25	-99.408,94
MGLU3	2.373.350,96	569.463,95	514.614,31	1,00%	-536.172,11	551.036,32	439.693,64	-594.231,96
MOVZ7	1.158.549,91	1.125,81	1.061,19	0,00%	-144.489,78	143.349,77	90.728,40	-121.761,52
MOV37	8.674.634,33	123.457,58	117.984,10	0,23%	-963.446,40	980.631,11	792.173,89	-1.049.502,80
MRFG3	1.676.609,55	172.160,87	42.595,37	0,08%	-1.035.184,70	1.053.648,98	851.159,22	-1.127.648,87
MRVE3	33.955,60	5.546,76	2.556,82	0,00%	-478.369,87	498.387,36	409.313,52	-538.228,51
MTRJ19	11.916.294,72	114.914,07	110.806,20	0,22%	-1.053.524,61	1.140.077,18	968.794,06	-1.257.999,29
MULT3	5.055.943,20	356.374,39	247.499,31	0,48%	-14.772,46	15.710,43	13.880,87	-17.897,02
NEWL11	6.997.287,92	421.078,54	-209.126,52	-0,41%	-1.371.276,35	1.425.457,87	1.285.670,17	-1.638.884,13
NEWU11	1.800.283,52	47.949,39	-28.706,54	-0,06%	-17.400.063,17	19.160.367,08	18.079.110,87	-22.081.251,09
NTCO3	3.021.287,85	448.884,51	351.096,32	0,68%	-2.793.257,34	3.084.248,64	2.925.568,62	-3.436.394,38
NTEN11	3.214.193,64	24.025,79	22.944,78	0,04%	-21.732.554,06	30.945.324,32	26.061.791,42	-29.635.637,07
NTNB20240815 - 760199_NEGOCIACAO	21.102.287,18	45.046,63	-24.461,81	-0,05%	-1.188.056,02	1.542.588,77	1.386.766,07	-1.528.946,80
NTNB20250815 - 760199_NEGOCIACAO	9.879.105,15	26.905,31	-1.105,76	0,00%	-79.242.100,05	102.889.065,59	92.495.853,44	-101.979.160,12
NTNB20260815 - 760199_NEGOCIACAO	39.932.497,91	242.285,02	205.522,16	0,40%	-26.442.266,28	34.721.081,73	31.282.856,94	-33.705.019,02
NTNB20270815 - 760199_NEGOCIACAO	16.165.616,99	134.993,05	126.948,56	0,25%	-19.020,71	16.614,36	26.005,55	-32.835,06
NTNB20280815 - 760199_NEGOCIACAO	27.385.211,18	290.773,56	285.734,54	0,56%	-8.119,23	6.705,49	10.297,85	-14.334,13
NTNB20290815 - 760199_NEGOCIACAO	346.825,64	3.730,51	3.672,62	0,01%	-896.637,40	-399.184,14	92.536,07	-124.229,15
NTNB20300815 - 760199_NEGOCIACAO	10.508.539,78	182.123,61	172.288,12	0,34%	403.916,80	-403.916,80	169.183,44	-170.568,29
NTSD36	2.876.795,63	4.774,60	4.486,77	0,01%	91.479,38	-91.479,38	28.821,75	-27.041,30
OMGE13	4.054.181,69	2.160,46	2.036,35	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ONCO3	1.154.048,00	263.089,56	199.702,36	0,39%	-761,84	620,44	1.017,90	-1.495,38
OULG11	182.958,75	16.578,12	-14.284,89	-0,03%	-480.180,28	-118.428,17	117.450,85	-154.001,70
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-2.106.731,70	-2.106.731,70	617.693,73	-622.749,89
OVSA10	1.842.211,67	201,15	188,84	0,00%	19.209,59	-19.211,40	7.779,79	-7.843,47
PASN12	6.238.637,62	42.474,27	40.573,73	0,08%	-533.665,81	-81.730,00	171.799,54	-221.765,93
PATC11	4.213.463,40	85.048,95	-3.329,49	-0,01%	1.458.411,26	-1.760.106,69	855.212,36	-862.212,74
PCAR3	53.068,16	11.142,73	1.562,41	0,00%	3.241.969,06	-3.890.382,87	1.901.090,66	-1.916.652,11
PEJA11	4.996.914,69	63.617,58	60.751,15	0,12%	-135.735,14	-55.995,46	19.150,16	-25.926,96
PETRS	5.833.645,04	1.226.353,43	-536.915,77	-1,63%	0,00	0,00	0,00	0,00
PETRA	12.967.876,24	2.324.608,53	-1.417.500,92	-2,76%	20.190,55	-27.018,82	7.766,59	-7.830,16
PETRE421	0,00	0,00	0,00	0,00%	56.943,00	-56.943,00	27.826,15	-28.053,92
PETZ3	52.978,08	12.891,04	3.699,23	0,01%	11.278.972,80	-11.278.972,80	2.755.829,02	-2.778.396,97
PLPL3	189.810,00	44.011,39	40.690,47	0,08%	0,00	0,00	0,00	0,00
PRIO3	18.798.288,00	1.523.566,51	-134.345,10	-0,26%	0,00	0,00	0,00	0,00
PRLG14	1.152.245,89	0,00	0,00	0,00%	2.634.385,76	-2.634.385,76	772.401,90	-778.724,43
PVBH11	2.437.543,69	33.313,43	12.694,78	0,02%	-227.662,51	-101.972,45	22.289,24	-29.988,04
QAGR11	5.268.771,51	112.759,56	55.830,78	0,11%	552.471,72	-552.471,72	404.961,77	-408.276,60
QUAT12	3.554.239,09	17.046,62	14.232,03	0,03%	-1.524.098,70	-53.217,93	637.128,40	-787.662,20
RADL3	2.762.358,62	259.281,45	112.604,42	0,22%	7.777.452,82	-5.703.465,40	2.533.721,30	-2.554.461,17
RAHD11	11.908.859,51	233.276,06	216.640,26	0,42%	14.833,35	-14.833,35	6.213,06	-6.263,91
RAIL3	17.283.228,48	1.151.901,20	764.410,41	1,49%	0,00	0,00	0,00	0,00
RAIZ	42.381,00	3.943,41	3.029,93	0,01%	2.105.338,00	-2.105.338,00	308.642,55	-311.168,96
RBCAPMZ	547.011,59	5.127,73	399,35	0,00%	537.715,00	-537.715,00	157.658,04	-158.948,55
RBRP3	2.105.338,00	139.226,90	-82.216,74	-0,19%	0,00	0,00	0,00	0,00
RBRP11	1.075.430,20	45.258,60	22.646,00	0,04%	-1.982,86	1.605,22	2.573,77	-3.749,31
RCRB11	6.468.844,94	230.625,17	172.479,47	0,34%	352.396,20	-352.396,20	172.204,28	-173.613,86
RDCO10	3.860.910,19	527,71	495,53	0,00%	-4.996,35	4.244,15	6.553,12	-8.705,23
RDO3	1.174.654,00	102.620,34	237,30	0,00%	-7.144,78	6.069,14	9.370,97	-12.448,48
RDO39	1.112.671,13	1.289,66	1.215,38	0,00%	-954.264,83	-82.978,08	358.216,70	-450.118,64
RDO39C	1.591.119,72	1.844,21	1.737,99	0,00%	1.934.193,71	-1.934.193,71	472.588,00	-476.456,38
RDVE11	8.731.576,17	137.742,10	127.349,16	0,25%	3.920.211,79	-3.088.651,71	1.741.524,39	-1.755.779,71
RECV3	3.223.656,18	350.342,18	263.092,08	0,51%	-331.727,85	-36.165,44	119.802,45	-152.766,33
RENT3	11.879.429,67	960.936,73	49.917,41	0,10%	-117,64	98,87	172,44	-266,89
RIS412	2.778.612,63	48.265,46	44.286,08	0,09%	-1.810.714,68	50.402,35	849.342,56	-1.031.191,12
RLOG11	1.006.922,02	30,22	28,36	0,00%	19.486,49	16.374,84	25.157,50	-34.012,38
RMSA12	11.447.959,14	295.836,77	275.851,51	0,54%	449.367,26	-449.367,26	109.795,40	-110.694,14
RODB11	2.957.416,41	5.991,41	4.800,81	0,01%	-480,57	372,36	626,70	-826,39
RBRP3	748.945,43	97.802,08	-29.256,76	-0,06%	-937.621,71	-192.675,97	256.754,21	-333.689,67
RSAN24	1.850.256,40	118,01	110,78	0,00%	24.455,18	-24.455,18	17,95	-18.072,38
RSAN44	11.034.633,65	92.142,92	88.736,62	0,17%	357.708,04	-348.549,20	130.741,40	-131.811,59
SANB11	122.275,90	6.411,63	-1.353,22	0,00%	635.750,63	-635.770,53	372.815,84	-375.867,54
SBF3	891.824,00	162.847,45	117.171,20	0,23%	-273.586,76	-72.235,04	42.037,00	-56.722,51
SBS3	2.543.082,12	148.483,31	16.077,12	0,03%	-3.643,81	2.960,57	4.573,49	-6.522,12
SBS3C7	2.440.279,80	981,28	922,45	0,00%	103.192,80	-103.192,80	25.213,44	-25.419,83
SCAR3	171.988,00	12.610,25	5.597,43	0,01%	12.083,97	-12.083,97	5.905,03	-5.953,37
SLCE3	40.279,90	2.561,24	1.802,16	0,00%	1.400.117,20	-1.400.117,20	513.142,95	-517.343,31
SMFT3	3.500.293,00	352.020,38	222.306,48	0,43%	13.019,89	-13.020,04	6.362,38	-6.414,46
SMT03	43.399,62	5.080,16	728,19	0,00%	-216,64	180,48	310,74	-461,41
SNGO18	1.333.033,37	55,97	52,54	0,00%	713.735,49	-713.735,49	348.778,74	-351.633,68
SOMA3	2.379.118,29	445.804,23	387.860,05	0,76%	0,00	0,00	0,00	0,00

</

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – ABRIL 2024



bradesco

Data: 30/04/2024

Relatório de Risco de Mercado

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

Dados Gerais				Limite Fundo:		0,00% Dutation DC:		1.642,99	
PL:	4.797.663,841,57	VAR / PL:	1,0702%	Status:	ENQUADRADO	Dutation DU:			1.131,16
VAR:	51.346.913,93	ETL / PL:	1,3421%	Benchmark:					
ETL:	64.391.101,59	VAR / CDI:	0,0117%						

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	147.471.723,74	Cenário Baixa - 10000 (+):	286.193.605,27	CENARIO BRADESCO 1 (+):	430.513.300,55	CENARIO BRADESCO 2 (+):	17.245.176,78
Cenário Alta - 09999 (-):	-239.794.099,02	Cenário Baixa - 10000 (-):	-212.445.482,02	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-161.189.969,94	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-319.348.702,68
Cenário Alta - 09999:	-92.322.375,28	Cenário Baixa - 10000:	73.748.123,26	CENARIO BRADESCO 1:	269.323.330,62	CENARIO BRADESCO 2:	-302.103.525,90

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
SRNA3	862.278,00	108.509,44	53.139,14	0,10%	2.720.143,80	-2.176.115,04	1.695.092,32	-1.608.149,02
SUZB3	10.880.575,20	1.381.021,85	953.139,51	1,86%	26.247,71	-26.247,71	15.391,65	-15.517,64
ITAE11	104.990,82	4.998,94	-1.006,26	0,00%	-88.099,24	-30.316,31	14.939,90	-20.191,94
TBSP11	2.615.786,01	778,06	732,45	0,00%	-2.907,83	2.373,75	3.679,00	-5.231,95
TCH11	10.275.489,93	193.483,09	181.553,04	0,35%	-1.293.148,36	-30.095,18	553.074,42	-678.863,20
TEPP11	4.285.181,05	170.766,49	98.980,90	0,19%	2.142.690,53	-2.142.690,53	628.207,54	-633.349,76
TIMS3	1.226.061,03	87.983,44	65.111,47	0,13%	392.339,53	-281.994,04	179.740,55	-181.211,82
TOTS3	166.096,72	11.923,80	4.377,85	0,01%	31.218,78	-31.219,34	22.883,78	-23.071,10
TRPL4	231.821,48	16.094,59	-7.880,76	-0,02%	46.364,30	-57.955,37	33.985,03	-34.263,22
TRXF11	9.326.230,20	175.501,11	102.988,30	0,20%	4.663.115,10	-4.663.115,10	1.367.225,35	-1.378.416,82
TRXF13	1.414.545,48	26.618,93	15.620,63	0,03%	-1.401.746,48	-1.401.746,48	0,00	0,00
UGPA3	12.107.054,30	1.362.405,22	1.148.343,59	2,24%	3.026.763,58	-2.421.410,86	1.774.894,16	-1.789.422,63
UNEG11	14.483.697,91	349.106,61	316.610,76	0,62%	-2.050.050,46	7.732,30	922.310,68	-1.135.148,81
USIM5	176.258,53	35.056,59	27.214,16	0,05%	68.740,83	-38.776,88	25.839,50	-26.051,01
UTPS21	6.338.981,40	134.241,73	121.373,37	0,24%	-823.675,26	-41.001,87	394.934,84	-420.427,66
VALES3	16.764.698,23	1.876.321,92	-1.531.707,71	-2,98%	4.191.174,56	-4.191.174,56	2.457.704,76	-2.477.822,40
VAM022	1.069.735,66	84,33	79,20	0,00%	-317,38	258,14	417,59	-611,69
VAM03	33.665,85	4.919,37	3.397,80	0,01%	11.783,05	-13.466,34	4.935,41	-4.975,81
VAM033	4.143.609,72	56.255,42	54.181,76	0,11%	-451.708,89	-55.749,31	153.855,84	-198.503,22
VAM034	7.153.928,99	104.288,85	99.393,59	0,19%	-799.832,73	-91.056,08	278.293,96	-358.273,38
VBBR3	4.074.697,02	438.580,00	359.748,11	0,70%	1.018.674,26	-1.018.674,26	597.350,58	-602.240,22
VCCS11	2.329.653,08	6.191,92	5.819,14	0,01%	-24.282,75	20.911,66	32.297,63	-42.039,22
VECS11	3.574.701,09	85,23	79,67	0,00%	-340,14	289,82	520,44	-776,52
VERDECS2	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
VERO12	8.196.243,76	72.288,83	69.194,23	0,13%	-750.726,86	-151.797,05	208.536,02	-272.965,33
VIMT13	9.032.265,68	164.735,63	150.126,52	0,29%	-1.069.877,51	-80.617,37	413.911,77	-520.841,55
VIVA3	1.327.384,00	260.164,21	103.583,59	0,20%	427.027,10	-382.701,10	194.594,49	-196.187,36
VIVT3	2.336.229,00	171.753,74	130.821,31	0,25%	361.779,92	-342.044,85	342.491,17	-345.294,65
VIXL14	2.138.737,95	181,10	170,14	0,00%	-682,62	928,12	928,12	-1.369,58
VRDN12	9.970.370,97	155.624,45	143.315,78	0,28%	-1.106.607,77	-131.563,41	390.162,65	-496.945,92
VVMR11	4.052.142,50	121.648,54	87.587,93	0,17%	0,00	0,00	0,00	0,00
VVRT11	2.583.396,78	452,43	425,58	0,00%	-1.690,15	1.374,76	2.155,98	-3.099,70
WDOM24	-90.228,50	177.402,95	136.070,13	0,27%	-604.264,11	614.801,94	-782.329,67	787.342,23
WEGE3	3.616.807,95	290.256,75	75.313,34	0,15%	904.201,99	-904.201,99	530.224,05	-534.564,22
WINM24	-20.768,00	42.943,86	14.188,97	0,03%	369.034,58	-368.375,62	291.898,44	-293.413,66
XPIN11	2.396.563,20	78.776,79	-3.358,66	-0,01%	1.198.281,60	-1.198.281,60	351.336,17	-354.212,04
XPPR11	2.133.259,20	439.078,92	353.204,29	0,69%	1.066.629,60	-1.066.629,60	312.735,80	-315.295,71
YDUQ3	3.207.889,71	790.910,60	614.292,06	1,20%	1.333.593,43	-757.448,71	470.276,49	-474.125,95
Total Var:	4.873.199.815,94	99.187.106,40	51.346.913,93	99,89%	-92.322.375,27	73.748.123,26	269.323.330,61	-302.103.525,90

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: **EMBRAERPREV RENDA FIXA**
CNPJ: **10679245000140**

Dados Gerais				Limite Fundo:		0,00% Dutation DC:		1.920,70	
PL:	3.910.764.692,85	VAR / PL:	0,9426%	Status:	ENQUADRADO	Dutation DU:			1.322,23
VAR:	36.860.969,76	ETL / PL:	1,1820%	Benchmark:					
ETL:	46.225.143,18	VAR / CDI:	0,0103%						

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	0,00	Cenário Baixa - 10000 (+):	203.768.372,02	CENARIO BRADESCO 1 (+):	202.881.060,88	CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00
Cenário Alta - 09999 (-):	-217.913.241,42	Cenário Baixa - 10000 (-):	-5.963.697,36	CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-230.350.424,66
Cenário Alta - 09999:	-217.913.241,42	Cenário Baixa - 10000:	197.804.774,66	CENARIO BRADESCO 1:	202.881.060,88	CENARIO BRADESCO 2:	-230.350.424,66

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
GABA	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
FI RF EMB II	3.047.931.456,96	28.798.706,08	28.669.771,98	77,78%	-156.124.160,68	194.426.289,69	175.746.370,12	-197.272.119,29
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	133.414.825,69	709.113,56	616.536,23	1,67%	-7.154.546,33	-1.785.248,03	1.573.250,59	-2.074.139,83
FIM EMB II A	233.156.949,85	398.726,56	331.672,05	0,90%	-1.768.018,12	2.121.299,75	1.729.649,84	-2.380.652,97
FIM EMB VII A CRED PRIV	276.795.272,52	2.460.812,68	2.264.581,02	6,14%	-13.631.728,17	7.220.782,56	9.738.622,06	-10.823.995,85
FIM EMB VII A CRED PRIV	368.232.135,05	5.289.498,69	4.978.408,48	13,51%	-39.234.788,12	-4.178.349,34	14.093.169,29	-17.799.516,73
Total Var:	4.059.532.640,07	37.656.857,58	36.860.969,76	100,00%	-217.913.241,42	197.804.774,66	202.881.060,88	-230.350.424,66

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – ABRIL 2024



Relatório de Risco de Mercado

Data: 30/04/2024

FUNDO: EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL
 CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais					
PL:	505.566.886,29	VAR / PL:	3,0946%	Limite Fundo:	0,00%
VAR:	15.645.303,09	ETL / PL:	3,8808%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	19.619.841,26	VAR / CDI:	0,034%	Benchmark:	
				Dutacion DC:	3,12
				Dutacion DU:	1,78

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	125.147.497,78	Cenário Baixa - 10000 (+):	0,00	CENARIO BRADESCO 1 (+):	64.830.299,40
Cenário Alta - 09999 (-):	0,00	Cenário Baixa - 10000 (-):	-120.543.097,66	CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00
Cenário Alta - 09999:	125.147.497,78	Cenário Baixa - 10000:	-120.543.097,66	CENARIO BRADESCO 1:	64.830.299,40
				CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	-65.361.438,43
				CENARIO BRADESCO 2:	-65.361.438,43

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

Produto	MtM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
CAIXA	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
FIA RVA EMB II	107.327.297,39	2.124.074,75	1.441.918,69	9,22%	28.776.643,59	-27.546.412,65	15.364.838,85	-15.489.912,25
FIA RVA EMB III	108.436.814,60	7.571.599,70	6.893.995,91	44,06%	30.031.705,84	-28.206.437,38	13.451.647,63	-13.563.861,70
FIA RVA EMB IV	103.628.389,23	5.339.712,52	4.994.761,28	31,92%	29.761.630,79	-28.469.539,47	14.139.887,57	-14.255.984,90
FIC FIA EMB VIII ETF	70.697.250,17	1.502.990,98	1.100.142,54	7,03%	6.349.352,66	-6.349.352,64	5.171.200,99	-5.213.532,96
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	115.486.165,75	2.338.451,93	1.214.484,67	7,78%	30.228.164,90	-29.971.355,52	16.702.724,37	-16.838.347,03
Total Var:	505.566.717,13	18.876.799,78	15.645.303,09	99,99%	125.147.497,78	-120.543.097,66	64.830.299,40	-65.361.438,43

Relatório de Risco de Mercado

Data: 30/04/2024

FUNDO: FI RF EMB II
 CNPJ: 11005764000196

Dados Gerais					
PL:	2.994.276.145,83	VAR / PL:	0,9618%	Limite Fundo:	0,00%
VAR:	28.798.809,80	ETL / PL:	1,2081%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	36.114.869,33	VAR / CDI:	0,0106%	Benchmark:	
				Dutacion DC:	2,151,87
				Dutacion DU:	1,480,97

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	0,00	Cenário Baixa - 10000 (+):	195.363.040,27	CENARIO BRADESCO 1 (+):	175.747.003,03
Cenário Alta - 09999 (-):	-156.124.722,92	Cenário Baixa - 10000 (-):	-936.050,40	CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00
Cenário Alta - 09999:	-156.124.722,92	Cenário Baixa - 10000:	194.426.989,87	CENARIO BRADESCO 1:	175.747.003,03
				CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	-197.272.829,71
				CENARIO BRADESCO 2:	-197.272.829,71

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
CSMGC3	8.371.953,78	17.044,52	4.714,32	0,02%	0,00	0,00	0,00	0,00
ELET42	14.894.194,57	124.019,59	107.877,75	0,37%	0,00	0,00	0,00	0,00
ENTV12	13.829.731,87	140.651,56	128.990,54	0,45%	-28.299,90	28.863,71	101.726,49	-154.835,37
GASP17	50.303.441,61	1.184.119,01	867.429,89	3,01%	0,00	0,00	0,00	0,00
IGSN15	2.666.952,52	38.761,93	34.685,93	0,12%	-278.411,48	-118.598,68	25.909,82	-35.007,56
NEOE16	7.638.700,36	65.777,84	57.700,72	0,20%	0,00	0,00	0,00	0,00
NTNB20240815 - 760199_VENCIMENTO	126.142.115,66	269.273,05	-149.685,17	-0,52%	-1.354.491,15	-294.176,82	362.909,16	-476.754,22
NTNB20260815 - 760199_VENCIMENTO	42.905.875,05	260.325,59	193.758,96	0,67%	-1.342.902,34	-238.076,30	399.439,62	-520.166,08
NTNB20300815 - 760199_VENCIMENTO	26.273.567,42	303.053,65	293.016,82	1,02%	-1.280.334,94	1.503.946,02	1.102.362,53	-1.452.676,70
NTNB20350515 - 760199_VENCIMENTO	236.985.742,69	3.156.799,23	3.130.142,36	10,87%	-285.660,48	-38.239,88	97.252,28	-124.153,89
NTNB20400815 - 760199_VENCIMENTO	29.062.770,61	417.775,11	416.617,99	1,45%	-711.126,19	-152.468,43	192.749,99	-252.969,65
NTNB20450515 - 760199_VENCIMENTO	225.097.996,34	3.397.363,20	3.381.718,35	11,74%	-536.172,11	551.036,32	439.693,64	-594.231,96
NTNB20500815 - 760199_VENCIMENTO	700.908.665,73	12.147.455,52	12.105.582,64	42,04%	-1.035.184,70	1.053.648,98	851.159,22	-1.127.648,87
NTNB20550515 - 760199_VENCIMENTO	223.904.777,42	4.052.915,73	4.040.533,85	14,03%	-1.371.276,35	1.425.457,87	1.285.670,17	-1.638.894,13
PETR45	9.625.390,03	39.821,27	-1.409,36	0,00%	-17.400.063,17	19.160.367,08	18.079.110,87	-22.081.251,09
SBSPC2	4.909.817,29	11.097,56	1.500,46	0,01%	-2.793.257,34	3.084.248,64	2.925.568,62	-3.436.394,38
BBTOPIND	334.570.932,07	4.290.564,57	4.182.806,28	14,52%	-21.732.554,06	30.945.324,32	26.061.791,42	-29.635.637,07
CAIXA	5.000,00	0,00	0,00	0,00%	-79.242.100,05	102.889.065,59	92.495.853,44	-101.979.160,12
COMPROMISSADA_PRE	989.961.551,97	14.563,30	2.827,49	0,01%	-26.442.266,28	34.721.081,73	31.282.856,94	-33.705.019,02
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-116.745,70	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-135.735,14	-53.595,46	19.150,16	-25.926,98
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-154.887,27	-40.894,85	23.798,65	-32.112,64
Total Var:	3.047.942.433,26	29.931.382,24	28.798.809,80	100,01%	-156.124.722,91	194.426.989,87	175.747.003,03	-197.272.829,71

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – ABRIL 2024



Relatório de Risco de Mercado

Data: 30/04/2024

FUNDO: FI RF EMB V CREDITO PRIVADO
CNPJ: 20726178000121

Dados Gerais							
PL:	128.842,157,28	VAR / PL:	0,5504%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	678,81
VAR:	709.113,56	ETL / PL:	0,6902%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	468,56
ETL:	889.257,02	VAR / CDI:	0,006%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	0,00	Cenário Baixa - 10000 (+):	311.176,59	CENARIO BRADESCO 1 (+):	1.573.250,59	CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00
Cenário Alta - 09999 (-):	-7.154.546,33	Cenário Baixa - 10000 (-):	-2.096.424,61	CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-2.074.139,83
Cenário Alta - 09999:	-7.154.546,33	Cenário Baixa - 10000:	-1.785.248,03	CENARIO BRADESCO 1:	1.573.250,59	CENARIO BRADESCO 2:	-2.074.139,83

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	7.215.057,35	31.604,73	29.867,13	4,21%	-419.848,78	-142.086,34	71.406,89	-95.233,03
AEGP23	15.558.385,75	41.485,68	23.497,99	3,31%	-545.692,67	-260.593,26	38.852,90	-62.625,79
CCRDD1	3.269.057,98	6.099,90	2.104,91	0,30%	0,00	0,00	0,00	0,00
CMDT33	709.056,89	1.602,67	777,51	0,11%	-70.495,67	-19.391,00	12.757,99	-17.231,57
ENJG21	1.700.158,14	6.689,24	6.265,74	0,88%	-22.368,22	-5.905,88	3.436,91	-4.637,58
ENMI21	1.085.710,27	4.460,77	4.183,61	0,59%	-15,04	15,34	54,07	-82,30
ENTV12	18.180.335,03	184.898,20	171.751,95	24,22%	0,00	0,00	0,00	0,00
ERDV17_VENCIMENTO	13.625.526,63	40.475,43	23.970,75	3,38%	0,00	0,00	0,00	0,00
ERDV36	2.179.556,17	4.225,99	1.400,37	0,20%	-91.562,37	-32.775,91	14.357,69	-19.171,72
GASP17	10.407.608,61	244.990,14	213.450,49	30,10%	-60.499,24	-21.622,45	9.539,40	-12.735,51
GRRB24_VENCIMENTO	16.849.001,68	142.064,38	129.905,55	18,32%	-1.765.357,03	-312.971,13	525.096,66	-683.801,66
LFSN16000GM	15.327.371,67	32.703,13	5.617,59	0,79%	-446.163,46	-223.426,77	24.743,16	-33.462,91
LFSN18000DC5	5.143.047,18	23.761,41	19.978,73	2,82%	-48.133,49	-13.153,97	8.755,96	-11.626,27
OMGE31	13.783.745,75	77.761,22	69.673,12	9,83%	-264.896,89	311.161,25	228.075,01	-300.553,80
SBSPC2	3.762.690,47	8.504,73	4.125,97	0,58%	-1.554.308,36	-341.895,64	415.106,04	-545.154,24
TAE33	4.324.189,24	8.468,00	2.540,88	0,36%	-435.772,71	-105.277,23	73.144,30	-98.705,55
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	-323.976,28	-156.484,40	22.209,26	-29.986,95
COMPROMISSADA_PRE	526.214,29	7,74	1,28	0,00%	-896.637,40	-399.184,14	92.536,07	-124.229,15
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-32.887,42	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-118.699,50	-31.340,20	18.238,35	-24.609,86
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-88.099,24	-30.316,31	14.939,90	-20.191,94
Total Var:	133.414.825,67	859.803,36	709.113,56	100,00%	-7.154.546,33	-1.785.248,03	1.573.250,59	-2.074.139,83

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – ABRIL 2024



bradesco

Data: 30/04/2024

Relatório de Risco de Mercado

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

Dados Gerais		Limite Fundo:		0,00% Dutation DC:		1.011,81	
PL:	260.936.039,71	VAR / PL:	0,9431%	Status:	ENQUADRADO	Dutation DU:	697,74
VAR:	2.460.812,68	ETL / PL:	1,1826%	Benchmark:			
ETL:	3.085.958,38	VAR / CDI:	0,0103%				

Cenários do STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	251.982,83	Cenário Baixa - 10000 (+):	10.879.911,01	CENARIO BRADESCO 1 (+):	17.636.758,89	CENARIO BRADESCO 2 (+):	242.201,53
Cenário Alta - 09999 (-):	-13.883.711,00	Cenário Baixa - 10000 (-):	-3.659.128,43	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-7.898.136,83	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-11.066.197,38
Cenário Alta - 09999:	-13.631.728,17	Cenário Baixa - 10000:	7.220.782,58	CENARIO BRADESCO 1:	9.738.622,06	CENARIO BRADESCO 2:	-10.823.995,85

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
020913	1.023.678,63	32.611,63	-17.102,55	-0,69%	0,00	0,00	0,00	0,00
AEGP1	1.882.112,39	1.542,25	1.429,29	0,06%	-5.811,38	4.814,29	7.386,82	-10.221,71
APRB28	1.168.666,76	84,87	79,78	0,00%	-316,58	256,49	403,62	-582,73
ARTRA1	2.577.813,10	311,12	295,00	0,01%	-1.165,21	946,45	1.499,38	-2.175,55
BCBF15	2.098.700,15	89,40	85,25	0,00%	-346,79	282,61	467,12	-692,53
BKBR18	2.524.319,38	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
BRELETRO	1.673.398,32	26.340,66	16.188,31	0,66%	0,00	0,00	0,00	0,00
BRKP10	3.252.036,24	1.272,89	1.193,50	0,05%	-4.703,33	3.798,86	5.860,00	-8.415,21
CAEC11	2.524.151,45	121,93	115,96	0,00%	-463,27	381,51	637,73	-943,34
CAIXA	10.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CART13	991.968,57	16.805,28	14.384,28	0,58%	-112.019,85	-12.750,10	39.876,27	-50.713,47
CBAN22	6.326.710,80	32.265,10	28.635,16	1,16%	-121.342,97	105.285,44	156.861,04	-200.896,26
CEAB22	1.724.113,03	545,96	510,89	0,02%	-2.035,35	1.659,85	2.565,99	-3.648,89
CELG12	2.463.630,48	176,12	167,33	0,01%	-679,35	554,06	915,27	-1.351,71
CGBP13	2.493.591,69	1.251,42	1.161,76	0,05%	-4.713,44	3.897,06	5.982,12	-8.304,19
CLH12	2.473.143,47	4.039,33	3.703,28	0,15%	-15.599,07	13.205,10	20.371,27	-27.186,32
COMPROMISSADA_PRE	29.430.252,55	432,95	149,38	0,01%	-841,32	858,08	3.024,20	-4.603,05
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-108.768,89	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CSAN23	1.122.278,42	1.357,15	1.241,12	0,05%	-5.257,82	4.465,40	6.894,82	-9.161,54
CSMG88	2.809.359,65	25.556,72	24.808,47	1,01%	-260.681,80	-52.210,64	72.974,44	-95.416,31
DAPK25	-26.908,06	153.223,04	-23.009,25	-0,94%	-723.623,36	673.435,07	494.921,00	-693.617,64
DAPK27	-157.788,28	372.017,25	367.508,79	14,93%	-1.382.645,86	1.220.018,22	1.218.754,21	-1.189.820,35
DAPK29	-27.035,18	90.504,44	86.497,81	3,52%	-385.872,29	335.976,56	372.759,98	-356.369,41
DAPK35	14.267,35	19.975,12	-18.201,53	-0,74%	105.706,69	-97.170,80	-114.702,20	102.742,05
DAPQ24	-4.652,88	152.102,22	-53.370,34	-2,17%	-205.619,80	195.429,75	183.623,98	-184.446,30
DAPQ26	-195.342,94	436.347,62	404.559,99	16,44%	-1.759.936,55	1.557.011,74	1.510.926,94	-1.486.700,34
DAPQ28	-127.423,18	344.284,16	337.143,72	13,70%	-1.357.464,30	1.196.947,39	1.267.740,84	-1.221.256,98
DAPQ30	10.097,04	30.746,47	-29.111,02	-1,19%	142.015,17	-124.621,06	-138.225,40	131.385,86
DAPQ32	-11.787,58	21.754,71	20.232,35	0,82%	-106.545,54	94.639,29	109.732,77	-101.246,16
DASAA2	1.359.856,31	0,81	0,68	0,00%	-4,05	4,13	14,11	-21,44
DESK13	2.798.206,50	1.054,89	984,37	0,04%	-3.947,81	3.234,53	4.988,04	-7.033,48
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DHF26	-40.786,80	112.727,40	105.460,52	4,29%	-417.745,68	316.057,57	494.169,18	-712.265,02
DHF27	-45.985,38	137.618,48	127.443,81	5,18%	-514.853,61	403.157,11	619.698,87	-862.648,30
DHF29	-2.706,13	8.013,46	7.200,42	0,29%	-31.827,78	26.510,15	41.700,53	-53.953,31
DHN26	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ELET24	2.678.539,43	1.171,99	1.090,92	0,04%	-4.373,51	3.589,70	5.500,04	-7.716,94
GUAR15	2.728.237,50	536,12	504,56	0,02%	-1.996,15	1.615,88	2.532,63	-3.662,98
HAPV22	565.147,26	343,94	318,76	0,01%	-1.293,18	1.069,90	1.635,17	-2.262,99
HZTC14	2.519.949,54	39.141,69	35.553,26	1,44%	-276.412,79	-31.651,46	98.181,52	-124.705,36
IDIV24P410000	79,17	410,45	391,49	0,02%	-79,17	273.725,69	818.708,35	-79,17
IDIV24P410100	-161,07	789,81	-753,32	-0,03%	161,07	-299.731,59	-845.085,14	161,07
IDIV24P410200	-2.469,64	11.412,69	-10.886,35	-0,44%	2.469,64	-2.840.557,28	-6.795.551,35	2.469,64
IDIV24P410300	2.939,20	12.754,02	12.164,81	0,49%	-2.939,20	1.721.380,98	4.392.469,42	-2.939,20
IDIV24P410400	3.092,70	12.653,46	12.069,90	0,49%	-3.092,70	1.095.769,10	2.662.714,86	-3.092,70
IGTA17	2.080.650,02	289,59	-276,02	-0,01%	1.080,11	-979,70	-1.883,78	2.870,52
INSSN11	1.085.242,85	162.656,05	93.661,41	3,81%	0,00	0,00	0,00	0,00
IRJ514	3.221.393,64	84.415,32	76.814,44	3,12%	-519.321,33	20.261,27	247.627,34	-299.657,17
IVIA18	2.693.114,10	172,97	164,05	0,01%	-652,50	529,67	856,88	-1.260,33
JSMLE5	3.275.846,45	46.294,13	43.785,85	1,78%	-360.846,94	-42.137,82	124.566,05	-160.481,67
LCAMD1	7.480.931,33	109.208,03	103.044,52	4,19%	-838.664,86	-93.181,82	293.210,59	-377.529,52
LF001800FAU	4.651.674,83	44.317,37	41.960,38	1,71%	-480.533,04	-108.062,32	128.285,87	-168.601,97
LF002200IO9	2.550.129,98	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306ZBP	5.406.474,11	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306ZK1	5.423.618,80	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFSC190054B	931.626,65	0,00	0,00	0,00%	142,29	-145,32	-446,48	679,98
LFSC190059S	1.411.101,45	0,00	0,00	0,00%	225,94	-230,80	-700,19	1.066,38
LFSC19005L1	933.489,41	0,00	0,00	0,00%	183,91	-188,10	-542,32	826,04
LFSC22002IX	4.873.651,83	2.200,24	2.060,31	0,08%	-8.091,82	6.589,94	10.221,74	-14.638,15
LFNS210029N	4.595.270,42	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFNS2301ERT	4.464.986,23	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20240901 - 210100	1.240.391,79	83,78	-5,59	0,00%	-940,72	1.072,38	0,00	0,00
LFT20250901 - 210100	20.564.700,01	2.025,93	-205,70	-0,01%	-74.608,80	112.455,84	1.312,79	-1.998,52
LIGHB4	4.080.342,06	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LIGHD3	978.208,65	456,57	424,78	0,02%	-1.704,11	1.399,40	2.139,84	-2.996,37
LMP17	2.750.221,66	462,83	437,56	0,02%	-1.737,97	1.398,49	2.238,22	-3.279,16
LRENB1	688.924,60	5,14	4,87	0,00%	-19,71	19,08	40,27	-60,71
MANT12	2.504.657,24	2.425,26	2.235,63	0,09%	-9.266,32	7.766,85	11.946,29	-16.214,05
MOVI27	1.158.549,91	1.125,81	1.043,14	0,04%	-4.243,42	3.516,44	5.390,72	-7.453,72
MTRJ19	2.856.240,54	27.543,98	26.590,51	1,08%	-257.625,73	-48.738,77	74.857,73	-97.151,36
NTEN11	3.214.193,64	24.025,79	23.336,97	0,95%	-262.670,47	-64.043,69	65.100,41	-85.334,05
NTNB20240815 - 760199_NEGOCIACAO	6.538.193,41	13.956,95	-5.830,94	-0,24%	-27.790,85	28.561,29	22.790,18	-30.800,21
NTNB20250515 - 760199_NEGOCIACAO	11.168,68	1.664,49	307,95	0,01%	-8.938,83	8.868,30	5.612,89	-7.532,75
NTNB20260815 - 760199_NEGOCIACAO	26.271.267,29	159.397,36	152.099,38	6,18%	-633.843,59	645.149,27	521.164,79	-690.450,40
NTNB20270515 - 760199_NEGOCIACAO	5.064.454,96	42.296,61	41.837,94	1,70%	-149.884,93	156.156,90	128.247,90	-168.640,10
NTNB20280815 - 760199_NEGOCIACAO	9.998.657,22	106.164,79	104.153,98	4,23%	-384.654,02	416.255,36	353.717,91	-459.310,09
NTNB20250815 - 760199_NEGOCIACAO	883.424,08	16.310,63	13.063,27	0,53%	-99.876,61	129.681,20	116.581,62	-128.534,36
NTSD36	2.876.795,63	4.774,60	4.305,35	0,17%	-19.020,71	16.614,36	26.005,55	-32.839,06
OMGE13	3.135.173,24	1.670,72	1.551,70	0,06%	-6.278,75	5.185,48	7.963,52	-11.084,85
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
OVSA10	1.842.211,67	201,15	190,51	0,01%	-761,84	620,44	1.611,90	-1.495,38
PASN12	1.932.793,73	13.567,46	13.148,49	0,53%	-153.382,89	-37.829,24	37.517,06	-49.192,41
RAHD11	3.306.226,29	64.763,84	58.731,14	2,39%	-423.131,63	-14.774,76	176.884,33	-218.676,65

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – ABRIL 2024



bradesco

Data: 30/04/2024

Relatório de Risco de Mercado

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

Dados Gerais

PL:	260.936.039,71	VAR / PL:	0,9431%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	1.011,81
VAR:	2.460.812,68	ETL / PL:	1,1826%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	697,74
ETL:	3.085.958,38	VAR / CD:	0,0103%	Benchmark:			

Cenários de STRESS

Cenário Alta - 09999 (+):	251.982,83	Cenário Baixa - 10000 (+):	10.879.911,01	CENARIO BRADESCO 1 (+):	17.636.758,89	CENARIO BRADESCO 2 (+):	242.201,53
Cenário Alta - 09999 (-):	-13.883.711,00	Cenário Baixa - 10000 (-):	-3.659.128,43	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-7.898.136,83	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-11.066.197,38
Cenário Alta - 09999:	-13.631.728,17	Cenário Baixa - 10000:	7.220.782,58	CENARIO BRADESCO 1:	9.738.622,06	CENARIO BRADESCO 2:	-10.823.995,85

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
RBCAPMZ	547.011,59	5.127,73	-51,20	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
RDCO10	3.860.910,19	527,71	497,76	0,02%	-1.982,86	1.605,22	2.573,77	-3.749,31
RDORB9	1.112.671,13	1.289,66	1.179,31	0,05%	-4.996,35	4.244,15	6.553,12	-8.705,23
RDORC9	1.591.119,72	1.844,21	1.686,41	0,07%	-7.144,78	6.069,14	9.370,97	-12.448,48
RIS412	2.778.612,63	48.265,46	43.504,11	1,77%	-331.727,85	-36.165,44	119.802,45	-152.766,33
RLOG11	1.006.922,02	30,22	28,85	0,00%	-117,64	98,87	172,44	-256,89
RODB11	2.957.416,41	5.091,41	4.682,61	0,19%	-19.486,49	16.374,84	25.157,50	-34.012,38
RSAN24	1.850.256,40	118,01	112,12	0,00%	-450,57	372,36	626,70	-926,35
RSAN44	895.204,08	7.475,26	7.268,56	0,30%	-76.028,98	-15.631,18	20.748,51	-27.071,16
SNGO18	1.333.033,37	55,97	53,33	0,00%	-216,84	180,48	310,74	-461,41
TBSP11	2.615.786,01	778,06	728,16	0,03%	-2.907,83	2.373,75	3.679,00	-5.231,95
UNEG11	4.637.270,96	111.774,07	98.474,93	4,00%	-656.368,25	2.475,67	296.297,80	-363.442,59
VAMO33	2.848.649,60	38.674,48	36.901,20	1,50%	-310.540,91	-38.328,55	105.772,84	-136.467,03
VCCS11	2.329.653,08	6.191,92	5.691,84	0,23%	-24.282,75	20.911,66	32.297,63	-42.039,22
VECS11	3.574.701,09	85,23	81,34	0,00%	-340,14	289,82	520,44	-776,52
VERDECS2	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
VIXL14	2.138.737,95	181,10	171,94	0,01%	-682,62	560,11	928,12	-1.369,58
VVRT11	2.583.396,78	452,43	425,03	0,02%	-1.690,15	1.374,76	2.155,98	-3.099,70
Total Var:	276.795.272,52	3.262.831,18	2.460.812,68	99,99%	-13.631.728,17	7.220.782,57	9.738.622,05	-10.823.995,85

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – ABRIL 2024



bradesco

Data: 30/04/2024

Relatório de Risco de Mercado

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

Dados Gerais	
PL: 308.142.660,25	VAR / PL: 1,7141%
VAR: 5.281.970,10	ETL / PL: 2,1496%
ETL: 6.623.803,60	VAR / CDI: 0,0188%
Limite Fundo: 0,00%	Dutacion DC: 1,872,20
Status: ENQUADRADO	Dutacion DU: 1,289,46
Benchmark:	

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+): 0,00	Cenário Baixa - 10000 (+): 136.181,35	CENARIO BRADESCO 1 (+): 14.073.109,33	CENARIO BRADESCO 2 (+): 0,00		
Cenário Alta - 09999 (-): -39.178.944,87	Cenário Baixa - 10000 (-): -4.308.583,61	CENARIO BRADESCO 1 (-): 0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-): -17.774.182,51		
Cenário Alta - 09999: -39.178.944,87	Cenário Baixa - 10000: -4.172.402,25	CENARIO BRADESCO 1: 14.073.109,33	CENARIO BRADESCO 2: -17.774.182,51		

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	10.890.174,42	209.186,04	208.414,39	3,95%	-1.342.528,66	-58.867,98	552.748,33	-685.845,51
ANET11	1.915.528,42	11.124,31	9.826,33	0,19%	-137.149,62	-39.455,56	29.229,22	-38.651,14
APPSA2	3.354.414,67	43.999,17	43.649,63	0,83%	-363.153,23	-48.027,42	121.176,47	-156.561,03
ASAB11	6.380.002,11	75.664,24	75.582,03	1,43%	-621.853,14	-103.106,38	196.449,19	-252.584,65
ASER12	2.737.758,58	72.794,69	72.480,23	1,37%	-447.117,26	20.905,54	215.885,34	-260.316,27
BRKP28	10.440.838,39	238.513,87	234.893,89	4,45%	-1.417.240,87	-119.609,26	549.883,76	-694.940,11
BTOW15	5.442.132,00	106.216,70	105.939,65	2,01%	-686.040,66	-19.399,08	276.781,54	-354.306,44
CAEC21	9.117.399,74	71.175,79	63.086,85	1,19%	-805.450,31	-200.186,49	197.965,32	-260.960,46
CABA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CART13	10.412.926,29	161.131,76	160.914,17	3,05%	-1.142.020,52	-129.984,81	406.530,80	-517.013,89
CBAN32	16.289.842,08	267.319,87	266.989,98	5,05%	-1.903.021,31	-216.635,67	677.776,27	-864.942,42
CBAN72	4.779.312,48	83.583,48	83.337,85	1,58%	-574.019,60	-60.124,42	208.963,22	-266.142,88
CJEN13	7.179.867,70	112.507,65	112.308,94	2,13%	-793.649,64	-88.948,16	283.451,08	-359.648,40
CNRD11	10.171.314,84	192.662,45	191.389,80	3,62%	-1.235.750,80	-101.678,63	472.667,29	-596.312,17
COMPROMISSADA_PRE	9.236.077,43	135,87	33,50	0,00%	-264,03	269,29	949,08	-1.444,57
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	665.723,38	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CONX12	9.523.196,96	76.052,21	69.441,59	1,31%	-843.752,04	-211.431,37	208.158,27	-273.722,91
CREDZM24	210.806,29	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CRMG15	9.475.762,30	85.805,32	83.524,91	1,58%	-828.904,86	-169.141,92	230.223,68	-299.472,27
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ERDV17	10.151.017,34	30.154,20	10.038,55	0,19%	-333.896,68	-166.452,94	18.433,67	-24.929,87
ERDV38	5.881.916,54	31.630,03	21.518,38	0,41%	-323.516,07	-116.189,60	44.217,55	-59.432,84
GBSP11	9.210.893,33	219.053,59	218.031,57	4,13%	-1.402.492,61	59.347,54	669.206,14	-805.474,07
GRRB24	9.585.378,00	81.791,14	73.969,68	1,40%	-894.866,46	-196.840,57	238.990,20	-313.863,23
HARG11	10.001.287,57	192.574,45	191.405,29	3,62%	-1.212.456,11	-68.660,33	485.183,35	-607.416,93
HVRD15	11.400.539,17	210.594,11	210.113,22	3,98%	-1.429.443,60	-121.991,10	539.959,01	-684.624,08
IPIL11	6.030.659,30	102.460,69	102.433,42	1,94%	-793.254,02	-111.114,62	264.300,63	-337.009,97
IRBR12	11.900.223,06	66.031,70	54.831,29	1,04%	-832.745,61	-310.406,34	127.045,90	-169.833,73
ITFO14	9.107.660,53	194.488,50	193.379,14	3,66%	-1.214.923,09	-63.882,77	491.649,66	-616.505,16
LAMEA6	5.516.697,59	102.775,86	102.544,82	1,94%	-673.812,79	-11.547,16	273.867,60	-351.053,44
LCAMD1	11.036.477,97	161.112,56	160.682,00	3,04%	-1.237.266,58	-137.469,39	432.568,10	-556.962,83
LORTA7	6.399.346,16	95.920,17	95.687,01	1,81%	-718.051,32	-65.665,81	258.520,65	-332.792,12
MOVI37	8.674.634,33	123.457,58	123.095,30	2,33%	-959.184,55	-110.824,32	332.036,73	-427.716,49
MTRJ19	9.060.054,18	87.370,08	85.934,21	1,63%	-817.194,15	-154.600,39	237.450,26	-308.166,12
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PASN12	4.245.843,89	28.906,81	27.056,96	0,51%	-326.797,39	-80.598,93	79.933,79	-104.809,29
PEJA11	4.996.914,69	63.617,58	63.352,73	1,20%	-533.665,81	-81.730,00	171.799,54	-221.765,93
QUAT12	3.554.239,09	17.046,62	13.629,57	0,26%	-227.662,51	-101.972,45	22.269,24	-29.988,04
RAHD11	8.602.633,23	168.512,22	168.175,80	3,18%	-1.100.967,07	-38.443,17	460.244,07	-568.985,55
RDVE11	8.731.576,17	137.742,10	137.522,30	2,60%	-954.264,83	-82.978,08	358.216,70	-450.118,64
RMSA12	11.447.959,14	295.836,77	294.647,50	5,58%	-1.810.714,68	50.402,35	849.342,56	-1.031.191,12
RSAN44	10.139.429,57	84.667,67	81.705,65	1,55%	-861.133,73	-177.044,79	235.005,70	-306.618,51
TCH11	10.275.489,93	193.483,09	193.095,70	3,66%	-1.293.148,36	-30.098,18	553.074,42	-678.863,20
UNEG11	9.846.426,95	237.332,53	235.450,27	4,46%	-1.393.662,21	5.256,64	627.012,78	-771.706,23
UTPS21	6.338.981,40	134.241,73	133.263,21	2,52%	-823.675,26	-41.001,67	334.934,84	-420.427,66
VAMQ33	1.294.960,12	17.590,93	17.464,77	0,33%	-141.167,98	-17.422,77	48.083,00	-62.036,19
VAMQ34	7.183.828,99	104.288,95	104.064,71	1,97%	-799.832,73	-91.056,08	278.293,96	-358.273,38
VERO12	8.196.243,76	72.288,83	67.777,45	1,28%	-750.726,86	-151.797,05	208.536,02	-272.965,33
VIMT13	9.032.265,68	164.735,63	163.950,82	3,10%	-1.069.877,51	-80.617,37	413.911,77	-520.841,55
VRDN12	9.970.370,97	155.624,45	155.325,04	2,94%	-1.106.607,77	-131.583,41	390.182,65	-496.945,92
Total Var:	367.708.026,72	5.383.183,87	5.281.970,10	100,00%	-39.178.944,87	-4.172.402,25	14.073.109,33	-17.774.182,50

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – ABRIL 2024



bradesco

Data: 30/04/2024

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIRR EMB II A CRED PRIV CNPJ: 20725957000102

Dados Gerais		Limite Fundo:		ENQUADRADO		Dutacion DC:		763,74	
PL:	218.567.689,73	VAR / PL:	0,1723%	Status:		Dutacion DC:			
VAR:	376.548,27	ETL / PL:	0,2160%	Benchmark:		Dutacion DU:			527,89
ETL:	472.206,72	VAR / CD:	0,0019%						

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	1.064.712,51	Cenário Baixa - 10000 (+):	3.286.807,47	CENARIO BRADESCO 1 (+):	4.238.537,92	CENARIO BRADESCO 2 (+):	1.786.490,03
Cenário Alta - 09999 (-):	-2.734.388,48	Cenário Baixa - 10000 (-):	-1.283.500,40	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-2.605.096,08	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-4.034.724,36
Cenário Alta - 09999:	-1.669.675,97	Cenário Baixa - 10000:	2.003.307,07	CENARIO BRADESCO 1:	1.633.441,84	CENARIO BRADESCO 2:	-2.248.234,33

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
CAXA	9.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CDB323R5TI	6.576.820,98	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	4.400.277,39	64,73	29,53	0,01%	-125,79	128,30	452,16	-688,23
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-52.916,22	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPGT16	147.048,47	6,45	-6,95	0,00%	27,83	-28,32	-68,88	104,91
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DHF26	2.162,94	5.977,97	-5.112,90	-1,36%	22.153,18	-16.760,63	-26.205,94	37.771,63
DHF27	47.228,23	141.337,90	-117.713,46	-31,26%	528.768,57	-414.053,25	-636.447,48	885.963,12
DHF28	967,28	2.928,17	-2.968,66	-0,63%	11.291,29	-9.204,05	-14.259,46	19.137,55
DHF29	22.731,52	67.313,05	-52.860,53	-14,04%	287.353,34	-222.885,23	-350.284,42	453.207,76
DHF33	14.513,65	44.372,43	-32.722,71	-8,69%	187.518,20	-168.660,76	-277.482,42	310.264,22
DHN26	4.384,59	12.817,51	-10.819,48	-2,87%	47.272,20	-36.679,39	-56.250,21	79.712,94
DHV24	-37.897,13	135.913,67	124.313,84	33,01%	-503.821,98	453.904,09	855.957,82	-1.285.447,44
IDIN24P400700	-49,50	237,61	-217,61	-0,06%	49,50	-129.034,35	-478.041,70	49,50
IDIN24P400800	445,50	1.996,55	1.830,04	0,49%	-445,50	161.148,88	510.243,35	-445,50
IDIN24P410200	-278,40	1.286,53	-1.177,23	-0,31%	278,40	-286.394,43	-766.055,58	278,40
IDIN24P410300	528,00	2.291,14	2.096,49	0,56%	-528,00	309.230,12	789.066,36	-528,00
LF002200USM	10.506.502,91	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002200USN	11.015.431,06	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306J15	10.923.418,34	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306U55	6.563.728,83	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024000XE	10.506.267,09	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024000XG	10.487.410,23	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024000XN	10.464.386,09	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024002C7	6.542.150,44	106.660,54	88.788,61	23,58%	-393.071,18	322.281,76	484.527,37	-674.214,85
LF0024002SX	4.500.011,04	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024002TZ	10.451.279,21	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF00240033U	6.683.662,35	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024003CF	11.012.295,87	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024006I2	11.055.855,34	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024007F1	6.743.895,58	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024009LF	6.636.655,83	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20260301 - 210100	191.839,28	21,08	-6,64	0,00%	-894,71	1.548,04	32,27	-49,11
LFT20260901 - 210100	914.488,91	98,18	-21,29	-0,01%	-5.158,23	9.902,33	265,61	-404,23
LFT20300301 - 210100	4.530.883,83	3.411,08	-2.547,97	-0,68%	-64.685,51	157.555,26	11.918,29	-18.085,18
LTN20260101 - 100000	590.473,72	5.888,84	5.040,90	1,34%	-21.844,05	17.069,76	26.274,80	-37.864,50
LTN20260701 - 100000	959.674,38	12.516,07	10.540,79	2,80%	-46.217,58	37.734,02	56.473,93	-80.001,73
LTN20280101 - 100000	134.809,11	2.693,73	2.155,28	0,57%	-10.972,05	9.523,29	14.315,98	-19.198,86
NTNB20240815 - 760199_NEGOCIACAO	14.564.093,77	31.089,68	-8.124,70	-2,16%	-61.905,26	63.621,45	50.766,07	-68.608,73
NTNB20250515 - 760199_NEGOCIACAO	9.267.936,47	25.240,82	9.346,76	2,48%	-135.550,95	134.481,47	85.115,51	-114.228,77
NTNB20260815 - 760199_NEGOCIACAO	13.661.230,62	82.887,67	81.559,21	21,66%	-329.602,81	335.481,84	271.009,10	-359.043,40
NTNB20270515 - 760199_NEGOCIACAO	11.099.162,03	92.696,44	90.168,33	23,95%	-328.484,93	342.230,46	281.065,62	-369.588,40
NTNB20280815 - 760199_NEGOCIACAO	17.386.553,95	184.608,77	173.832,25	46,18%	-668.870,60	723.821,82	615.076,15	-798.689,20
NTNB20290515 - 760199_NEGOCIACAO	346.825,64	3.730,51	3.467,41	0,92%	-14.772,46	15.710,43	13.880,67	-17.897,02
NTNB20300515 - 760199_NEGOCIACAO	1.304.102,21	22.601,41	17.076,27	4,53%	-147.436,90	191.434,16	172.096,67	-189.741,20
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
Total Var:	220.189.991,43	990.688,31	376.548,27	99,95%	-1.669.675,97	2.003.307,07	1.633.441,84	-2.248.234,33

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – ABRIL 2024



Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIM EMB I A
CNPJ: 20725946000122
Data: 30/04/2024

Dados Gerais		Limite Fundo:		ENQUADRADO		0,00% Duração DC:		568,96	
PL:	380.956,109,57	VAR / PL:	0,4735%	Status:		Duração DU:			
VAR:	1.803.874,01	ETL / PL:	0,5938%	Benchmark:					
ETL:	2.262.130,78	VAR / CDI:	0,0052%						393,55

Cenários de STRESS										
Cenário Alta - 09999 (+):	11.004.151,91	Cenário Baixa - 10000 (+):	76.219.544,16	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	189.748.992,36	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	15.249.857,60			
Cenário Alta - 09999 (-):	-19.169.628,08	Cenário Baixa - 10000 (-):	-68.331.363,12	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	-161.440.580,41	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	-28.433.229,22			
Cenário Alta - 09999:	-8.165.376,17	Cenário Baixa - 10000:	7.888.181,04	CENÁRIO BRADESCO 1:	8.308.411,95	CENÁRIO BRADESCO 2:	-13.183.371,63			

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
ANHB10	453.656,90	25,46	25,35	0,00%	-95,44	77,15	123,02	-180,02
BCBF14	172.718,17	6,22	6,21	0,00%	-24,09	19,93	33,77	-50,21
CAIXA	9.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CBAN22	4.222.012,39	21.531,51	20.379,86	1,13%	-80.975,96	70.260,27	104.010,96	-134.064,37
CEEB3	1.856.649,73	282,96	281,10	0,02%	-1.048,11	842,04	1.315,48	-1.910,07
CGBP13	1.965.348,65	986,32	970,16	0,05%	-3.714,95	3.071,50	4.714,87	-6.845,03
COMPROMISSADA_PRE	96.143.037,74	1.414,36	370,10	0,02%	-2.748,43	2.803,19	9.879,47	-15.037,29
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-6.953,10	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPMK24C099250	-0,20	0,27	-0,06	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPMK24C099500	-269,38	379,19	-356,12	-0,02%	0,05	-0,05	-0,16	0,25
CPMK24C099750	-75,82	207,82	198,68	0,01%	0,01	-0,01	-0,05	0,07
CPMK24C100000	-1.031,55	1.877,38	1.731,43	0,10%	0,18	-0,18	-0,63	0,95
CPTIE12	1.910.134,13	1.158,61	1.131,56	0,06%	-4.455,21	3.748,17	5.789,74	-7.817,32
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DHF25	-153.814,79	515.072,78	513.962,21	28,49%	-2.001.644,19	1.556.918,13	2.719.095,85	-4.051.280,02
DHF26	-77.247,72	213.498,87	211.314,74	11,71%	-791.185,00	598.593,88	935.926,47	-1.348.986,79
DHF27	-53.028,19	158.695,19	155.775,45	8,64%	-593.705,06	464.901,89	714.607,70	-994.765,60
DHF31	116.854,33	348.667,27	-326.781,56	-18,12%	1.448.801,23	-1.252.692,43	-2.026.851,49	2.436.355,53
DHK24	21,06	1.852,84	-484,83	-0,03%	3.600,50	-3.672,23	-12.942,31	19.699,17
DHM24	12.501,85	55.360,70	-49.322,49	-2,73%	252.867,57	-258.017,43	-882.160,03	1.339.133,09
DHN26	112.172,34	327.914,52	-323.464,76	-17,93%	1.209.380,51	-938.381,17	-1.439.067,75	2.039.322,79
DIV24	-291.004,06	1.043.652,20	1.038.540,38	57,57%	-3.868.742,14	3.485.433,18	6.572.718,55	-9.870.678,23
ELET13	2.009.591,76	239,23	238,23	0,01%	-898,63	723,95	1.157,31	-1.699,04
GRRB14	1.077.399,36	44,53	44,35	0,00%	-169,11	137,77	225,24	-330,55
IDF25P419600	29.881,28	93.461,89	93.221,83	5,17%	-29.881,28	5.377.931,57	12.584.626,41	-29.881,28
IDF25P419700	-38.265,80	115.825,58	-115.528,08	-5,40%	38.265,80	-5.611.506,72	-12.824.739,63	38.265,80
IDIN24P400300	-29,27	87,41	-81,69	0,00%	29,27	-199.389,07	-3.083.969,77	29,27
IDIN24P400400	8,66	30,18	28,17	0,00%	-8,66	102.851,49	997.986,16	-8,66
IDIN24P400500	20,61	86,60	80,83	0,00%	-20,61	405.908,36	2.578.701,99	-20,61
IDIN24P400600	27,40	145,93	136,20	0,01%	-27,40	801.892,23	3.698.919,05	-27,40
IDIN24P400700	227,10	1.089,21	1.016,61	0,06%	-227,10	591.993,93	2.193.197,37	-227,10
IDIN24P400800	-8.391,60	37.607,81	-35.101,30	-1,95%	8.391,60	-3.035.458,88	-9.611.129,19	8.391,60
IDIN24P400900	30.426,50	94.606,71	88.301,30	4,90%	-30.426,50	1.124.203,72	3.201.304,97	-30.426,50
IDIN24P401100	321.793,08	225.381,70	210.360,30	11,66%	-321.791,72	1.096.332,97	3.008.261,79	-321.793,08
IDIN24P401200	-994.455,84	464.841,57	-433.860,47	-24,05%	993.472,38	-2.197.638,98	-6.022.449,96	994.455,84
IDIN24P401300	974.242,43	340.162,45	317.491,05	17,60%	-964.303,43	1.590.448,86	4.355.972,29	-974.242,43
IDIN24P401400	-759.264,30	210.826,55	-196.775,23	-10,91%	734.520,84	-981.873,58	-2.688.640,51	759.264,30
IDIN24P401500	1.671.353,10	384.210,38	358.603,24	19,88%	-1.526.546,57	1.788.706,10	4.897.894,02	-1.671.353,10
IDIN24P401600	-2.843.739,73	557.604,96	-520.441,30	-28,88%	2.360.994,20	-2.595.916,29	-7.108.223,56	2.843.739,73
IDIN24P401700	1.631.623,02	278.939,94	260.348,95	14,43%	-1.219.167,13	1.298.586,19	3.555.831,73	-1.631.623,02
IDIN24P410000	536,50	2.761,46	2.765,17	0,15%	-536,50	1.854.917,67	5.548.023,62	-536,50
IDIN24P410100	-1.091,50	5.332,20	-5.326,61	-0,30%	1.091,50	-2.031.148,11	-5.726.767,43	1.091,50
IDIN24P410200	-2.170,36	10.029,57	-9.981,62	-0,58%	2.170,36	-2.232.683,27	-5.972.041,60	2.170,36
IDIN24P410300	1.093,40	4.744,57	4.721,89	0,26%	-1.093,40	640.364,03	1.634.024,93	-1.093,40
IDIN24P410400	1.684,80	6.893,18	6.860,23	0,38%	-1.684,80	597.483,29	1.461.453,75	-1.684,80
IDIN24P410500	5.991,12	23.379,04	23.267,27	1,29%	-5.991,12	1.391.306,89	3.275.760,78	-5.991,12
IDIN24P410700	44.109,84	156.837,43	156.087,67	8,65%	-44.109,84	4.763.117,76	10.503.389,22	-44.109,84
IDIN24P410800	-65.662,60	223.713,76	-222.644,30	-12,34%	65.662,60	-5.048.256,16	-10.823.965,73	65.662,60
IDIN24P410900	-91.963,41	302.410,62	-300.964,95	-16,68%	91.963,41	-5.204.837,16	-10.879.828,34	91.963,41
IDIN24P411000	166.818,50	536.816,16	534.249,92	29,62%	-166.818,50	7.219.343,08	14.746.445,33	-166.818,50
IDIN24P411100	-65.249,58	183.063,28	-182.188,15	-10,10%	65.249,58	-1.804.876,54	-3.621.998,11	65.249,58
IDIN24P411300	1.371.511,82	2.732.767,82	2.719.703,87	150,77%	-1.371.511,82	17.166.984,62	33.647.295,50	-1.371.511,82
IDIN24P411400	-3.727.690,36	6.409.330,49	-6.378.690,80	-353,61%	3.727.690,32	-34.935.012,87	-67.903.648,36	3.727.690,36
IDIN24P411500	2.415.537,41	3.618.090,42	3.600.794,20	199,61%	-2.415.537,16	17.708.669,38	34.196.993,99	-2.415.537,41
IVIA35	1.338.104,10	9,72	9,69	0,00%	-37,72	32,49	58,90	-88,20
LCAMC3	2.949.776,31	903,47	895,32	0,05%	-3.338,32	2.696,35	4.159,30	-5.972,93
LF002100HDP	1.600.887,79	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002100HDQ	2.916.882,43	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFSC1900089	3.775.154,94	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20250301 - 210100	53.159.738,59	5.559,33	847,04	0,05%	-121.930,55	154.400,20	-23,11	35,18
LFT20250901 - 210100	10.127.339,70	997,70	-12,02	0,00%	-36.742,02	55.380,26	646,50	-984,20
LFT20260301 - 210100	124.666.015,24	13.699,76	-1.038,50	-0,06%	-581.421,02	1.005.986,03	20.968,28	-31.916,79
LFT20260901 - 210100	30.399.381,22	3.263,53	299,41	0,02%	-171.469,51	329.172,66	8.829,27	-13.437,37
LFT20270301 - 210100	1.296.004,57	162,28	33,96	0,00%	-7.149,84	18.646,85	882,87	-1.342,99
LFT20290301 - 210100	4.222.962,19	1.447,90	553,98	0,03%	-42.160,17	114.890,56	7.608,33	-11.557,16
LTN20260701 - 100000	24.550.869,73	320.192,39	315.676,75	17,50%	-1.182.361,21	965.330,51	1.444.744,40	-2.046.644,23
NTNB20500815 - 760199_NEGOCIACAO	8.321.013,49	144.211,57	120.383,90	6,67%	-940.742,52	1.221.473,42	1.098.087,78	-1.210.671,24
OMGE13	919.008,45	489,74	481,89	0,03%	-1.840,48	1.520,01	2.334,33	-3.249,28
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PRLG14	1.152.245,89	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
SBSPC7	2.440.279,80	981,28	970,93	0,05%	-3.643,81	2.960,57	4.573,49	-6.522,12
VAMO22	1.069.735,66	84,33	83,96	0,00%	-317,38	258,14	417,58	-611,69
WDOM24	-83.284,82	184.161,16	143.670,44	7,96%	-827.283,70	638.222,96	-812.132,71	817.336,22
Total Var:	384.368.501,15	20.390.151,26	1.803.874,01	99,98%	-8.165.376,17	7.888.181,04	8.308.411,95	-13.183.371,63

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – ABRIL 2024



Relatório de Risco de Mercado

Data: 30/04/2024

FUNDO: FIMEMB III A IMOBILIÁRIO
CNPJ: 32711990000162

Dados Gerais							
PL:	71.063.403,83	VAR / PL:	1,8970%	Limite Fundo:	0,00%	Duration DC:	2,00
VAR:	1.348.104,10	ETL / PL:	2,3790%	Status:	ENQUADRADO	Duration DU:	1,00
ETL:	1.690.576,93	VAR / CDE:	0,0208%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	33.605.788,88	Cenário Baixa - 10000 (+):	6,16	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	8.327.021,40	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	0,00
Cenário Alta - 09999 (-):	-1.401.752,52	Cenário Baixa - 10000 (-):	-35.007.533,36	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	-8.395.193,72
Cenário Alta - 09999:	32.204.036,35	Cenário Baixa - 10000:	-35.007.529,19	CENÁRIO BRADESCO 1:	8.327.021,40	CENÁRIO BRADESCO 2:	-8.395.193,72

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	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
AIEC11	1.890.662,40	145.866,72	-28.540,32	-2,12%	945.331,20	-945.331,20	277.171,11	-279.439,90
BMLC11	3.601.239,84	282.408,81	164.997,39	12,24%	3.601.239,84	-3.601.239,84	527.941,76	-532.263,25
BPML11	2.903.900,00	210.283,09	-74.834,50	-5,55%	2.903.900,00	-2.903.900,00	425.711,74	-429.196,42
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CEOC11	648.714,20	20.931,54	8.555,26	0,63%	324.357,10	-324.357,10	95.101,50	-95.879,96
CNES11	315.035,22	425.920,01	240.324,51	17,83%	157.517,61	-157.517,61	46.184,16	-46.562,21
COMPROMISSADA_PRE	211.344,46	3,11	1,57	0,00%	-6,04	6,16	21,72	-33,06
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-332.833,60	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
FVPO11	93.417,50	41.426,60	24.849,45	1,84%	476.708,75	-476.708,75	138.771,01	-140.915,11
MALLH	4.785.035,04	167.897,71	84.612,10	6,28%	2.392.517,52	-2.392.517,52	701.496,14	-707.228,18
MAXR11	1.918.045,44	94.832,01	55.163,48	4,09%	959.022,72	-959.022,72	281.185,46	-283.487,12
NEWL11	6.997.287,92	421.078,54	92.954,95	6,90%	3.498.643,96	-3.498.643,96	1.025.802,41	-1.034.199,16
NEWU11	1.800.283,52	47.949,39	-20.108,44	-1,49%	1.800.283,52	-1.800.283,52	263.921,56	-266.081,90
OUTL11	182.958,75	16.578,12	-3.553,93	-0,26%	91.479,38	-91.479,38	26.821,75	-27.041,30
OUTRAS_DESPESA	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PATC11	4.213.463,40	85.048,95	34.674,48	2,57%	2.106.731,70	-2.106.731,70	617.693,73	-622.749,89
PVBH11	2.437.543,69	33.313,43	26.214,94	1,94%	0,00	0,00	0,00	0,00
QAGR11	5.268.771,51	112.759,56	80.280,93	5,96%	2.634.385,76	-2.634.385,76	772.401,90	-778.724,43
RBRL11	2.105.338,00	139.226,90	-13.960,47	-1,04%	2.105.338,00	-2.105.338,00	308.642,55	-311.168,96
RBRP11	1.075.430,00	45.258,60	15.826,90	1,17%	537.715,00	-537.715,00	157.658,04	-158.948,55
RCRB11	6.468.844,94	230.625,17	164.681,80	12,22%	0,00	0,00	0,00	0,00
TEPP11	4.285.181,05	170.766,49	93.308,99	6,92%	2.142.590,53	-2.142.590,53	628.207,54	-633.349,76
TRXP11	9.326.230,20	175.501,11	124.668,04	9,25%	4.663.115,10	-4.663.115,10	1.367.225,35	-1.378.416,82
TRXF13	1.414.545,48	26.619,93	18.308,88	1,40%	-1.401.746,48	-1.401.746,48	0,00	0,00
VWIR11	4.092.142,50	121.849,54	64.811,55	4,81%	0,00	0,00	0,00	0,00
XPNH11	2.396.563,20	78.776,79	38.320,77	2,84%	1.198.281,60	-1.198.281,60	351.336,17	-354.212,04
XPRR11	2.133.259,20	439.079,92	155.946,79	11,57%	1.068.629,60	-1.068.629,60	312.735,80	-315.295,71
Total Var:	71.063.403,87	3.533.799,04	1.348.104,10	100,00%	32.204.036,35	-35.007.529,19	8.327.021,40	-8.395.193,72

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – ABRIL 2024



Relatório de Risco de Mercado

Data: 30/04/2024

FUNDO:	FIA RVA EMB II		
CNPJ:	13294268000125		

Dados Gerais			
PL:	107.327.298,55	VAR / PL:	1,9791%
VAR:	2.124.074,75	ETL / PL:	2,4818%
ETL:	2.663.675,42	VAR / CDI:	0,0217%
Limite Fundo:		Status:	ENQUADRADO
Benchmark:		Dutacion DC:	0,00%
		Dutacion DU:	2,00

Cenários de STRESS			
Cenário Alta - 09999 (+):	28.776.736,72	Cenário Baixa - 10000 (+):	94,99
Cenário Alta - 09999 (-):	-93,14	Cenário Baixa - 10000 (-):	-27.546.507,64
Cenário Alta - 09999:	28.776.643,59	Cenário Baixa - 10000:	-27.546.412,65

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
ABEV3	1.586.850,75	45.309,88	7.642,25	0,36%	222.159,11	-476.068,29	232.632,32	-234.536,54
B3SA3	2.021.279,91	97.067,94	37.420,82	1,76%	505.319,98	-505.319,98	296.319,64	-298.745,17
BBAS3	3.449.436,00	171.493,34	68.706,99	3,23%	862.359,00	-862.359,00	505.687,32	-509.826,64
BBD4	2.754.920,00	278.907,31	-6.164,89	-0,29%	688.730,00	-688.730,00	403.871,27	-407.177,18
BPAC11	3.724.100,00	376.782,12	126.537,76	5,96%	1.117.230,00	-1.303.435,00	545.953,06	-550.421,98
BRFS3	337.600,00	29.135,95	-3.339,30	-0,16%	84.398,00	-84.400,00	49.492,16	-49.897,28
BRIT3	549.810,00	114.550,18	-11.382,48	-0,54%	258.397,29	-258.410,70	80.602,15	-81.261,92
BRSP6	400.600,00	70.904,25	19.732,29	0,93%	100.170,00	-100.170,00	58.739,69	-59.220,50
CAIXA	10.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CEAB3	759.278,00	96.361,30	37.935,42	1,79%	227.783,40	-303.718,09	111.310,16	-112.221,29
CMG4	2.312.852,10	194.545,17	-22.121,55	-1,04%	1.516.255,65	-168.551,76	339.064,12	-341.839,54
COMPROMISSADA_PRE	3.257.988,55	47,93	-0,13	0,00%	-93,14	94,99	334,78	-509,57
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	1.265.577,36	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPFE3	484.880,00	33.376,36	2.154,44	0,10%	147.136,00	-63.536,00	71.083,41	-71.665,26
CPL6	1.498.941,00	97.396,29	26.089,83	1,23%	329.767,02	-329.767,02	219.744,75	-221.543,48
CSAN3	735.150,00	57.747,72	29.720,99	1,40%	183.787,50	-183.787,50	107.772,99	-108.655,17
CURY3	631.120,00	83.814,75	21.822,88	1,03%	189.336,00	-189.336,00	92.522,19	-93.279,54
CXSE3	1.169.802,00	137.753,02	6.979,92	0,33%	285.055,20	-199.897,20	171.492,97	-172.896,74
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DIRR3	1.277.936,00	190.134,38	44.858,82	2,11%	383.380,80	-383.386,28	187.345,42	-188.878,94
ELET3	3.412.018,92	423.547,19	122.797,27	5,78%	1.070.469,12	-998.380,53	500.201,97	-504.296,40
ENEV3	529.864,00	28.606,87	8.456,97	0,40%	196.049,68	-270.230,64	77.678,06	-78.313,90
EQTL3	2.676.625,00	124.700,41	29.175,01	1,37%	535.325,00	-535.325,00	392.393,23	-395.605,18
GGBR4	1.667.503,20	134.216,01	12.168,55	0,57%	416.875,80	-416.875,80	244.455,97	-246.455,97
GMAT3	837.718,00	159.879,11	41.406,86	1,95%	150.789,24	-134.034,88	122.809,46	-123.814,72
GOAU4	705.686,00	63.282,72	5.715,67	0,27%	211.705,80	-176.421,50	103.453,67	-104.300,39
HAPV3	441.648,72	55.130,91	4.067,03	0,19%	150.160,57	-150.172,53	64.745,70	-65.275,68
IGTI1	569.024,00	53.355,47	15.499,03	0,73%	113.804,80	-113.804,80	83.418,92	-84.101,75
INTB3	459.200,00	65.489,77	5.192,74	0,24%	229.600,00	-160.720,00	67.318,72	-67.869,76
ITSA4	2.571.104,64	264.322,31	82.693,62	3,89%	488.509,88	-488.509,88	376.923,94	-380.009,27
ITUB4	8.835.272,32	809.115,72	262.445,32	12,36%	1.767.054,46	-1.678.701,74	1.295.250,92	-1.305.853,25
JBSS3	1.830.664,00	177.393,18	20.581,57	0,97%	640.732,40	-640.732,40	268.375,34	-270.572,14
LREN3	1.374.334,50	128.859,76	1.301,93	0,06%	274.866,90	-274.866,90	201.477,44	-203.126,64
MRF3	1.636.740,00	168.066,91	27.208,27	1,28%	654.696,00	-491.022,00	239.946,08	-241.910,17
MULT3	686.700,00	48.402,90	5.527,70	0,26%	206.010,00	-171.675,00	100.670,22	-101.494,26
NTCO3	857.703,00	127.432,28	21.803,66	1,03%	214.425,75	-214.430,92	125.739,26	-126.768,50
ONCO3	836.096,00	190.605,70	20.453,68	0,96%	292.633,60	-292.633,60	122.571,67	-123.574,99
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PETR3	4.271.090,00	899.343,50	147.203,46	6,93%	1.067.772,50	-1.281.336,65	626.141,79	-631.267,10
PETR4	10.482.267,18	1.879.040,74	393.059,42	16,50%	2.620.566,80	-3.144.680,15	1.536.700,37	-1.549.279,09
PETRE421	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PLPL3	189.810,00	44.011,39	11.472,91	0,54%	56.943,00	-56.943,00	27.826,15	-28.053,92
PRIO3	2.184.000,00	177.009,17	43.259,87	2,04%	1.310.400,00	-1.310.400,00	320.174,40	-322.795,20
RADL3	1.961.883,68	184.147,00	41.387,31	1,95%	392.376,74	-392.376,74	287.612,15	-289.966,41
RAIL3	499.968,00	33.322,12	11.856,27	0,56%	224.985,60	-164.989,44	73.295,31	-73.895,27
RECV3	337.745,00	36.705,63	13.468,69	0,63%	202.647,00	-202.647,00	49.513,42	-49.918,71
RENT3	3.147.726,00	254.622,12	31.638,88	1,49%	1.038.749,58	-818.408,76	461.456,63	-465.233,90
RRRP3	620.279,00	81.000,00	6.097,77	0,29%	372.167,40	-372.167,40	90.932,90	-91.677,24
SBF3	891.824,00	162.847,45	50.080,50	2,36%	357.708,04	-348.549,20	130.741,40	-131.811,59
SBSF3	2.093.238,00	122.218,20	3.551,38	0,17%	523.309,50	-523.309,50	306.868,69	-309.380,58
SUZB3	3.583.598,00	454.849,77	22.519,50	1,06%	895.899,50	-716.719,60	525.355,47	-529.655,78
TMS3	871.695,00	62.553,76	20.889,98	0,98%	278.942,40	-200.489,85	127.790,49	-128.836,52
VALE3	12.486.800,55	1.399.024,95	40.252,02	1,90%	3.121.700,14	-3.121.700,14	1.830.564,96	-1.845.549,12
VBBR3	1.011.126,00	108.832,54	55.212,08	2,60%	252.781,50	-252.781,50	148.231,07	-149.444,42
VIVT3	1.723.176,00	126.883,61	62.601,39	2,95%	266.844,76	-252.288,40	252.617,60	-254.685,41
WEGE3	2.835.735,00	227.573,94	55.560,40	2,62%	708.933,75	-708.933,75	415.718,75	-419.121,63
WINM24	-28.768,00	42.943,86	40.873,98	1,92%	369.034,58	-368.375,62	291.836,44	-293.419,66
Total Var:	107.327.297,38	11.394.164,82	2.124.074,75	100,00%	28.776.643,59	-27.546.412,65	15.364.838,85	-15.489.912,25

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – ABRIL 2024



Relatório de Risco de Mercado

Data: 30/04/2024

FUNDO: FIA RVA EMB III
CNPJ: 38452593000108

Dados Gerais					
PL:	108.437.076,15	VAR / PL:	6,9825%	Limite Fundo:	0,00%
VAR:	7.571.599,70	ETL / PL:	8,7563%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	9.495.091,50	VAR / CDI:	0,0766%	Benchmark:	Dutacion DC: 2,00 Dutacion DU: 1,00

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	30.779.969,90	Cenário Baixa - 10000 (+):	761.313,43	CENARIO BRADESCO 1 (+):	14.420.246,27	CENARIO BRADESCO 2 (+):	974.804,67
Cenário Alta - 09999 (-):	-748.264,06	Cenário Baixa - 10000 (-):	-28.967.750,81	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-968.598,64	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-14.538.466,36
Cenário Alta - 09999:	30.031.705,84	Cenário Baixa - 10000:	-28.206.437,38	CENARIO BRADESCO 1:	13.451.647,63	CENARIO BRADESCO 2:	-13.563.661,70

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
ALOS3	5.361.023,52	554.623,40	538.149,77	7,11%	0,00	0,00	0,00	0,00
ALPA4	444.620,00	56.661,29	20.497,28	0,27%	111.155,00	-111.155,00	65.181,29	-65.714,84
B3SA3	1.178.268,00	56.583,97	46.282,60	0,61%	294.567,00	-294.567,00	172.734,09	-174.148,01
BBAS3	1.824.691,32	90.716,98	32.503,07	0,43%	456.172,83	-456.172,83	267.499,75	-269.689,38
BBSE3	2.688.700,00	85.427,10	-11.573,77	-0,15%	537.740,00	-537.740,00	394.163,42	-397.389,86
BPAC11	3.572.831,40	361.477,67	338.431,60	4,47%	1.071.849,42	-1.250.490,99	523.777,08	-528.064,48
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	4.461.629,08	65,63	16,50	0,00%	-127,54	130,09	458,47	-697,82
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-311.191,66	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPLE3	1.630.758,60	92.427,56	61.203,73	0,81%	358.766,89	-358.766,89	239.069,21	-241.026,12
CPLE6	1.261.764,72	81.985,35	63.251,12	0,84%	277.588,24	-277.588,24	184.974,71	-186.488,83
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DOLM24	-99.330,52	219.641,75	176.917,01	2,34%	-748.136,52	761.183,35	-968.598,64	974.804,67
ELET3	8.075.083,68	1.002.391,58	864.188,22	11,41%	2.533.434,86	-2.362.825,79	1.183.807,27	-1.193.497,37
ENEV3	5.391.675,70	291.091,57	104.136,16	1,38%	1.994.920,01	-2.749.754,61	790.419,66	-796.889,67
EQTL3	8.930.842,27	416.076,09	336.158,66	4,44%	1.786.168,45	-1.786.168,45	1.309.261,48	-1.319.978,49
FLRY3	3.382.528,00	147.427,11	-41.425,98	-0,55%	676.505,60	-676.505,60	495.878,61	-499.937,64
HAPV3	3.291.225,39	410.842,91	133.577,00	1,76%	1.119.016,63	-1.119.105,83	482.493,64	-486.443,11
IGTH11	7.041.818,44	660.287,62	639.828,94	8,45%	1.408.363,69	-1.408.363,69	1.032.330,58	-1.040.780,77
ITSA4	6.088.764,00	625.955,14	586.960,38	7,75%	1.156.865,16	-1.156.865,16	892.612,80	-899.919,32
ITUB4	489.216,00	44.801,38	40.545,57	0,54%	97.843,20	-92.951,04	71.719,07	-72.306,13
MGLU3	2.314.507,84	555.345,08	488.084,04	6,45%	1.203.544,08	-1.041.528,53	339.306,85	-342.084,26
MULT3	375.396,00	26.460,25	23.279,87	0,31%	112.618,80	-93.849,00	55.033,05	-55.483,53
NTCO3	1.422.307,71	211.406,95	199.613,93	2,64%	355.726,93	-355.735,50	208.598,27	-210.305,76
ONCO3	317.952,00	72.463,86	61.626,38	0,81%	111.283,20	-111.283,20	46.611,76	-46.993,31
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PRIO3	3.048.000,00	247.034,77	28.276,71	0,37%	1.828.800,00	-1.828.800,00	446.836,80	-450.494,40
RAIL3	7.356.263,04	490.283,87	287.581,61	3,80%	3.310.318,37	-2.427.566,80	1.078.428,16	-1.087.255,68
RECV3	2.820.911,61	306.872,50	222.066,94	2,93%	1.692.546,97	-1.692.546,97	413.545,64	-416.930,74
RENT3	8.070.387,03	652.820,17	244.232,06	3,23%	2.663.227,72	-2.098.300,63	1.183.118,74	-1.192.803,20
SCAR3	171.988,00	12.610,25	7.120,46	0,09%	103.192,80	-103.192,80	25.213,44	-25.419,83
SMFT3	3.500.293,00	352.020,38	304.101,19	4,02%	1.400.117,20	-1.400.117,20	513.142,95	-517.343,31
SOMA3	2.288.390,00	428.803,37	391.428,88	5,17%	686.517,00	-686.517,00	335.477,97	-338.224,04
SRNA3	862.278,00	108.509,44	60.054,22	0,79%	0,00	0,00	0,00	0,00
SUZB3	6.723.309,22	853.359,02	678.906,42	8,97%	1.680.827,31	-1.344.661,84	985.637,13	-993.705,10
VIVA3	1.327.384,00	260.164,21	50.254,85	0,66%	427.027,10	-382.701,10	194.594,49	-196.187,36
WDOM24	3.056,32	6.758,21	-5.443,60	-0,07%	23.019,59	-23.421,03	29.803,04	-29.993,99
YDUQ3	3.127.672,89	771.133,25	600.767,88	7,93%	1.300.245,86	-738.508,10	458.516,85	-462.270,05
Total Var:	108.436.614,60	10.554.249,66	7.571.599,70	100,01%	30.031.705,84	-28.206.437,38	13.451.647,63	-13.563.661,70



Relatório de Risco de Mercado

Data: 30/04/2024

FUNDO:	FIA RVA EMB IV		
CNPJ:	38452613000132		

Dados Gerais			
PL:	103.628.391,63	VAR / PL:	5,1528%
VAR:	5.339.712,52	ETL / PL:	6,4618%
ETL:	6.696.214,92	VAR / CDI:	0,0565%
Limite Fundo:		Status:	ENQUADRADO
Benchmark:		Dutacion DC:	0,00%
		Dutacion DU:	2,00

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	29.761.822,82	Cenário Baixa - 10000 (+):	195,86	CENARIO BRADESCO 1 (+):	14.139.887,57
Cenário Alta - 09999 (-):	-192,03	Cenário Baixa - 10000 (-):	-28.469.735,33	CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00
Cenário Alta - 09999:	29.761.630,79	Cenário Baixa - 10000:	-28.469.539,47	CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	-14.255.984,89
				CENARIO BRADESCO 2:	-14.255.984,89

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
AURE3	3.838.028,50	182.639,33	-34.576,68	-0,65%	959.507,13	-1.189.788,84	562.654,98	-567.260,61
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	6.717.442,36	98,82	41,49	0,00%	-192,03	195,86	690,27	-1.050,65
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	462.489,15	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPLE3	2.156.485,20	122.224,51	69.537,16	1,30%	474.426,74	-474.426,74	316.140,73	-318.728,51
CPLE6	4.754.906,28	308.958,28	222.460,13	4,17%	1.046.079,38	-1.046.079,38	697.069,26	-702.775,15
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ENGI11	9.939.543,90	330.516,46	102.919,77	1,93%	1.669.722,46	-2.186.699,66	1.457.137,14	-1.469.064,59
ENGI4	15,24	0,76	0,40	0,00%	12,19	-12,19	2,23	-2,25
EQTL3	9.521.871,66	443.611,36	325.357,21	6,09%	1.904.374,33	-1.904.374,33	1.395.906,39	-1.407.332,63
GGPS3	7.428.112,50	927.527,16	522.898,88	9,79%	3.342.650,63	-3.342.650,63	1.088.961,29	-1.097.875,03
GMAT3	7.905.690,94	1.505.975,91	1.409.279,64	26,39%	1.423.024,37	-1.264.910,55	1.158.974,29	-1.168.461,12
HAPV3	5.312.426,58	663.148,99	161.836,96	3,03%	1.806.225,04	-1.806.369,01	778.801,74	-785.176,65
ITUB4	6.299.534,08	576.898,13	496.082,28	9,29%	1.259.906,82	-1.196.911,48	923.511,70	-931.071,14
MATD3	861.053,92	82.561,72	-14.326,34	-0,27%	258.316,18	-258.331,34	126.230,51	-127.263,77
MULT3	3.871.317,03	272.874,56	216.591,86	4,06%	1.161.395,11	-967.829,26	567.535,08	-572.180,66
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PRIO3	11.709.504,00	949.033,67	213.728,97	4,00%	7.025.702,40	-7.025.702,40	1.716.613,29	-1.730.664,69
RAIL3	8.491.190,40	565.925,08	444.996,23	8,33%	3.821.035,68	-2.802.092,83	1.244.808,51	-1.254.997,94
UGPA3	11.717.753,30	1.318.597,23	965.180,19	18,08%	2.929.438,33	-2.343.550,66	1.717.822,63	-1.731.883,94
VBBR3	2.640.024,18	284.158,99	237.704,38	4,45%	660.006,05	-660.006,05	387.027,55	-390.195,57
Total Var:	103.628.389,22	8.534.750,96	5.339.712,52	99,99%	29.761.630,79	-28.469.539,47	14.139.887,57	-14.255.984,89

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – ABRIL 2024



bradesco

Data: 30/04/2024

Relatório de Risco de Mercado

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

		Dados Gerais		Limite Fundo:	ENQUADRADO	0,00%	Dutition DC:	6,32
PL:	115.486.868,99	VAR / PL:	2,0249%	Status:			Dutition DU:	4,41
VAR:	2.338.451,93	ETL / PL:	2,5393%	Benchmark:				
ETL:	2.932.513,06	VAR / CDI:	0,0222%					

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	30.232.384,61	Cenário Baixa - 10000 (+):	6.262,24	CENARIO BRADESCO 1 (+):	16.702.724,37	CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00
Cenário Alta - 09999 (-):	-4.219,71	Cenário Baixa - 10000 (-):	-29.977.617,77	CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-16.838.347,03
Cenário Alta - 09999:	30.228.164,90	Cenário Baixa - 10000:	-29.971.355,53	CENARIO BRADESCO 1:	16.702.724,37	CENARIO BRADESCO 2:	-16.838.347,03

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
ABEV3	2.830.026,60	80.806,70	16.383,11	0,70%	396.203,72	-849.031,27	414.881,90	-418.277,93
ALOS3	589.484,16	60.984,94	4.532,16	0,19%	0,00	0,00	0,00	0,00
ALPA4	88.621,28	11.293,68	4.924,98	0,21%	22.155,32	-22.155,32	12.991,88	-13.098,23
ARZ3	171.491,76	30.393,77	-2.376,23	-0,10%	51.447,53	-51.447,53	25.140,69	-25.346,48
ASAI3	938.303,04	116.478,23	8.006,40	0,34%	262.724,85	-243.958,79	137.555,23	-138.681,19
AZUL4	169.308,75	56.662,26	-186,13	-0,01%	101.585,25	-59.258,06	24.820,66	-25.023,83
B3SA3	3.204.457,36	153.887,68	39.126,66	1,67%	801.114,34	-801.114,34	468.773,45	-473.619,80
EBAS3	4.130.521,38	205.354,42	58.569,57	2,30%	1.032.630,35	-1.032.630,35	505.534,43	-610.491,06
BBD03	983.213,28	95.517,72	7.016,32	0,30%	245.803,32	-245.803,32	144.139,07	-145.318,92
BDDC4	3.819.228,00	386.657,55	14.405,22	0,62%	954.807,00	-954.807,00	559.898,83	-564.481,90
BBS03	1.146.645,40	36.428,77	2.393,23	0,10%	229.309,08	-229.309,08	168.083,56	-169.459,41
BEF3	84.682,44	11.389,00	217,35	0,01%	21.170,61	-21.170,61	12.414,45	-12.516,07
BHIA3	34.434,95	10.391,34	3.347,71	0,14%	0,00	0,00	0,00	0,00
BPAC11	2.037.132,80	206.104,89	33.294,42	1,42%	611.139,84	-712.996,48	298.643,67	-301.088,23
BRAP4	265.168,65	30.232,72	5.783,00	0,25%	85.917,04	-54.517,24	38.873,72	-39.191,93
BRFS3	1.500.969,60	129.538,41	-19.651,65	-0,84%	375.233,51	-375.242,40	220.042,14	-221.843,31
BRKM5	299.899,04	89.113,52	-1.253,39	-0,05%	164.944,47	-89.969,71	43.965,20	-44.325,08
CAIXA	9.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CCRO3	650.518,47	61.529,59	7.299,26	0,31%	162.629,62	-162.629,62	95.366,01	-96.146,63
CIEL3	323.433,19	19.090,31	4.083,73	0,17%	97.029,96	-80.858,30	47.415,31	-47.803,43
CMG4	967.689,19	81.397,02	-6.128,30	-0,28%	634.396,04	-70.521,46	141.863,24	-143.024,46
CMN3	290.802,98	17.321,86	4.274,46	0,18%	101.781,04	-101.781,04	42.631,72	-42.980,68
COGN3	208.760,51	37.751,53	1.826,79	0,08%	52.190,13	-73.066,18	30.604,29	-30.854,80
COMPROMISSADA_PRE	1.130.057,64	16,62	-1,60	0,00%	-32,31	32,95	116,12	-176,75
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	1.189.020,41	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPFE5	317.438,90	21.850,54	4.230,40	0,19%	96.325,68	-41.595,18	46.536,25	-46.917,17
CPLE6	809.155,44	52.576,28	6.506,92	0,28%	178.014,20	-178.014,20	118.622,19	-119.593,17
CRFB3	316.166,85	72.629,62	6.776,50	0,29%	79.041,71	-79.041,71	46.350,06	-46.729,46
CSAN3	897.796,50	70.523,97	27.881,33	1,19%	224.449,13	-224.449,13	131.616,97	-132.694,32
CSNA3	443.352,00	30.138,62	6.600,38	0,28%	177.340,80	-133.005,60	64.995,40	-65.527,43
CVCB3	55.996,59	25.408,23	1.754,57	0,08%	27.998,30	-27.998,30	8.209,10	-8.276,30
CYRE3	285.986,40	50.352,05	-747,26	-0,03%	91.515,65	-82.936,06	41.925,61	-42.268,79
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DXCO3	116.034,27	14.944,02	2.573,73	0,11%	29.008,57	-34.810,28	17.010,62	-17.149,87
EGIE3	553.336,10	30.690,11	14.062,50	0,60%	99.599,15	-99.600,50	81.119,07	-81.783,08
ELET3	3.974.656,38	493.389,57	59.429,69	2,54%	1.246.988,07	-1.163.012,17	582.684,63	-587.454,21
ELET6	591.606,60	63.207,56	5.886,37	0,25%	211.161,99	-159.346,59	86.729,53	-87.439,46
EMBR3	1.298.649,00	277.193,51	-40.093,58	-1,71%	324.662,25	-324.662,25	190.381,94	-191.940,32
ENEV3	1.036.255,52	56.946,48	15.807,95	0,68%	383.414,54	-628.490,32	151.915,06	-153.158,57
ENGI11	780.545,70	25.955,24	8.645,37	0,37%	132.692,77	-171.720,05	114.428,00	-115.364,65
ENGI13	1.776.453,07	82.762,69	8.426,81	0,36%	355.280,61	-355.280,61	266.428,02	-262.599,76
EZTC3	65.798,27	12.307,04	1.565,85	0,07%	13.359,17	-20.038,48	9.792,63	-9.872,78
FLRY2	184.837,20	8.056,11	4.060,51	0,17%	36.967,44	-36.967,44	27.097,13	-27.318,94
GGBR4	1.299.144,22	104.567,09	17.364,58	0,74%	324.786,06	-324.786,06	190.454,54	-192.013,52
GOAU4	370.363,48	33.212,52	7.109,61	0,30%	111.109,04	-92.590,87	54.295,29	-54.739,72
HAPV3	859.504,32	107.291,73	7.443,95	0,32%	292.231,47	-292.254,76	126.003,33	-127.034,74
HYPE3	640.761,12	94.151,10	12.895,06	0,55%	147.372,89	-134.559,84	93.935,58	-94.704,49
IGTI11	241.312,20	22.627,03	2.695,62	0,12%	48.262,44	-48.262,44	35.376,37	-35.665,94
INDM24	-28.556,00	59.047,81	54.612,96	2,34%	507.422,55	-506.516,48	401.360,35	-403.452,43
IRBR3	184.278,24	25.282,32	8.706,92	0,37%	119.780,86	-101.353,03	117.019,75	-117.236,32
ITSA4	2.722.621,08	279.898,95	36.194,09	1,55%	517.298,01	-517.298,01	399.136,25	-402.403,40
ITUB4	7.981.621,76	730.940,19	102.544,99	4,39%	1.696.324,35	-1.516.508,13	1.170.105,75	-1.179.683,70
JBSS3	1.410.197,28	136.649,53	34.312,23	1,47%	493.569,05	-493.569,05	206.734,92	-208.427,16
KLBN11	863.124,48	108.437,38	-7.796,30	-0,33%	215.781,12	-172.624,90	126.534,05	-127.569,80
LFT20240901 - 210100	295.331,38	19,95	6,42	0,00%	-223,98	255,33	0,00	0,00
LFT20250901 - 210100	1.092.453,55	107,62	11,57	0,00%	-3.963,43	5.973,96	69,74	-106,17
LREN3	773.045,91	72.482,00	-6.332,44	-0,27%	154.609,18	-154.609,18	113.328,53	-114.256,19
LWSA3	95.888,60	19.840,43	-1.552,39	-0,07%	38.347,44	-38.347,44	14.054,34	-14.169,38
MLLJ3	226.626,66	54.352,77	7.628,50	0,33%	147.793,35	-101.936,56	33.206,67	-33.480,50
MRF03	166.206,60	17.056,75	919,24	0,04%	66.482,64	-49.861,98	24.365,89	-24.565,34
MRVE3	133.598,00	21.823,68	2.475,82	0,11%	40.079,40	-40.081,39	19.885,47	-19.745,78
MULT3	325.793,37	22.963,95	-1.159,78	-0,05%	97.738,01	-81.448,34	47.761,31	-48.152,26
NTCO3	744.161,04	110.562,91	509,50	0,02%	186.040,26	-186.044,75	109.094,01	-109.987,00
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PCAR3	58.928,16	12.373,16	2.694,78	0,12%	21.330,79	-21.332,80	8.638,87	-8.709,58
PETR3	5.583.354,74	1.175.660,97	394.707,00	16,88%	1.395.838,69	-1.675.019,04	818.519,81	-825.219,83
PETRA4	10.170.983,02	1.823.240,25	676.039,84	28,91%	2.542.745,76	-3.051.294,91	1.491.066,11	-1.503.271,29
PETZ3	77.328,78	18.816,24	1.857,90	0,08%	29.383,30	-39.437,68	11.336,40	-11.429,19
PRIO3	2.035.488,00	164.972,54	36.004,45	1,54%	1.221.292,80	-1.221.292,80	298.402,54	-300.845,13
RADL3	1.729.873,08	162.369,94	20.444,89	0,87%	345.974,62	-345.974,62	253.599,39	-255.674,25
RAIL3	1.301.952,96	86.773,21	17.494,18	0,75%	585.878,83	-429.644,48	190.866,30	-192.428,65
RAIZ4	193.511,34	18.005,56	5.981,95	0,26%	67.728,97	-67.728,97	28.368,76	-28.600,99
RDDOR3	1.610.024,00	140.655,21	31.964,48	1,37%	483.007,20	-483.007,20	236.029,52	-237.961,55
RECV3	317.632,83	34.519,87	7.500,36	0,32%	190.579,70	-190.579,70	46.564,97	-46.946,13
RENT3	2.217.381,75	179.365,81	9.919,90	0,42%	731.735,98	-578.519,26	325.068,17	-327.729,02
RRRP3	64.139,64	54.109,73	4.489,22	0,19%	248.615,78	-248.615,78	60.745,12	-61.242,36
SANB11	525.315,30	27.545,30	8.277,16	0,35%	105.063,06	-105.063,06	77.011,22	-77.641,60
SBS03	1.626.538,04	85.043,10	-3.346,09	-0,14%	364.134,51	-364.134,51	213.528,48	-215.276,32
SLEC3	198.077,84	12.594,99	1.146,65	0,05%	59.423,35	-59.423,35	29.038,21	-29.275,91
SMT03	215.768,73	25.256,88	328,32	0,01%	64.730,62	-64.731,37	31.631,70	-31.890,62
SOMA3	159.598,51	29.905,91	-3.455,75	-0,15%	47.879,55	-47.879,55	23.397,14	-23.588,66
SUZB3	2.117.830,42	268.806,57	-35.579,41	-1,52%	529.457,61	-423.566,08	310.473,94	-313.015,34
TAE11	408.058,92	19.428,55	-3.163,93	-0,14%	102.014,73	-102.014,73	59.821,44	-60.311,11

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – ABRIL 2024



Relatório de Risco de Mercado

Data: 30/04/2024

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

Dados Gerais							
PL:	115.486.868,99	VAR / PL:	2,0249%	Limite Fundo:	0,00%	Dutação DC:	6,92
VAR:	2.338.451,93	ETL / PL:	2,5393%	Status:	ENQUADRADO	Dutação DU:	4,41
ETL:	2.932.513,06	VAR / CDI:	0,0222%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	30.232.384,61	Cenário Baixa - 10000 (+):	6.262,24	CENARIO BRADESCO 1 (+):	16.702.724,37	CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00
Cenário Alta - 09999 (-):	-4.219,71	Cenário Baixa - 10000 (-):	-29.977.617,77	CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-16.838.347,03
Cenário Alta - 09999:	30.228.164,90	Cenário Baixa - 10000:	-29.971.355,53	CENARIO BRADESCO 1:	16.702.724,37	CENARIO BRADESCO 2:	-16.838.347,03

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
TIMS3	754.130,64	54.117,22	11.251,90	0,48%	241.321,81	-173.450,05	110.555,55	-111.460,51
TOTS3	750.520,08	57.330,18	14.826,93	0,63%	150.101,29	-150.104,02	110.026,24	-110.926,87
TRPL4	523.870,60	36.370,58	5.740,89	0,25%	104.774,12	-130.967,65	76.799,43	-77.428,08
UGPA3	1.488.623,95	167.514,66	38.987,04	1,67%	372.155,99	-297.724,79	218.232,27	-220.018,62
USIM5	215.982,55	42.957,42	1.223,94	0,05%	84.233,19	-47.516,16	31.663,04	-31.922,22
VALE3	14.079.746,56	1.577.499,11	355.844,42	15,22%	3.519.936,64	-3.519.936,64	2.064.090,85	-2.080.986,54
VAMO3	158.808,96	23.205,70	7.046,57	0,30%	55.563,14	-63.523,58	23.281,39	-23.471,96
VBVR3	1.385.805,96	149.161,19	51.079,32	2,18%	346.451,42	-346.451,42	203.159,11	-204.822,06
VVT3	1.061.694,18	78.053,11	27.828,47	1,19%	164.410,09	-155.441,54	155.644,37	-156.918,40
WEGE3	3.106.019,70	249.264,87	50.833,32	2,17%	776.504,93	-776.504,93	455.342,49	-459.069,71
YDUQ3	223.766,83	55.170,11	2.559,32	0,11%	93.025,04	-52.835,97	32.804,22	-33.072,74
Total Var:	115.486.165,76	12.167.688,63	2.338.451,93	99,99%	30.228.164,91	-29.971.355,52	16.702.724,37	-16.838.347,03

3. RISCO DE CRÉDITO

Para o acompanhamento do risco de crédito da carteira, a Entidade adotará as notas emitidas por agências de *rating* (agências de avaliação de risco de crédito) para os títulos privados de crédito. Limites de alocação por classificação de risco e a lista das agências de *rating* estão definidas na Política de Investimento dos Planos administrados pela EMBRAER PREV. O seguinte relatório elaborado pelo administrador é utilizado pela EMBRAER PREV para o controle de risco de crédito:

3.1. Relatório de Risco de Crédito



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

30/04/2024

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	664.591,13	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	245.889,12	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	147.533,47	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	20/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	491.574,04	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	25/08/17	25/08/17	15/08/24	PETR	9.600.801,05	AAA	Aaa.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	18/12/17	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	2.978.164,01	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	21/12/17	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	869.317,09	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/01/18	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	3.086.787,79	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB II	19/02/18	19/02/18	15/02/25	SABESP	4.845.068,70	brAAA	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/02/18	19/02/18	15/02/25	SABESP	3.006.894,41	brAAA	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	13/03/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	12.962.045,70	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB II	23/05/18	23/05/18	15/05/28	COMGAS	26.363.717,75	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	638.253,15	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	638.253,15	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	638.253,15	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	637.060,31	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	638.253,15	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	04/07/18	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	13.131.827,10	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/07/18	26/07/18	15/07/25	AEGEA SA	15.108.615,89	brA	Aa1.br	AA(bra)
FI RF EMB II	26/07/18	26/07/18	15/07/25	CSMG	8.186.439,70	-	Aa3.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/02/13	15/02/25	CEMG	686.852,89	brA+	A1.br	AA-(bra)
FIM EMB I A	12/02/19	09/01/19	15/01/25	ITAUBBB	2.580.031,11	-	AAA.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	590.191,96	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	3.736.936,59	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	2.128.096,00	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	6.433.943,59	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	745.689,85	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	6.033.308,81	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	8.948.278,23	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	921.943,82	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	645.522,45	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	30/09/20	28/09/20	22/09/25	HAPVIDA	170.060,66	-	-	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	05/02/21	07/08/19	15/07/24	COPEL GT	146.914,15	-	-	AA+(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	6.290.128,80	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	6.302.133,38	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	4.479.520,85	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/07/19	15/06/29	NEOENERG	649.233,23	brAA+	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/07/19	15/06/29	NEOENERG	6.453.702,33	brAA+	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	1.854.950,18	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	3.555.252,90	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	3.803.765,59	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	31/07/20	15/07/34	IGUA SAN	2.652.074,40	brAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	23/05/18	15/05/28	COMGAS	22.959.894,20	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	247.692,47	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	435.938,75	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	495.384,95	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	247.692,47	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	303.175,59	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	255.540,94	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	741.414,71	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	26/10/16	27/01/25	BRADESCO	15.031.931,05	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	12/12/17	15/11/24	CCR	3.248.122,59	brAAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	14/12/17	15/11/24	ECORODOV	2.164.838,39	brAA	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	19/02/18	15/02/25	SABESP	706.165,27	brAAA	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	23/05/18	15/05/28	COMGAS	10.204.274,29	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	28/06/18	15/06/27	JAGUARA	1.628.192,12	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	28/06/18	15/06/27	ENERGMIR	1.038.145,83	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	31/07/18	01/08/25	BRADESCO	4.845.243,96	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	191.423,25	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	334.970,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	22/12/20	15/12/26	IRB	2.755.514,68	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	164.000,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	879.912,90	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	76.875,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	1.411.655,00	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	07/04/21	15/03/31	LOCALIZA	5.368.575,39	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	1.731.029,91	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/06/21	06/01/21	15/11/25	QUATA	592.491,92	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	19.205,78	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	219.826,92	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	518.556,17	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	347.603,75	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	347.603,75	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	263.742,48	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	536.061,95	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	528.021,02	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	892.819,51	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	222.945,03	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	129.639,04	-	-	AAA(bra)

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – ABRIL 2024



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

30/04/2024

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	324.440,57	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	1.042.096,03	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	14/06/21	19/06/19	19/06/24	BNBBM	630.227,19	brAAA	AAb	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	14/06/21	12/06/19	12/06/24	BNBBM	955.342,67	brAAA	AAb	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	15/06/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	83.230,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	16/06/21	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	372.536,04	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	17/06/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	835.103,79	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	17/06/21	18/03/21	15/02/26	CORSAN	515.565,36	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	18/06/21	18/06/21	15/12/30	MG050	527.283,78	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	50.225,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	806.321,42	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	260.350,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	92.118,53	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	25/06/21	25/06/21	20/06/26	OURO VER	1.482.579,70	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	3.411.797,27	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	01/07/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	2.984.185,35	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	02/07/21	01/03/21	18/02/25	RENNER	565.715,17	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	02/07/21	01/03/21	18/02/25	RENNER	119.640,76	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/07/21	07/04/21	15/03/29	CAGECE	1.258.298,32	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIVADO	08/07/21	08/07/21	15/06/31	VAMOS	270.093,47	brAA+	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/07/21	07/04/21	15/03/29	CAGECE	2.867.722,88	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	12/07/21	12/07/21	12/07/26	BRDESCO	4.502.758,45	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	2.164.340,53	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	238.398,28	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	1.051.251,11	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	299.710,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	546.650,58	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	264.450,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	387.860,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	193.930,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	2.005.833,84	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	313.558,33	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	4.328.681,05	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	373.278,63	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	373.278,63	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	1.330.819,47	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	15/07/21	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	854.276,85	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/07/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	2.479.794,30	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	19/07/21	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	-	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	331.690,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/07/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	2.053.130,11	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/07/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	752.332,11	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	11/06/18	10/05/24	INTERVIA	1.330.882,75	-	Aa2.br	-
FIM EMB I A	21/07/21	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.089.977,59	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	877.934,58	-	-	AA-(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	20/09/19	20/08/26	VAMOS	1.047.372,78	brAA+	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	23/07/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.581.851,34	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	29/07/21	07/11/19	15/10/24	BKBR	1.016.489,60	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	29/07/21	23/12/20	15/12/26	RD COLIN	2.164.011,37	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	04/08/21	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	378.371,08	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	06/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	662.371,70	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	11/08/21	11/08/21	15/08/31	CSAN	1.051.597,01	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	11/08/21	19/11/19	15/06/27	AUTOPIST	1.150.720,85	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	17/08/21	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	2.880.657,80	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	18/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	1.228.613,92	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	18/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	953.393,86	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	27/08/21	27/08/21	20/08/31	S LUIZ A	1.037.159,20	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	686.831,82	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	61.507,33	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	307.536,64	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/06/19	15/06/24	PROLAGOS	1.149.362,09	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	12/05/21	15/04/26	ELETROB	1.991.052,22	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/09/21	22/10/19	21/10/26	AUTOBAN	449.956,76	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	20/09/21	20/09/21	15/09/29	MOV_PART	1.040.082,84	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.054.567,56	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.054.567,56	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	1.107.528,00	brAA+	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	858.301,11	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	858.301,11	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	285.327,13	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	285.327,13	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	783.089,50	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	783.089,50	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	1.006.276,46	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	390.899,70	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	390.899,70	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	23/09/21	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	4.033.362,53	brAAA	-	-

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – ABRIL 2024



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

30/04/2024

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	23/09/21	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	4.286.251,36	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	30/09/21	30/09/21	15/09/31	SIMPAP	860.243,62	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	04/10/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	650.520,12	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	08/10/21	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	2.546.811,72	-	-	AA-(bra)
FIM EMB I A	20/10/21	20/10/21	20/10/25	DAYCOVAL	2.891.711,42	brAA+	AA.br	AA(bra)
FIM EMB I A	20/10/21	20/10/21	20/10/24	DAYCOVAL	1.597.699,61	brAA+	AA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/10/21	22/10/21	15/12/35	CART	2.400.036,15	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	22/10/21	22/10/21	15/12/35	CART	901.476,99	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	25/10/21	22/04/21	15/03/26	VIX LOGI	114.144,09	-	-	A+(bra)
FIM EMB I A	27/10/21	27/10/21	15/10/29	CONT GLO	1.892.085,10	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/10/21	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	872.981,54	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	04/11/21	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	3.423.357,30	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/11/21	10/11/21	15/10/28	LIGHT	371.294,34	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	12/11/21	12/11/21	15/10/31	VAMOS	2.102.115,64	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/11/21	27/07/21	15/06/39	ANEMJUS	12.109,43	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/11/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	2.229.289,39	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/11/21	27/07/21	15/06/39	ANEMJUS	2.356.495,38	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	03/12/21	11/06/19	11/06/24	BNBMM	630.926,20	brAAA	AAbr	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/12/21	06/12/21	15/12/35	TESC	2.805.784,99	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/12/21	06/01/21	15/11/25	QUATA	2.653.950,75	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	20/12/21	20/12/21	15/11/35	ORIZON	2.208.335,10	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/01/22	22/04/21	15/03/26	VIX LOGI	656.841,17	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	13/01/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	207.703,31	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/01/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	373.768,80	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/01/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	2.219.462,11	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	374.639,79	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	362.932,30	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	3.017.089,26	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	866.354,51	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	772.694,56	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/03/22	27/07/21	15/06/39	ANEMJUS	1.081.372,24	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	19/04/22	19/04/22	16/04/29	VERT-10	421.110,26	-	-	AAAs(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	26/04/22	26/04/22	15/04/50	LIGHT	984.452,45	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	105.582,52	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.219.391,52	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	12/05/22	12/05/22	15/04/27	BRKA	1.895.280,19	-	A+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	12/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.461.712,05	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	26/05/22	26/05/22	10/05/27	GUAR	2.631.073,35	-	-	A
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	2.491.944,67	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	552.580,45	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.124.194,17	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	03/03/22	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	3.356.702,89	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/03/22	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	2.470.349,82	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/03/22	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	1.102.446,19	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/03/22	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	3.391.969,11	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/03/22	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	2.715.028,84	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/06/22	06/12/21	15/12/35	TESC	873.204,49	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	442.064,36	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	06/12/21	15/12/35	TESC	547.704,60	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	27/07/21	15/06/39	ANEMJUS	276.095,04	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	13/06/22	30/09/21	15/09/31	SIMPAP	1.851.787,59	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	13/06/22	08/07/21	15/06/31	VAMOS	919.603,51	brAA+	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	13/06/22	08/07/21	15/06/31	VAMOS	75.025,93	brAA+	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	13/06/22	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	730.309,57	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	13/06/22	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	825.831,63	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/06/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	1.364.256,11	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	27/06/22	27/06/22	07/07/24	LAGE	2.546.215,50	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	3.345.230,74	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	12/11/21	15/10/31	VAMOS	2.032.745,82	brAA+	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	12/11/21	15/10/31	VAMOS	1.524.033,84	brAA+	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	27/07/22	25/03/22	15/03/44	GBS PART	1.013.973,00	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	28/07/22	28/07/22	18/07/25	1V11	1.697.536,74	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	29/07/22	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	1.851.539,68	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/08/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	1.290,83	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	457.030,91	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	07/04/21	15/03/29	CAGECE	1.555.316,59	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	07/04/21	15/03/29	CAGECE	2.591.426,82	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/08/22	30/08/22	15/08/29	TRBR	5.770.136,54	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	02/09/22	02/09/22	02/09/29	AEGEA SA	1.728.286,98	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	27/09/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	55.505,78	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	28/09/22	28/09/22	28/09/27	B.BRASIL	4.676.668,99	-	AAA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/10/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	38.724,96	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	03/11/22	06/04/21	15/03/29	ANET	1.720.485,08	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/11/22	08/11/22	15/06/42	BRK AMBI	5.439.175,90	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/11/22	02/05/22	15/04/38	RDVE	1.832.060,30	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/11/22	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	1.615.959,81	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	11/11/22	11/11/22	15/10/40	RAHOLD	2.729.101,61	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	11/11/22	11/11/22	15/10/40	RAHOLD	7.100.984,07	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	3.980.979,79	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	1.792.042,26	-	-	AA(bra)



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

30/04/2024

Fundo	INFORMAÇÕES DOS ATIVOS					INFORMAÇÕES DE RATING		
	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	1.467.309,77	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.429.802,71	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.740.484,14	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.425.348,50	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	01/12/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	1.712.273,62	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	2.146.951,97	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	2.277.577,75	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	1.661.292,01	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/12/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	3.051.349,25	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	15/12/21	15/11/36	ITAPOA T	1.279.876,15	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	02/05/22	15/04/38	RDVE	2.120.151,47	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	3.217.475,97	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/01/23	26/01/23	20/01/26	CELG	2.419.947,11	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/03/23	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	324.716,26	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	1.235.619,34	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	15/12/21	15/11/36	ITAPOA T	3.885.919,20	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	27/07/22	15/04/36	BRV_VDR	8.869.067,36	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	20/03/23	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	952.838,94	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	14/04/23	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	675.035,76	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	17/04/23	17/04/23	17/03/30	VERO	2.950.683,93	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	20/04/23	12/05/22	15/04/27	BRKA	1.125.541,86	-	A+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	20/04/23	12/05/22	15/04/27	BRKA	31.070,17	-	A+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/04/23	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	2.227.647,51	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	1.887.406,60	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	2.241.709,46	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	18/06/21	15/12/30	MG050	3.198.503,40	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	08/11/22	15/06/42	BRK AMBI	1.365.399,55	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	08/07/21	15/06/31	VAMOS	1.056.793,78	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	773.441,05	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	22/10/21	15/12/35	CART	1.545.389,13	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	2.378.674,46	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	02/10/20	15/09/34	BRKA	296.205,23	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	02/10/20	15/09/34	BRKA	2.827.312,37	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	18/03/21	15/02/31	CORSAN	1.636.571,45	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	22/10/21	15/12/35	CART	667.327,12	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	10/02/21	15/12/31	METRORIO	5.196.259,93	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/05/23	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	219.675,56	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/05/23	08/11/22	15/06/42	BRK AMBI	2.388.564,12	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/05/23	22/10/21	15/12/35	CART	2.201.008,76	brAA+	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.132.027,47	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	16/05/23	23/12/20	15/12/27	SABESP	2.372.521,51	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	21/07/21	15/07/31	CACHOEIR	1.836.503,59	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	29/10/21	15/10/26	COELBA	1.829.204,01	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	04/05/22	15/04/27	LOCALIZA	2.825.802,08	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	26/05/23	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	60.809,64	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	02/06/23	25/06/21	20/06/26	OURO VER	297.353,55	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/06/23	25/03/22	15/03/44	GBS PART	2.867.746,40	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/06/23	26/07/21	15/06/33	ASA BRAN	2.755.364,58	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	23/06/23	23/06/23	15/05/43	IGUA RJ	1.346.874,38	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	28/06/23	08/07/21	15/06/31	VAMOS	1.060.009,17	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	28/06/23	28/07/22	18/07/25	1V11	385.190,29	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/07/23	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	1.526.997,56	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/07/23	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	1.022.628,14	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/07/23	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	1.022.628,14	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/07/23	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	1.526.997,56	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	13/07/23	28/07/22	18/07/25	1V11	1.168.029,87	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	13/07/23	28/07/22	18/07/25	1V11	285.518,41	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	21/07/23	23/12/20	15/12/26	RD COLIN	1.612.379,79	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	1.536.171,73	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	1.536.171,73	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	15/12/21	15/11/36	ITAPOA T	2.514.712,68	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	26/07/21	15/06/33	ASA BRAN	2.712.091,53	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	01/08/23	31/07/23	25/07/28	TIMS	2.558.268,32	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/23	17/04/23	17/03/30	VERO	1.302.592,83	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/23	06/12/21	15/12/35	RESC	2.050.288,95	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/23	02/05/22	15/04/38	RDVE	3.152.789,95	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/08/23	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.215.020,70	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/08/23	05/06/18	05/06/28	BRADESCO	4.172.510,44	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	21/08/23	08/08/23	15/01/34	SPERIO4	2.421.829,46	brAA+	-	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	29/08/23	29/08/23	29/08/25	BRADESCO	10.855.965,27	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	30/08/23	30/08/23	01/09/25	VOLKSWAG	6.519.768,62	brAAA	AAA.br	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	08/09/23	08/09/23	08/09/25	B VOTORA	6.505.737,45	brAAA	AA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/09/23	06/01/21	15/11/25	QUATA	2.581,66	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	19/09/23	13/09/23	15/09/25	PANAMERI	5.364.742,61	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	21/09/23	21/09/23	15/09/28	ELETROB	2.605.438,18	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	28/09/23	28/09/23	15/09/30	CSMG	2.554.399,96	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	29/09/23	19/05/21	10/05/30	RODO BR	2.663.462,64	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	29/09/23	06/09/21	20/08/31	S LUZ A	1.482.901,63	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	29/09/23	13/09/23	15/09/25	B VOTORA	5.358.831,00	brAAA	AA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	02/10/23	14/11/22	10/10/31	CORREDOR	2.293.333,30	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	20/10/23	20/10/23	20/10/28	SANTANDE	4.248.318,13	-	AAA.br	A-(bra)



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

30/04/2024

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/11/23	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	2.998.232,82	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/11/23	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	3.081.046,98	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/11/23	18/03/21	15/02/31	CORSAN	3.055.088,02	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/11/23	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	3.074.248,36	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/11/23	18/06/21	15/12/30	MG050	959.656,48	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	17/11/23	23/08/22	15/08/32	PETRJ	4.554.626,86	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	23/11/23	29/09/22	15/09/28	VERT5	2.507.760,44	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	23/11/23	10/12/21	17/11/28	DESKTOP	2.695.447,39	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/12/23	12/02/21	15/12/35	MS 306	1.064.480,75	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/12/23	30/08/22	15/08/29	TRBR	1.993.766,33	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/12/23	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.007.765,93	-	Aa3.br	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	26/12/23	27/12/22	02/06/26	BRADESCO	10.444.229,15	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	08/01/24	08/01/24	08/01/26	DAYCOVAL	10.379.659,14	brAA+	AA.br	AA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	08/01/24	08/01/24	08/01/26	B.ALFA	10.351.352,97	-	AAA.br	AA+(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	08/01/24	08/01/24	08/01/26	ABC	10.391.274,49	brAAA	AA+.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	17/04/23	17/03/30	VERO	2.861.626,93	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	2.123.271,42	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	2.123.271,42	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	25/03/22	15/03/44	GBS PART	2.027.946,00	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	25/03/22	15/03/44	GBS PART	2.027.946,00	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	983.089,14	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	1.967.304,38	brA	-	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	11/01/24	27/12/22	02/06/26	BRADESCO	10.979.949,98	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	18/01/24	18/01/24	04/01/27	TOYOTA	6.408.837,25	brAAA	-	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	24/01/24	24/01/24	26/01/26	ABC	10.334.523,27	brAAA	AA+.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	24/01/24	24/01/24	25/01/27	BTG PACT	4.405.029,48	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	25/01/24	25/01/24	26/01/26	BTG PACT	6.618.694,35	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	26/01/24	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	1.066.373,55	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	26/01/24	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.260.390,32	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	26/01/24	22/04/21	15/03/26	VIX LOGI	1.317.783,32	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	30/01/24	28/04/21	15/04/31	MANAUSEN	2.380.074,72	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	30/01/24	01/06/23	25/05/26	LM TRANS	2.661.551,55	-	AA+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	30/01/24	27/10/21	15/10/29	CONT GLO	2.400.636,48	-	-	AA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	31/01/24	31/01/24	02/02/26	B.ALFA	10.886.742,76	-	AAA.br	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/02/24	08/02/24	15/09/31	PLANALTO	3.015.728,01	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	15/02/24	15/02/24	15/12/43	AGUAS SE	2.126.814,46	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	20/02/24	14/05/21	10/05/24	INTERVIA	2.646.889,27	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	20/02/24	12/11/21	30/04/29	HAPVIDA	533.787,29	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	21/02/24	18/03/21	15/02/26	CORSAN	1.294.069,05	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	21/02/24	19/05/22	13/05/28	CEA MODA	1.665.362,36	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	21/02/24	07/11/19	15/10/24	BKBR	1.480.713,19	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	21/02/24	19/04/22	16/04/29	VERT-10	1.633.244,41	-	-	AAAsf(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	26/02/24	07/04/21	15/03/26	CAGECE	2.475.786,71	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	26/02/24	24/03/22	11/03/27	ARTERIS	2.495.434,99	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	26/02/24	16/02/24	15/02/34	NTRASSUD	2.655.096,83	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	290.534,93	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	18/06/21	15/12/30	MG050	300.551,75	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	02/05/22	15/04/38	RDVE	796.927,52	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	805.817,66	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	290.534,93	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	12/02/21	15/12/35	MS 306	312.748,08	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	1.007.104,39	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	503.552,19	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	10/02/21	15/12/31	METRORIO	500.400,09	brAAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	15/12/21	15/11/36	ITAPOA T	391.594,56	-	AA.br	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	26/02/24	26/02/24	01/03/27	BTG PACT	10.811.618,47	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	05/03/24	05/03/24	24/08/26	B VOTORA	6.618.328,04	brAAA	AA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	12/03/24	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	1.999.536,26	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	21/03/24	23/06/23	15/05/43	IGUA RJ	1.194.228,62	brAA+	-	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	05/04/24	05/04/24	06/04/26	PSA	6.542.874,75	-	Aaa.br	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	-	FIDC CREDZ SN6	962.728,27	brAA (sf)	-	A+(sf)(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	-	FIDC VERDECARD SN5	29.180,50	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	-	VERDECARD FIDC SN6	972.702,39	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	-	FIDC VERDECARD SN8	1.375.649,69	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	-	RB CAP CREDIT AL SN3	588.322,12	brAA-(sf)	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	-	BR ELETRO FIDC S1	1.673.398,34	-	-	Aasf(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	-	INSS CONS PDL I FIDC	1.084.721,92	-	-	AAAsf(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	-	-	-	DRIVER SIX FIDC SN	1.023.678,60	-	AAA.br	-

Observação: Em abril de 2024, 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 **4.885.450.265,00**

Tópico do Enquadramento	Limite	Aplicação Atual	Valor Limite	% Aplicado	Status
% do Segmento RF/PL PLANO	100,00%	4.293.022.286,14	4.885.450.265,00	87,87%	Enquadrado
% do PL em Títulos de Emissão do Tesouro Nacional e/ou do BACEN	100,00%	3.438.959.590,64	4.885.450.265,00	70,39%	Enquadrado
% do PL em Títulos RF1, exceto títulos do Tesouro Nacional	80,00%	854.062.695,51	3.908.360.270,24	17,48%	Enquadrado
% do PL em FIDC	20,00%	Verificar Rel. de Diversificação de FIDC's	977.090.067,56	0,00%	Enquadrado
% do PL em uma mesma pessoa jurídica não-financeira	10,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Não Financ.	488.545.033,78	0,00%	Enquadrado
% do PL em Instituições Financeiras	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Financ.	1.221.362.566,25	0,00%	Enquadrado
% de uma mesma Série de Debêntures	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Debêntures	1.221.362.566,25	0,00%	Enquadrado
% do PL em RV	70,00%	486.104.276,66	3.419.815.127,26	9,95%	Enquadrado
% do capital votante de uma empresa	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação RV	1.221.362.566,25	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Imobiliários	20,00%	78.981.852,44	977.090.067,56	1,62%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Empréstimos	15,00%	25.635.148,02	732.817.568,87	0,52%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Estruturados	20,00%	0,00	977.090.067,56	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos no Exterior	10,00%	0,00	488.545.033,78	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 ABRIL DE 2024 À 30 DE ABRIL DE 2024



FIM EMB I A												
FONTE ANBIMA												
DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
03/04/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	5,9428%	5,9256%	5,7726%	6,0773%	0,0172%	NÃO
05/04/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-F	01/01/2035	Venda	11,2460%	11,3690%	10,8325%	11,6169%	-0,1230%	NÃO
08/04/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-F	01/01/2035	Venda	11,3260%	11,3318%	10,9328%	11,7170%	-0,0058%	NÃO
09/04/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,9695%	5,9600%	5,8296%	6,1343%	0,0095%	NÃO
17/04/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1510%	6,1260%	5,9825%	6,2884%	0,0250%	NÃO
17/04/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1510%	6,1260%	5,9825%	6,2884%	0,0250%	NÃO
17/04/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1510%	6,1260%	5,9825%	6,2884%	0,0250%	NÃO
17/04/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1505%	6,1260%	5,9825%	6,2884%	0,0245%	NÃO
18/04/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1405%	6,0965%	5,9772%	6,2836%	0,0440%	NÃO
18/04/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1405%	6,0965%	5,9772%	6,2836%	0,0440%	NÃO
18/04/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1405%	6,0965%	5,9772%	6,2836%	0,0440%	NÃO
18/04/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1405%	6,0965%	5,9772%	6,2836%	0,0440%	NÃO
18/04/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1405%	6,0965%	5,9772%	6,2836%	0,0440%	NÃO
18/04/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1405%	6,0965%	5,9772%	6,2836%	0,0440%	NÃO
18/04/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1405%	6,0965%	5,9772%	6,2836%	0,0440%	NÃO
19/04/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	6,0895%	6,0900%	5,9478%	6,2541%	-0,0005%	NÃO
22/04/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	6,0795%	6,0800%	5,9414%	6,2475%	-0,0005%	NÃO
25/04/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1305%	6,1400%	5,9821%	6,2885%	-0,0095%	NÃO
25/04/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1305%	6,1400%	5,9821%	6,2885%	-0,0095%	NÃO
30/04/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	6,1195%	6,2330%	5,9779%	6,2842%	-0,1135%	NÃO
30/04/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	6,1195%	6,2330%	5,9779%	6,2842%	-0,1135%	NÃO

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – ABRIL 2024

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE ABRIL DE 2024 À 30 DE ABRIL DE 2024



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.		
04/04/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	LFT	01/03/2030	Venda	0,1803%	0,1798%	0,1605%	0,1900%	0,0005%	NÃO
04/04/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	LFT	01/03/2030	Venda	0,1803%	0,1798%	0,1605%	0,1900%	0,0005%	NÃO
12/04/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	LIQUIDEZ	LTN	01/01/2028	Venda	10,9861%	10,9803%	10,4837%	11,3177%	0,0058%	NÃO
12/04/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2027	Compra	5,8978%	5,9120%	5,6953%	6,1265%	-0,0142%	NÃO
12/04/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2029	Compra	5,9120%	5,9227%	5,7213%	6,1494%	-0,0107%	NÃO
12/04/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	TERRA	NTN-B	15/08/2050	Compra	6,0171%	6,0231%	5,8821%	6,1872%	-0,0060%	NÃO
23/04/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	LTN	01/01/2026	Compra	10,4438%	10,5376%	10,1347%	10,8734%	-0,0938%	NÃO
23/04/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	LTN	01/07/2026	Compra	10,7005%	10,7289%	10,2877%	11,0929%	-0,0284%	NÃO
24/04/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	LFT	01/09/2026	Venda	0,0485%	0,0480%	0,0428%	0,0802%	0,0005%	NÃO

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE ABRIL DE 2024 À 30 DE ABRIL DE 2024



FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO

DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	FONTE ANBIMA			FORA DO TÚNEL	
								TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.		
02/04/2024	FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	ICATU VA	LIQUIDEZ	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,9190%	5,9200%	5,7696%	6,0742%	-0,0010%	NÃO
05/04/2024	FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	ICATU VA	AMERICA	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,9690%	5,9900%	5,8120%	6,1165%	-0,0210%	NÃO
17/04/2024	FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	ICATU VA	N FUTURA	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1035%	6,1260%	5,9825%	6,2884%	-0,0225%	NÃO
17/04/2024	FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	ICATU VA	N FUTURA	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1035%	6,1260%	5,9825%	6,2884%	-0,0225%	NÃO
19/04/2024	FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	ICATU VA	CONCORDI	NTN-B	15/08/2026	Compra	6,2890%	6,2128%	6,0486%	6,5260%	0,0762%	NÃO
19/04/2024	FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	ICATU VA	GUIDE CT	NTN-B	15/08/2026	Compra	6,3090%	6,2128%	6,0486%	6,5260%	0,0962%	NÃO
19/04/2024	FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	ICATU VA	GUIDE CT	NTN-B	15/08/2026	Compra	6,2990%	6,2128%	6,0486%	6,5260%	0,0862%	NÃO

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – ABRIL 2024

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE ABRIL DE 2024 À 30 DE ABRIL DE 2024



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
01-04-24	FIA RVA EMB II	Venda	ARZ3	63,05	8.900,00	561.151,78	62,35	62,94	64,26	8.810,00
01-04-24	FIA RVA EMB II	Compra	GMAT3	8,48	15.100,00	128.107,59	8,41	8,55	8,78	12.326,00
01-04-24	FIA RVA EMB II	Venda	JBSS3	20,93	13.900,00	290.907,50	20,84	20,96	21,37	26.434,00
01-04-24	FIA RVA EMB II	Compra	MRFG3	10,27	17.400,00	178.748,67	10,09	10,23	10,35	16.475,00
01-04-24	FIA RVA EMB II	Venda	STBP3	13,05	16.400,00	214.006,16	12,94	13,02	13,35	16.924,00
01-04-24	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	64,53	1.600,00	103.244,21	64,00	64,57	65,30	21.988,00
01-04-24	FIA RVA EMB II	Compra	VBRR3	25,20	4.000,00	100.807,00	25,00	25,18	25,39	26.570,00
01-04-24	FIA RVA EMB II	Compra	VBRR3	25,18	6.000,00	151.084,00	25,00	25,18	25,39	26.570,00
01-04-24	FIA RVA EMB II	Compra	VIVA3	25,14	21.600,00	542.943,22	24,84	25,17	25,95	13.855,00
01-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	23,75	800,00	19.000,97	23,59	23,77	24,04	6.420,00
01-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	32,67	1.400,00	45.741,69	32,38	32,67	32,80	12.044,00
01-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	35,71	800,00	28.571,34	35,51	35,75	36,64	17.816,00
01-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	5,44	20.800,00	113.151,03	5,38	5,42	5,47	11.931,00
01-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPL66	9,54	1.400,00	13.351,00	9,50	9,54	9,68	29.619,00
01-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	41,00	1.300,00	53.295,06	40,83	41,22	42,19	21.519,00
01-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENJU3	1,81	100,00	180,87	1,74	1,82	1,87	1.370,00
01-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQL3	32,03	6.900,00	221.027,40	31,80	32,05	32,37	20.929,00
01-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQL3	31,90	1.100,00	35.090,00	31,80	32,05	32,37	20.929,00
01-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQL3	32,08	1.700,00	54.536,00	31,80	32,05	32,37	20.929,00
01-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	14,90	800,00	11.923,20	14,86	14,90	15,03	4.572,00
01-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,74	17.900,00	66.953,53	3,66	3,82	3,95	44.099,00
01-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	22,91	10.300,00	236.021,16	22,63	22,95	23,21	19.375,00
01-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,25	1.900,00	19.466,59	10,17	10,28	10,55	22.364,00
01-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	PETRA	38,36	100,00	3.836,02	38,06	38,39	38,70	15.668,00
01-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRIQ3	48,45	300,00	14.533,86	48,21	48,49	48,94	15.674,00
01-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	22,04	1.800,00	39.676,78	21,95	22,05	22,30	20.413,00
01-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	23,28	2.800,00	65.196,99	23,10	23,28	23,77	10.175,00
01-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	52,86	3.000,00	158.588,54	52,62	53,18	55,09	23.869,00
01-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	53,30	300,00	15.989,00	52,62	53,18	55,09	23.869,00
01-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	25,96	1.500,00	38.944,86	25,54	25,89	26,15	4.297,00
01-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	7,43	6.200,00	46.039,64	7,39	7,45	7,63	12.940,00
01-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	7,53	400,00	3.012,00	7,39	7,45	7,63	12.940,00
01-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	SRNA3	9,50	2.900,00	27.537,71	9,18	9,37	9,56	11.375,00
01-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	64,45	3.200,00	206.250,26	64,00	64,57	65,30	21.988,00
01-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQL3	32,11	8.048,00	258.413,29	31,80	32,05	32,37	20.929,00
01-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQL3	31,98	5.736,00	183.453,95	31,80	32,05	32,37	20.929,00
01-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQL3	32,13	1.122,00	36.048,28	31,80	32,05	32,37	20.929,00
01-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQL3	32,02	2.168,00	69.421,48	31,80	32,05	32,37	20.929,00
01-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	25,17	11.269,00	283.610,96	25,00	25,18	25,39	26.570,00
01-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	25,18	2.074,00	52.230,55	25,00	25,18	25,39	26.570,00
01-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	25,17	3.938,00	99.131,91	25,00	25,18	25,39	26.570,00
02-04-24	FIA RVA EMB II	Venda	AZUL4	12,71	38.500,00	489.187,31	12,60	12,74	13,09	13.794,00
02-04-24	FIA RVA EMB II	Venda	LIQQ3	5,73	38.600,00	221.351,00	5,44	5,63	5,79	6.645,00
02-04-24	FIA RVA EMB II	Compra	LREN3	17,50	18.000,00	314.940,00	16,84	17,36	17,62	34.955,00
02-04-24	FIA RVA EMB II	Compra	PETRA	38,15	14.300,00	545.542,33	37,77	38,25	38,65	93.178,00
02-04-24	FIA RVA EMB II	Venda	SBS3	82,42	1.700,00	140.115,84	81,39	82,08	83,70	14.020,00
02-04-24	FIA RVA EMB II	Venda	TOTS3	27,39	10.700,00	293.020,95	27,28	27,72	28,19	15.067,00
02-04-24	FIA RVA EMB II	Compra	VALE3	62,30	6.600,00	411.174,27	61,30	61,98	62,47	48.541,00
02-04-24	FIA RVA EMB II	Compra	VBRR3	25,08	6.700,00	168.005,00	24,88	25,21	25,50	24.059,00
02-04-24	FIA RVA EMB II	Compra	VIVT3	50,52	1.700,00	85.876,40	50,26	50,54	50,85	6.866,00
02-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	23,56	1.900,00	44.770,13	23,33	23,59	23,83	11.995,00
02-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	34,94	200,00	6.987,31	34,77	35,18	35,70	23.381,00
02-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	34,90	1.900,00	66.310,00	34,77	35,18	35,70	23.381,00
02-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	5,44	19.800,00	107.683,31	5,38	5,43	5,49	13.945,00
02-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL66	9,47	4.700,00	44.523,04	9,39	9,49	9,60	21.265,00
02-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	40,76	2.100,00	85.593,89	40,39	40,73	41,08	17.753,00
02-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,64	3.400,00	42.960,74	12,54	12,64	12,78	13.907,00
02-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	14,77	1.600,00	23.628,71	14,68	14,77	14,88	4.990,00
02-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	14,75	1.400,00	20.650,00	14,68	14,77	14,88	4.990,00
02-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,82	28.000,00	107.033,04	3,77	3,84	3,94	46.776,00
02-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	22,71	4.800,00	109.013,85	22,55	22,76	23,25	15.715,00
02-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	22,75	900,00	20.475,00	22,55	22,76	23,25	15.715,00
02-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	10,18	10.600,00	107.864,09	10,11	10,16	10,23	21.210,00
02-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	MGLU3	1,75	28.000,00	48.923,52	1,72	1,74	1,78	33.599,00
02-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	21,76	9.800,00	213.242,46	21,00	21,55	21,95	25.194,00
02-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	52,02	800,00	41.613,32	51,51	52,10	52,71	25.612,00
02-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	51,55	800,00	41.240,00	51,51	52,10	52,71	25.612,00
02-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	64,89	5.000,00	324.457,70	64,30	64,98	65,51	24.894,00
02-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	17,25	2.900,00	50.031,00	17,07	17,42	18,12	17.503,00
02-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	17,13	1.900,00	32.547,00	17,07	17,42	18,12	17.503,00
02-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQL3	32,22	1.217,00	39.205,66	31,69	32,13	32,41	17.580,00
02-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQL3	32,28	1.521,00	49.096,89	31,69	32,13	32,41	17.580,00
02-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQL3	32,15	4.215,00	135.512,70	31,69	32,13	32,41	17.580,00
02-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	27,39	6.291,00	172.282,60	27,07	27,72	28,29	21.296,00
02-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	27,21	838,00	22.801,98	27,07	27,72	28,29	21.296,00
02-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	27,21	662,00	18.011,44	27,07	27,72	28,29	21.296,00
02-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	25,09	2.077,00	52.121,14	24,88	25,21	25,50	24.059,00
02-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	25,17	3.756,00	94.535,12	24,88	25,21	25,50	24.059,00
02-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	25,10	1.483,00	37.223,30	24,88	25,21	25,50	24.059,00
02-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	25,06	1.940,00	48.619,59	24,88	25,21	25,50	24.059,00
02-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	25,32	4.153,00	105.144,49	24,88	25,21	25,50	24.059,00
03-04-24	FIA RVA EMB II	Venda	B3SA3	11,60	31.500,00	365.400,00	11,51	11,63	11,78	30.407,00
03-04-24	FIA RVA EMB II	Compra	PETRA	38,60	7.600,00	293.364,66	38,22	38,50	39,01	43.631,00
03-04-24	FIA RVA EMB II	Compra	PETRA	38,30	11.300,00	432.837,00	38,22	38,50	39,01	43.631,00
03-04-24	FIA RVA EMB II	Compra	PETRA	38,74	1.900,00	73.607,78	38,22	38,50	39,01	43.631,00
03-04-24	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	60,78	9.100,00	553.084,18	60,55	60,92	61,64	48.421,00
03-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	23,52	700,00	16.462,36	23,28	23,64	24,05	11.983,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – ABRIL 2024

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE ABRIL DE 2024 À 30 DE ABRIL DE 2024



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
03-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	56,44	400,00	22.576,67	55,65	56,22	56,64	20.806,00
03-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	32,54	500,00	16.270,60	32,42	32,56	32,82	12.953,00
03-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	35,18	200,00	7.035,26	34,86	35,29	35,77	24.544,00
03-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	5,45	6.400,00	34.880,00	5,42	5,45	5,48	12.195,00
03-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	5,44	13.700,00	74.576,45	5,42	5,45	5,48	12.195,00
03-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPLE3	8,63	1.900,00	16.389,04	8,46	8,56	8,68	4.418,00
03-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	40,65	2.300,00	93.505,17	40,23	40,71	41,18	17.092,00
03-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,62	1.500,00	18.935,64	12,46	12,61	12,75	16.219,00
03-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	32,33	1.500,00	48.494,04	31,93	32,23	32,57	14.451,00
03-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	14,76	1.600,00	23.608,70	14,59	14,73	14,86	8.960,00
03-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	14,71	3.300,00	48.543,00	14,59	14,73	14,86	8.960,00
03-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,81	12.500,00	47.570,27	3,75	3,83	3,92	38.329,00
03-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	22,74	1.300,00	29.567,33	22,57	22,78	23,01	10.820,00
03-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	10,13	13.400,00	135.731,05	10,06	10,13	10,22	15.936,00
03-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	17,26	2.300,00	39.689,58	16,82	17,56	18,06	25.983,00
03-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	7,63	1.500,00	11.439,00	7,50	7,67	8,03	20.410,00
03-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	PETR3	39,29	800,00	31.430,73	39,06	39,36	39,82	23.485,00
03-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRIQ3	49,32	400,00	19.728,23	48,92	49,33	49,72	27.379,00
03-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRIQ3	49,28	3.100,00	152.756,21	48,92	49,33	49,72	27.379,00
03-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	22,35	1.600,00	35.756,27	22,25	22,40	22,58	19.133,00
03-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	52,15	800,00	41.722,14	51,72	52,08	52,75	25.073,00
03-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	26,02	1.900,00	49.434,81	25,80	26,03	26,40	7.026,00
03-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	7,01	3.500,00	24.525,03	6,88	7,01	7,38	19.475,00
03-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	SRNA3	9,50	2.200,00	20.889,74	9,30	9,47	9,62	4.618,00
03-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	SRNA3	9,46	4.100,00	38.786,00	9,30	9,47	9,62	4.618,00
03-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	SRNA3	9,50	2.900,00	27.537,67	9,30	9,47	9,62	4.618,00
03-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	SRNA3	9,52	3.800,00	36.176,00	9,30	9,47	9,62	4.618,00
03-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	64,42	400,00	25.768,35	64,09	64,58	65,48	20.680,00
03-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	64,59	4.000,00	258.376,52	64,09	64,58	65,48	20.680,00
03-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	16,93	1.000,00	16.934,60	16,69	16,93	17,66	15.482,00
03-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	16,91	800,00	13.527,73	16,69	16,93	17,66	15.482,00
03-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	16,78	1.900,00	31.888,30	16,69	16,93	17,66	15.482,00
03-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQLT3	32,28	6.783,00	218.932,86	31,93	32,23	32,57	14.451,00
03-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	3,87	189.324,00	731.794,06	3,75	3,83	3,92	38.329,00
03-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	22,35	9.697,00	216.732,80	22,25	22,40	22,58	19.133,00
03-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	24,95	8.386,00	209.255,86	24,57	24,91	25,40	28.959,00
03-04-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	RBRP11	60,01	5.374,00	322.502,24	59,71	60,19	61,00	4.426,00
04-04-24	FIA RVA EMB II	Compra	GGBR4	23,07	9.000,00	207.630,00	22,51	23,06	23,42	33.887,00
04-04-24	FIA RVA EMB II	Venda	HAPV3	3,97	57.900,00	230.026,00	3,88	4,02	4,10	35.001,00
04-04-24	FIA RVA EMB II	Compra	PETR4	39,18	17.400,00	681.746,18	37,43	38,64	39,48	167.968,00
04-04-24	FIA RVA EMB II	Venda	REC3	22,28	3.100,00	69.065,43	21,89	22,29	22,69	11.806,00
04-04-24	FIA RVA EMB II	Compra	RRRP3	35,31	1.300,00	45.903,00	34,60	35,21	35,59	15.740,00
04-04-24	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	60,95	4.800,00	292.543,39	60,17	60,71	61,29	55.792,00
04-04-24	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	60,37	5.400,00	325.998,00	60,17	60,71	61,29	55.792,00
04-04-24	FIA RVA EMB II	Compra	WEGE3	38,10	3.400,00	129.540,00	37,82	38,39	38,67	14.802,00
04-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	5,45	4.100,00	22.345,00	5,43	5,45	5,49	10.838,00
04-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENJU3	2,03	7.000,00	14.183,80	1,92	2,01	2,08	1.945,00
04-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,06	49.900,00	202.556,86	3,88	4,02	4,10	35.001,00
04-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,13	700,00	7.093,00	10,00	10,14	10,31	24.385,00
04-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,14	9.800,00	99.365,21	10,00	10,14	10,31	24.385,00
04-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,15	53.000,00	538.126,77	10,00	10,14	10,31	24.385,00
04-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	32,77	17.000,00	557.119,81	32,61	33,01	33,69	59.951,00
04-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	33,00	3.400,00	112.212,44	32,61	33,01	33,69	59.951,00
04-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	33,03	18.800,00	620.897,40	32,61	33,01	33,69	59.951,00
04-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	PETR3	39,73	2.700,00	107.268,88	38,70	39,87	40,83	65.404,00
04-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRIQ3	50,43	4.200,00	211.810,03	49,12	50,38	50,88	29.583,00
04-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	54,10	5.500,00	297.577,38	52,21	53,68	54,50	30.282,00
04-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	64,02	2.300,00	147.254,55	63,48	63,94	64,93	24.746,00
04-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	16,95	5.000,00	84.758,23	16,51	16,98	17,36	19.722,00
04-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQLT3	32,68	6.718,00	219.533,80	32,30	32,63	32,90	17.592,00
04-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RENT3	53,60	4.094,00	219.441,07	52,21	53,68	54,50	30.282,00
04-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	25,13	5.203,00	130.759,81	24,68	25,21	25,55	30.636,00
04-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	25,35	5.793,00	146.852,55	24,68	25,21	25,55	30.636,00
04-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	25,14	1.433,00	36.024,91	24,68	25,21	25,55	30.636,00
04-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	25,32	5.314,00	134.550,52	24,68	25,21	25,55	30.636,00
05-04-24	FIA RVA EMB II	Venda	PETR4	37,67	7.300,00	274.980,29	37,17	37,90	38,57	89.083,00
05-04-24	FIA RVA EMB II	Venda	REC3	21,38	11.600,00	248.060,82	21,02	21,21	22,22	11.572,00
05-04-24	FIA RVA EMB II	Compra	RENT3	52,78	2.700,00	142.500,50	52,67	53,07	53,59	17.845,00
05-04-24	FIA RVA EMB II	Compra	RRRP3	34,27	3.000,00	102.802,29	34,04	34,50	35,19	14.021,00
05-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	5,43	46.200,00	251.038,59	5,42	5,43	5,46	6.899,00
05-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	5,43	9.000,00	48.870,00	5,42	5,43	5,46	6.899,00
05-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLE6	9,69	2.400,00	23.250,45	9,61	9,70	9,87	15.247,00
05-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLE6	9,70	1.400,00	13.575,53	9,61	9,70	9,87	15.247,00
05-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLE6	9,69	2.900,00	28.093,19	9,61	9,70	9,87	15.247,00
05-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	40,62	3.700,00	150.286,95	40,32	40,87	41,14	16.750,00
05-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	31,71	3.200,00	101.487,96	31,46	31,73	32,46	26.375,00
05-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	31,62	3.600,00	113.830,84	31,46	31,73	32,46	26.375,00
05-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	32,71	2.600,00	85.044,59	32,53	32,71	32,99	28.323,00
05-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	MGLU3	1,70	56.500,00	96.050,00	1,69	1,71	1,77	53.218,00
05-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	SRNA3	9,54	100,00	953,86	9,33	9,48	9,67	4.247,00
05-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	SRNA3	9,44	400,00	3.775,34	9,33	9,48	9,67	4.247,00
05-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	SRNA3	9,47	3.500,00	33.127,50	9,33	9,48	9,67	4.247,00
05-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQLT3	31,69	1.238,00	39.232,22	31,46	31,73	32,46	26.375,00
05-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQLT3	31,79	1.702,00	54.109,67	31,46	31,73	32,46	26.375,00
05-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQLT3	31,80	3.131,00	99.580,04	31,46	31,73	32,46	26.375,00
05-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	MATD3	5,70	909,00	5.181,30	5,43	5,60	5,71	3.620,00
05-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	25,26	1.184,00	29.907,84	24,95	25,36	25,62	29.128,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – ABRIL 2024

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE ABRIL DE 2024 À 30 DE ABRIL DE 2024



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
05-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	25,41	6.500,00	165.189,72	24,95	25,36	25,62	29.128,00
05-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	25,61	888,00	22.741,68	24,95	25,36	25,62	29.128,00
08-04-24	FIA RVA EMB II	Compra	CEAB3	12,26	13.500,00	165.541,00	11,93	12,24	12,42	10.462,00
08-04-24	FIA RVA EMB II	Compra	CEAB3	12,30	22.400,00	275.492,00	11,93	12,24	12,42	10.462,00
08-04-24	FIA RVA EMB II	Compra	LREN3	17,19	5.700,00	97.967,00	16,84	17,17	17,32	16.816,00
08-04-24	FIA RVA EMB II	Venda	PCAR3	2,64	108.500,00	285.925,00	2,58	2,63	2,71	7.438,00
08-04-24	FIA RVA EMB II	Compra	SBFG3	13,75	13.500,00	185.628,00	13,52	13,89	14,29	11.960,00
08-04-24	FIA RVA EMB II	Venda	VIVA3	24,17	21.600,00	522.046,00	23,80	24,19	24,56	13.081,00
08-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	23,94	900,00	21.546,43	23,75	23,98	24,14	9.536,00
08-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	36,22	400,00	14.486,13	35,24	36,12	36,47	20.106,00
08-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	41,37	1.500,00	62.054,33	40,71	41,37	41,64	19.395,00
08-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,83	700,00	8.981,00	12,70	12,92	13,06	9.487,00
08-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,90	2.800,00	36.132,29	12,70	12,92	13,06	9.487,00
08-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,88	1.700,00	21.888,68	12,70	12,92	13,06	9.487,00
08-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENJU3	2,11	200,00	421,56	1,93	2,04	2,17	1.381,00
08-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENJU3	2,02	7.300,00	14.715,67	1,93	2,04	2,17	1.381,00
08-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	32,16	3.600,00	115.758,56	31,70	32,15	32,34	15.817,00
08-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	14,71	800,00	11.765,86	14,67	14,71	14,83	4.826,00
08-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGT11	23,32	1.100,00	25.649,45	22,85	23,29	23,47	10.302,00
08-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	33,26	3.700,00	123.068,80	32,89	33,29	33,53	29.506,00
08-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	22,65	1.200,00	27.181,82	22,34	22,71	22,83	15.768,00
08-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	21,25	900,00	19.123,48	20,69	21,15	21,40	17.110,00
08-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	53,67	400,00	21.466,75	52,62	53,57	54,06	19.563,00
08-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	26,03	600,00	15.617,00	25,76	26,10	26,35	4.110,00
08-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	SRNA3	9,42	1.700,00	16.019,06	9,38	9,44	9,68	6.400,00
08-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	62,62	400,00	25.047,52	62,35	62,59	62,92	15.590,00
08-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	24,20	500,00	12.101,00	23,80	24,19	24,56	13.081,00
08-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	MATD3	5,70	192,00	1.094,40	5,56	5,67	5,74	1.955,00
08-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	25,70	874,00	22.459,53	25,32	25,70	25,92	28.019,00
08-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	25,65	1.358,00	34.832,70	25,32	25,70	25,92	28.019,00
08-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	25,73	5.729,00	147.398,25	25,32	25,70	25,92	28.019,00
08-04-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	NEWL11	118,71	902,00	107.075,49	117,04	118,73	118,98	140,00
09-04-24	FIA RVA EMB II	Compra	ITUB4	33,50	3.200,00	107.200,00	33,28	33,49	33,63	23.517,00
09-04-24	FIA RVA EMB II	Compra	JBSS3	22,36	20.500,00	458.330,73	21,57	22,18	22,44	22.877,00
09-04-24	FIA RVA EMB II	Venda	MRFG3	10,77	43.400,00	467.312,11	10,50	10,73	10,91	22.956,00
09-04-24	FIA RVA EMB II	Venda	PETRA	38,51	5.000,00	192.537,91	38,06	38,59	39,14	49.697,00
09-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	36,25	4.300,00	155.871,54	36,15	36,31	36,67	15.228,00
09-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	41,66	1.600,00	66.659,24	41,00	41,55	41,89	20.523,00
09-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	13,16	8.200,00	107.929,37	12,95	13,13	13,22	13.050,00
09-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	13,18	8.600,00	113.348,00	12,95	13,13	13,22	13.050,00
09-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	32,56	2.000,00	65.116,67	32,19	32,55	32,73	11.486,00
09-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,11	27.400,00	112.732,10	4,00	4,09	4,16	26.964,00
09-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	49,36	1.600,00	78.981,80	48,90	49,34	49,96	19.304,00
09-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	21,51	3.000,00	64.519,19	21,00	21,47	21,80	8.848,00
09-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	55,46	3.600,00	199.640,88	54,13	55,09	55,65	26.134,00
09-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	61,95	2.100,00	130.099,32	61,67	62,07	63,29	25.682,00
09-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQLT3	32,53	2.472,00	80.425,73	32,19	32,55	32,73	11.486,00
09-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	MATD3	5,87	354,00	2.077,98	5,64	5,81	5,93	2.158,00
09-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	23,06	3.687,00	85.022,22	22,85	23,13	23,29	23.319,00
09-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	23,18	2.872,00	182.496,21	22,85	23,13	23,29	23.319,00
09-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	23,14	2.765,00	63.982,10	22,85	23,13	23,29	23.319,00
10-04-24	FIA RVA EMB II	Venda	B3SA3	11,97	37.400,00	447.605,00	11,90	12,03	12,32	50.992,00
10-04-24	FIA RVA EMB II	Venda	CIEL3	5,38	42.600,00	229.297,93	5,33	5,36	5,41	21.808,00
10-04-24	FIA RVA EMB II	Compra	CPFE3	35,71	15.200,00	542.857,65	35,55	35,75	36,50	8.865,00
10-04-24	FIA RVA EMB II	Venda	TOTS3	27,74	3.600,00	99.879,89	27,58	27,82	28,17	18.252,00
10-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	35,05	3.100,00	108.656,49	34,82	35,19	36,30	27.580,00
10-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENJU3	2,00	3.500,00	7.014,37	1,94	1,98	2,08	687,00
10-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENJU3	2,00	100,00	200,00	1,94	1,98	2,08	687,00
10-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	32,94	7.900,00	260.212,45	32,68	32,98	33,50	46.557,00
10-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	49,84	2.200,00	109.638,76	49,35	49,92	50,60	24.558,00
10-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	22,86	9.700,00	221.733,64	22,63	22,84	23,27	25.173,00
10-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	22,08	4.900,00	108.180,12	21,35	22,07	22,30	16.286,00
10-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	16,35	1.000,00	16.347,31	16,20	16,38	16,85	12.138,00
11-04-24	FIA RVA EMB II	Compra	CEAB3	11,81	11.500,00	135.835,00	11,25	11,54	11,94	7.196,00
11-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALPA4	9,38	1.600,00	15.014,76	9,11	9,34	9,44	6.160,00
11-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	57,81	400,00	23.123,47	57,34	57,71	58,07	18.745,00
11-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	33,41	700,00	23.388,15	32,82	33,25	33,50	14.398,00
11-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	34,67	1.700,00	58.943,89	34,43	34,68	35,20	19.780,00
11-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPLÉ3	8,26	1.800,00	14.876,04	8,22	8,35	8,51	11.594,00
11-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ6	9,26	900,00	8.334,00	9,18	9,35	9,59	33.918,00
11-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ6	9,27	2.900,00	26.882,63	9,18	9,35	9,59	33.918,00
11-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	39,16	2.100,00	82.231,38	38,72	39,26	40,66	45.899,00
11-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	39,08	2.100,00	82.068,00	38,72	39,26	40,66	45.899,00
11-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,69	2.900,00	36.812,83	12,58	12,67	12,80	12.374,00
11-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	31,86	2.100,00	66.911,69	31,52	31,84	32,17	21.585,00
11-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	14,79	1.400,00	20.701,11	14,60	14,81	14,90	7.020,00
11-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	3,97	4.400,00	17.479,62	3,86	3,96	4,04	22.865,00
11-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGT11	22,75	1.500,00	34.132,06	22,60	22,76	23,03	11.781,00
11-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	9,98	4.200,00	41.932,70	9,90	9,98	10,04	16.683,00
11-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	32,74	2.300,00	75.311,90	32,55	32,73	32,93	30.124,00
11-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	1,72	10.400,00	17.882,90	1,71	1,75	1,80	46.300,00
11-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	17,28	1.000,00	17.278,87	17,05	17,28	17,56	15.702,00
11-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	PETRA	40,78	300,00	12.235,00	40,63	40,85	41,14	18.287,00
11-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	49,97	1.000,00	49.972,47	49,50	49,94	50,49	19.707,00
11-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	49,67	600,00	29.804,53	49,50	49,94	50,49	19.707,00
11-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	22,71	3.000,00	68.124,55	22,45	22,71	22,84	16.353,00
11-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	22,12	2.000,00	44.240,81	21,90	22,08	22,25	8.086,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – ABRIL 2024

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE ABRIL DE 2024 À 30 DE ABRIL DE 2024



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
11-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	25,75	900,00	23.174,53	25,36	25,72	26,12	6.903,00
11-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	6,44	3.500,00	22.556,78	6,39	6,44	6,50	8.405,00
11-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	61,22	700,00	42.853,71	61,02	61,28	61,65	22.262,00
11-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	VIVA3	23,26	100,00	2.326,12	23,15	23,38	23,96	18.250,00
11-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	VIVA3	23,30	13.600,00	316.834,69	23,15	23,38	23,96	18.250,00
11-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	15,77	4.500,00	70.953,94	15,63	15,84	16,38	14.526,00
11-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQLT3	31,75	13.180,00	418.406,46	31,52	31,84	32,17	21.585,00
11-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQLT3	31,96	23.547,00	752.501,92	31,52	31,84	32,17	21.585,00
11-04-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	MALL11	116,61	4.288,00	500.023,68	116,60	116,69	117,26	5.705,00
12-04-24	FIA RVA EMB II	Compra	PETRA	38,90	7.100,00	276.190,00	38,70	39,31	40,05	49.244,00
12-04-24	FIA RVA EMB II	Venda	TOTS3	27,39	15.783,00	432.242,16	27,05	27,39	27,66	16.281,00
12-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	22,89	4.900,00	112.155,56	22,68	22,89	23,29	16.199,00
12-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	57,06	200,00	11.411,79	56,82	57,15	57,85	18.596,00
12-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	33,16	3.200,00	106.105,85	32,80	33,14	33,46	16.093,00
12-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	33,10	700,00	23.171,33	32,80	33,14	33,46	16.093,00
12-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	34,14	800,00	27.313,00	34,01	34,23	34,85	19.754,00
12-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL3	8,24	5.900,00	48.596,12	8,13	8,22	8,34	9.276,00
12-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL3	8,21	3.800,00	31.198,00	8,13	8,22	8,34	9.276,00
12-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	9,20	2.500,00	23.009,37	9,14	9,22	9,37	25.689,00
12-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	38,83	1.500,00	58.245,38	38,56	39,04	39,60	29.338,00
12-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,55	2.600,00	32.630,00	12,39	12,52	12,72	15.769,00
12-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,52	5.800,00	72.638,68	12,39	12,52	12,72	15.769,00
12-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,54	3.700,00	46.389,11	12,39	12,52	12,72	15.769,00
12-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	31,60	2.400,00	75.831,58	31,47	31,64	31,85	19.405,00
12-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	14,65	1.700,00	24.900,84	14,60	14,68	14,82	7.250,00
12-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	3,85	6.300,00	24.278,90	3,83	3,88	3,96	47.747,00
12-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	22,27	2.800,00	62.362,09	22,11	22,37	22,92	13.651,00
12-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	9,88	3.900,00	38.518,38	9,86	9,89	9,98	18.585,00
12-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	32,51	2.100,00	68.273,11	32,39	32,51	32,73	36.799,00
12-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	1,66	12.300,00	20.447,22	1,65	1,68	1,73	29.388,00
12-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	16,94	700,00	11.858,57	16,73	16,98	17,28	17.967,00
12-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	PETRA	40,29	500,00	20.142,79	39,97	40,59	41,43	21.764,00
12-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRIQ3	51,32	6.600,00	338.679,98	50,44	51,27	52,13	47.630,00
12-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRIQ3	50,88	600,00	30.529,07	50,44	51,27	52,13	47.630,00
12-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	22,45	2.700,00	60.605,65	22,26	22,46	22,85	23.173,00
12-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	22,01	4.500,00	99.029,23	21,49	22,04	22,75	12.280,00
12-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	52,29	1.000,00	52.288,75	51,67	52,42	53,44	27.843,00
12-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	25,06	500,00	12.530,00	24,80	25,15	26,11	11.506,00
12-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	25,15	1.300,00	32.695,00	24,80	25,15	26,11	11.506,00
12-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	25,10	200,00	5.019,74	24,80	25,15	26,11	11.506,00
12-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	6,31	2.700,00	17.028,35	6,25	6,33	6,52	10.161,00
12-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	SRNA3	8,67	2.400,00	20.799,92	8,58	8,70	8,96	5.368,00
12-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	61,25	100,00	6.124,98	60,73	61,84	62,84	22.142,00
12-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	VIVA3	22,69	5.500,00	124.767,95	22,42	22,76	23,50	20.486,00
12-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	VIVA3	22,87	9.000,00	205.829,10	22,42	22,76	23,50	20.486,00
12-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	15,02	2.000,00	30.044,03	14,74	15,12	15,52	14.352,00
12-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	15,30	4.700,00	71.910,00	14,74	15,12	15,52	14.352,00
12-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQLT3	31,68	7.063,00	223.741,38	31,47	31,64	31,85	19.405,00
12-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	ITUB4	32,46	2.414,00	78.358,44	32,39	32,51	32,73	36.799,00
12-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	ITUB4	32,55	14.160,00	460.844,05	32,39	32,51	32,73	36.799,00
12-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	PRIQ3	51,00	6.017,00	306.879,88	50,44	51,27	52,13	47.630,00
12-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	22,50	1.028,00	23.130,00	22,26	22,46	22,85	23.173,00
12-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	24,81	425,00	10.544,25	24,71	24,98	25,42	23.958,00
12-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	24,91	4.318,00	107.550,60	24,71	24,98	25,42	23.958,00
12-04-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	TEPP11	96,13	352,00	33.837,34	95,13	95,76	96,49	3.197,00
15-04-24	FIA RVA EMB II	Venda	CSAN3	14,40	33.900,00	488.186,92	14,28	14,48	14,95	31.377,00
15-04-24	FIA RVA EMB II	Compra	CXSE3	15,62	8.400,00	131.237,23	15,54	15,68	15,89	10.626,00
15-04-24	FIA RVA EMB II	Compra	DIRR3	22,35	7.200,00	160.889,49	22,09	22,50	23,72	11.435,00
15-04-24	FIA RVA EMB II	Venda	ENEV3	12,26	20.400,00	250.046,21	12,20	12,28	12,50	32.007,00
15-04-24	FIA RVA EMB II	Compra	GGBR4	23,14	9.000,00	208.290,13	22,70	23,12	23,47	50.702,00
15-04-24	FIA RVA EMB II	Compra	JBSS3	23,05	6.600,00	152.157,98	21,89	22,85	23,29	23.993,00
15-04-24	FIA RVA EMB II	Compra	MRFG3	10,46	7.300,00	76.382,00	9,84	10,37	10,68	26.354,00
15-04-24	FIA RVA EMB II	Venda	RECV3	21,07	4.900,00	103.260,29	20,73	21,10	21,64	16.381,00
15-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	22,33	1.200,00	26.795,77	22,11	22,30	22,80	20.633,00
15-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	22,29	5.200,00	115.882,30	22,11	22,30	22,80	20.633,00
15-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALPA4	8,97	300,00	2.691,34	8,91	9,08	9,27	10.425,00
15-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALPA4	9,10	4.600,00	41.861,56	8,91	9,08	9,27	10.425,00
15-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALPA4	9,06	1.500,00	13.587,18	8,91	9,08	9,27	10.425,00
15-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALPA4	9,10	3.300,00	30.031,70	8,91	9,08	9,27	10.425,00
15-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	56,39	600,00	33.834,97	56,21	56,53	57,34	24.487,00
15-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	33,06	1.300,00	42.975,94	32,85	33,06	33,27	18.503,00
15-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	33,66	2.700,00	90.891,11	33,40	33,64	34,41	26.806,00
15-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	9,26	3.500,00	32.411,09	9,16	9,23	9,34	34.064,00
15-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	38,26	500,00	19.131,68	37,88	38,40	39,06	31.082,00
15-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,25	7.100,00	86.987,44	12,20	12,28	12,50	32.007,00
15-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENJU3	1,90	200,00	380,00	1,83	1,86	1,94	723,00
15-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	31,31	2.300,00	72.022,32	31,16	31,47	31,89	39.690,00
15-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	14,38	3.300,00	47.438,73	14,29	14,41	14,75	10.886,00
15-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,81	10.300,00	39.197,93	3,73	3,80	3,93	44.749,00
15-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,80	4.500,00	17.100,00	3,73	3,80	3,93	44.749,00
15-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	21,76	800,00	17.408,51	21,44	21,64	22,17	18.860,00
15-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	9,73	7.200,00	70.074,14	9,66	9,75	9,92	36.223,00
15-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	32,48	300,00	9.743,66	31,79	32,06	32,63	51.992,00
15-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	MGLU3	1,59	26.700,00	42.486,40	1,52	1,56	1,66	59.021,00
15-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	16,82	1.300,00	21.867,29	16,51	16,80	17,01	21.224,00
15-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	7,74	1.500,00	11.607,23	7,67	7,74	7,93	9.428,00
15-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	PETRA	40,74	7.300,00	297.427,98	40,10	40,75	41,03	28.099,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – ABRIL 2024

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE ABRIL DE 2024 À 30 DE ABRIL DE 2024



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBVBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
15-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	PETR3	40,73	700,00	28.510,68	40,10	40,75	41,03	28.099,00
15-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	50,18	1.000,00	50.175,45	49,89	50,24	50,98	25.526,00
15-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	21,91	300,00	6.573,00	21,53	21,75	22,41	32.530,00
15-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	21,80	500,00	10.899,25	21,53	21,75	22,41	32.530,00
15-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	21,07	900,00	18.959,69	20,73	21,10	21,64	16.381,00
15-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	51,03	800,00	40.827,94	50,58	50,93	51,90	33.423,00
15-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	24,25	1.200,00	29.098,51	24,03	24,28	24,96	14.642,00
15-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	24,33	2.900,00	70.557,00	24,03	24,28	24,96	14.642,00
15-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	6,11	16.700,00	101.978,77	5,98	6,12	6,30	23.625,00
15-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	6,15	11.500,00	70.709,66	5,98	6,12	6,30	23.625,00
15-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	SRNA3	8,51	2.500,00	21.277,30	8,42	8,51	8,63	7.555,00
15-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	61,11	700,00	42.774,57	60,40	61,21	61,80	31.593,00
15-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	VIVA3	21,78	700,00	15.248,50	21,62	21,96	22,75	19.420,00
15-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	VIVA3	22,12	3.200,00	70.790,40	21,62	21,96	22,75	19.420,00
15-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	VIVA3	22,01	4.500,00	99.031,32	21,62	21,96	22,75	19.420,00
15-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	14,32	2.000,00	28.631,84	14,15	14,40	14,90	18.417,00
15-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	14,47	1.600,00	23.157,33	14,15	14,40	14,90	18.417,00
15-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	AURE3	11,90	22.897,00	272.435,91	11,76	11,86	12,00	12.004,00
15-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	AURE3	11,88	4.423,00	52.541,93	11,76	11,86	12,00	12.004,00
15-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	46,32	2.335,00	108.152,72	45,67	46,31	46,76	18.343,00
15-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQLT3	31,56	6.765,00	213.490,32	31,16	31,47	31,89	39.690,00
15-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	24,81	4.134,00	102.552,46	24,68	24,94	25,34	28.505,00
15-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	24,72	2.041,00	50.447,30	24,68	24,94	25,34	28.505,00
16-04-24	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	61,41	6.400,00	393.024,00	60,20	61,38	62,20	35.046,00
16-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	21,94	900,00	19.748,26	21,88	22,16	22,49	20.735,00
16-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	22,19	1.100,00	24.406,56	21,88	22,16	22,49	20.735,00
16-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	27,98	400,00	11.191,45	27,54	27,93	28,40	55.445,00
16-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	33,00	1.200,00	39.600,99	32,78	32,95	33,12	20.018,00
16-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	33,33	400,00	13.331,70	32,92	33,40	33,77	35.231,00
16-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ3	8,11	3.000,00	24.330,00	8,07	8,16	8,27	4.577,00
16-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ3	8,19	1.600,00	13.101,31	8,07	8,16	8,27	4.577,00
16-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ3	8,10	7.800,00	63.193,06	8,07	8,16	8,27	4.577,00
16-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPLÉ6	9,23	1.400,00	12.927,48	9,06	9,20	9,30	32.135,00
16-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	38,59	4.000,00	154.340,05	38,07	38,49	38,84	29.802,00
16-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,16	6.100,00	74.194,33	12,04	12,17	12,27	20.487,00
16-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	31,60	4.300,00	135.872,13	31,16	31,55	31,80	32.447,00
16-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	14,05	2.800,00	39.341,95	13,99	14,12	14,30	11.457,00
16-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,60	11.000,00	39.600,00	3,56	3,61	3,67	54.026,00
16-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,62	28.400,00	102.780,78	3,56	3,61	3,67	54.026,00
16-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	9,61	4.100,00	39.394,19	9,56	9,60	9,70	40.193,00
16-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	31,64	1.400,00	44.292,44	31,38	31,65	31,87	51.045,00
16-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	1,53	18.700,00	28.643,02	1,45	1,50	1,57	68.833,00
16-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	16,53	1.100,00	18.182,68	16,37	16,50	16,70	24.627,00
16-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	PETR3	41,16	1.300,00	53.502,35	40,47	41,07	41,37	25.314,00
16-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	PETR3	41,00	800,00	32.798,58	40,47	41,07	41,37	25.314,00
16-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	PETR3	41,16	700,00	28.809,96	40,47	41,07	41,37	25.314,00
16-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	49,80	1.300,00	64.737,11	49,22	49,72	50,31	24.420,00
16-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	49,58	900,00	44.624,81	49,22	49,72	50,31	24.420,00
16-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	21,51	6.600,00	141.968,51	21,35	21,50	21,74	38.932,00
16-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	20,85	1.600,00	33.367,64	20,60	20,84	21,13	11.792,00
16-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	50,14	1.400,00	70.199,81	49,70	50,34	51,27	41.021,00
16-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	50,26	5.100,00	256.327,16	49,70	50,34	51,27	41.021,00
16-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	24,12	1.900,00	45.825,82	23,70	24,16	24,61	8.758,00
16-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	23,89	1.600,00	38.230,40	23,70	24,16	24,61	8.758,00
16-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	6,04	100,00	603,75	5,91	6,12	6,28	17.996,00
16-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	5,97	100,00	597,00	5,91	6,12	6,28	17.996,00
16-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	SRNA3	8,45	1.300,00	10.980,40	8,31	8,45	8,68	11.801,00
16-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	61,40	600,00	36.838,28	60,20	61,38	62,20	35.046,00
16-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	VIVA3	21,64	400,00	8.657,53	21,49	22,22	22,66	13.528,00
16-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	14,18	900,00	12.761,81	13,86	14,20	14,46	17.287,00
16-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	13,90	600,00	8.340,00	13,86	14,20	14,46	17.287,00
16-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	AURE3	11,62	23.628,00	274.574,73	11,26	11,57	11,77	27.179,00
17-04-24	FIA RVA EMB II	Venda	B3SA3	11,21	54.300,00	608.661,91	11,14	11,25	11,49	40.970,00
17-04-24	FIA RVA EMB II	Compra	BPAC11	32,95	4.500,00	148.295,01	32,52	32,87	33,68	30.726,00
17-04-24	FIA RVA EMB II	Compra	VALE3	62,38	8.900,00	555.148,96	61,96	62,68	63,47	70.133,00
17-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	21,90	2.000,00	43.800,92	21,71	21,90	22,38	22.623,00
17-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALPA4	8,24	1.700,00	14.012,77	8,03	8,28	8,60	14.878,00
17-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	B3SA3	11,24	44.200,00	496.784,03	11,14	11,25	11,49	40.970,00
17-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	27,93	1.600,00	44.689,40	27,78	27,93	28,17	41.381,00
17-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	BBDC4	13,80	32.600,00	449.973,50	13,68	13,81	13,97	32.589,00
17-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	32,98	1.400,00	46.165,80	32,52	32,89	33,07	19.509,00
17-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPLÉ3	8,22	6.200,00	50.994,93	8,15	8,23	8,30	8.687,00
17-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPLÉ6	9,19	1.900,00	17.461,70	9,15	9,29	9,29	25.037,00
17-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,07	7.500,00	90.519,43	11,98	12,08	12,22	18.641,00
17-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	31,17	4.900,00	152.747,52	31,05	31,23	31,56	29.196,00
17-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	13,87	1.700,00	23.586,49	13,81	13,89	14,13	10.073,00
17-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	13,85	100,00	1.384,78	13,81	13,89	14,13	10.073,00
17-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	13,88	11.400,00	158.251,82	13,81	13,89	14,13	10.073,00
17-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,57	9.300,00	33.212,98	3,53	3,58	3,65	69.102,00
17-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,63	4.300,00	15.609,00	3,53	3,58	3,65	69.102,00
17-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	21,21	7.600,00	161.162,85	21,09	21,31	21,67	15.038,00
17-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	9,54	8.100,00	77.243,25	9,50	9,55	9,64	28.458,00
17-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	31,59	900,00	28.426,77	31,38	31,58	31,77	47.432,00
17-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	1,52	25.700,00	39.183,09	1,49	1,53	1,58	39.220,00
17-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	16,22	1.400,00	22.704,90	16,15	16,31	16,60	19.278,00
17-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	PETR3	41,14	3.900,00	160.451,19	41,00	41,18	41,47	23.028,00
17-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	PETR3	41,23	800,00	32.981,75	41,00	41,18	41,47	23.028,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – ABRIL 2024

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE ABRIL DE 2024 À 30 DE ABRIL DE 2024



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
17-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	48,68	1.100,00	53.549,82	48,40	48,84	49,78	28.821,00
17-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	21,18	5.500,00	116.464,81	21,10	21,19	21,49	24.936,00
17-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	20,35	1.900,00	38.673,89	20,12	20,41	20,93	18.638,00
17-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	49,99	2.200,00	109.981,57	49,56	50,11	50,97	35.837,00
17-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	6,02	4.900,00	29.491,57	5,95	6,04	6,25	16.095,00
17-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	6,02	2.300,00	13.856,48	5,95	6,04	6,25	16.095,00
17-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	SRNA3	8,45	2.300,00	19.438,85	8,32	8,42	8,57	4.496,00
17-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	61,01	2.500,00	152.531,19	60,64	61,03	61,77	22.130,00
17-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	22,50	1.000,00	22.504,10	22,18	22,56	22,99	11.163,00
17-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	AURE3	11,70	18.244,00	213.484,64	11,59	11,68	11,80	8.116,00
17-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	AURE3	11,66	6.790,00	79.162,60	11,59	11,68	11,80	8.116,00
17-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQLT3	31,31	6.722,00	210.479,18	31,05	31,23	31,56	29.196,00
17-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	ITUB4	31,55	10.060,00	317.409,20	31,38	31,58	31,77	47.432,00
18-04-24	FIA RVA EMB II	Venda	CIEL3	5,47	61.500,00	336.409,00	5,43	5,47	5,51	15.720,00
18-04-24	FIA RVA EMB II	Venda	HAPV3	3,50	19.600,00	68.613,99	3,45	3,53	3,62	55.009,00
18-04-24	FIA RVA EMB II	Compra	NTCO3	16,23	32.600,00	529.024,67	15,99	16,16	16,42	17.339,00
18-04-24	FIA RVA EMB II	Venda	RECV3	20,21	4.300,00	86.907,98	20,12	20,31	20,60	9.625,00
18-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	21,73	2.400,00	52.149,88	21,54	21,70	22,03	9.991,00
18-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	B3SA3	11,17	52.100,00	581.783,07	11,05	11,18	11,38	35.005,00
18-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	27,80	600,00	16.679,74	27,70	27,91	28,23	32.375,00
18-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBDC4	13,79	32.600,00	449.701,28	13,67	13,78	13,95	26.134,00
18-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	32,57	700,00	22.802,13	32,45	32,61	32,97	17.833,00
18-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPLÉ3	8,25	1.700,00	14.025,51	8,18	8,25	8,31	3.374,00
18-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	37,68	2.000,00	75.353,48	37,41	37,78	38,15	20.839,00
18-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,20	4.100,00	50.021,70	11,92	12,15	12,27	15.334,00
18-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENJU3	1,96	3.800,00	7.438,70	1,86	1,94	2,00	788,00
18-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENJU3	1,93	6.300,00	12.162,86	1,86	1,94	2,00	788,00
18-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	31,07	2.700,00	83.898,08	30,93	31,14	31,55	20.397,00
18-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	13,86	400,00	5.542,83	13,69	13,81	13,98	14.039,00
18-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	13,82	18.600,00	257.028,29	13,69	13,81	13,98	14.039,00
18-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,50	20.900,00	73.068,29	3,45	3,53	3,62	55.009,00
18-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	21,08	3.500,00	73.787,91	20,93	21,15	21,54	15.600,00
18-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	9,49	5.900,00	55.989,82	9,43	9,54	9,64	24.054,00
18-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	31,54	500,00	15.771,37	31,36	31,68	32,00	34.439,00
18-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	1,51	13.900,00	21.000,50	1,50	1,52	1,56	30.059,00
18-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	16,09	700,00	11.264,75	15,99	16,16	16,42	17.339,00
18-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	6,83	1.600,00	10.926,07	6,70	6,91	7,27	9.219,00
18-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	PETR3	41,24	10.100,00	416.502,53	40,85	41,37	41,97	17.194,00
18-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	49,06	600,00	29.436,85	48,75	49,29	49,84	23.027,00
18-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	20,98	1.500,00	31.473,16	20,83	20,98	21,20	20.258,00
18-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	20,32	2.300,00	46.730,26	20,12	20,31	20,60	9.625,00
18-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	50,60	300,00	15.179,97	49,91	50,73	51,31	29.933,00
18-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	SCAR3	25,13	100,00	2.513,00	24,99	25,04	25,15	31,00
18-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	23,53	2.400,00	56.462,24	23,20	23,74	24,35	13.184,00
18-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	5,96	3.000,00	17.871,70	5,90	5,96	6,06	13.099,00
18-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	SRNA3	8,64	1.800,00	15.557,53	8,38	8,62	8,77	10.382,00
18-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	60,44	1.000,00	60.442,03	60,23	60,63	61,03	17.151,00
18-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	21,86	500,00	10.931,29	21,62	21,89	22,41	8.664,00
18-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	45,36	25,00	1.133,98	45,11	45,52	45,86	11.571,00
19-04-24	FIA RVA EMB II	Compra	NTCO3	16,12	10.200,00	164.432,27	15,97	16,17	16,53	15.261,00
19-04-24	FIA RVA EMB II	Venda	PETRE421	0,80	179.600,00	143.098,00		0,83		
19-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	21,75	6.000,00	130.495,54	21,51	21,73	21,98	11.757,00
19-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	32,96	400,00	13.183,38	32,55	32,93	33,02	9.799,00
19-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPLÉ6	9,39	1.500,00	14.081,47	9,25	9,33	9,44	30.738,00
19-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	37,98	500,00	18.991,09	37,75	37,98	38,28	20.244,00
19-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,31	2.700,00	33.247,94	12,20	12,40	10.342,00	
19-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENJU3	2,02	2.400,00	4.846,77	1,94	1,99	2,05	360,00
19-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	31,33	1.200,00	37.593,93	31,09	31,19	31,66	24.590,00
19-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	13,99	1.600,00	22.389,38	13,81	14,00	14,08	8.860,00
19-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,61	12.200,00	44.101,09	3,50	3,61	3,68	35.002,00
19-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	20,71	1.500,00	31.059,24	20,65	20,82	21,08	15.700,00
19-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	9,55	8.000,00	76.385,45	9,50	9,53	9,60	24.373,00
19-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	PETR3	42,38	9.200,00	389.858,23	41,02	42,33	42,81	37.108,00
19-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	48,62	300,00	14.585,05	48,12	48,83	49,47	28.344,00
19-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	21,35	1.400,00	29.895,67	21,01	21,38	21,58	31.906,00
19-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	20,71	700,00	14.495,72	20,22	20,87	21,15	12.720,00
19-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	50,78	2.400,00	121.864,49	50,27	50,87	51,95	37.085,00
19-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	24,02	600,00	14.410,62	23,29	24,04	24,23	9.197,00
19-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	6,00	5.300,00	31.815,79	5,97	6,06	6,16	13.639,00
19-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	SRNA3	8,95	100,00	895,03	8,64	8,89	9,06	6.108,00
19-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	SRNA3	9,01	4.200,00	37.842,00	8,64	8,89	9,06	6.108,00
19-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	61,14	400,00	24.456,00	60,41	61,11	61,60	22.777,00
19-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	14,07	1.400,00	19.696,20	13,94	14,10	14,37	13.429,00
22-04-24	FIA RVA EMB II	Compra	PETRE421	0,92	89.800,00	82.456,00		1,04		
22-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	21,70	400,00	8.679,36	21,59	21,73	21,86	8.303,00
22-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	21,78	1.300,00	28.312,71	21,59	21,73	21,86	8.303,00
22-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	B3SA3	11,25	13.900,00	156.427,73	11,17	11,25	11,34	39.492,00
22-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	27,38	700,00	19.163,44	27,24	27,46	28,05	45.512,00
22-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	32,82	500,00	16.410,41	32,70	32,88	33,33	9.980,00
22-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	32,80	800,00	26.239,67	32,46	32,98	33,32	20.840,00
22-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ6	8,52	5.000,00	42.613,21	8,39	8,56	8,63	7.292,00
22-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ6	9,45	500,00	4.723,29	9,27	9,45	9,54	22.708,00
22-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ6	9,42	2.300,00	21.673,68	9,27	9,45	9,54	22.708,00
22-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	37,70	600,00	22.622,20	37,48	37,72	38,07	23.835,00
22-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,39	2.600,00	32.210,62	12,21	12,39	12,49	14.866,00
22-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENJU3	2,05	3.600,00	7.366,34	1,88	2,00	2,12	1.416,00
22-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	31,34	1.800,00	56.415,97	31,04	31,30	31,48	13.838,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – ABRIL 2024

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE ABRIL DE 2024 À 30 DE ABRIL DE 2024



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBovespa			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
22-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	14,01	1.100,00	15.416,17	13,87	14,00	14,09	7.827,00
22-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	13,93	1.500,00	20.895,00	13,87	14,00	14,09	7.827,00
22-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	3,62	5.400,00	19.565,54	3,58	3,62	3,68	22.408,00
22-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGT11	20,87	1.900,00	39.647,78	20,62	20,87	21,05	13.697,00
22-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	9,51	4.900,00	46.586,07	9,45	9,51	9,59	27.691,00
22-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	31,60	600,00	18.962,33	31,28	31,53	31,74	44.281,00
22-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	1,53	15.600,00	23.893,72	1,50	1,53	1,56	22.939,00
22-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	16,13	1.500,00	24.189,52	16,02	16,10	16,33	13.018,00
22-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	PETR3	43,52	5.400,00	235.027,41	42,70	43,37	43,86	33.652,00
22-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	PETR3	43,45	4.000,00	173.802,79	42,70	43,37	43,86	33.652,00
22-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	48,44	300,00	14.530,71	47,69	48,29	48,82	28.781,00
22-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	21,16	700,00	14.814,06	20,98	21,13	21,30	18.023,00
22-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	20,58	1.700,00	34.987,49	20,38	20,60	20,96	13.707,00
22-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	20,62	1.200,00	24.741,89	20,38	20,60	20,96	13.707,00
22-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	49,62	5.200,00	258.008,48	49,11	49,65	50,57	32.133,00
22-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	49,40	800,00	39.522,24	49,11	49,65	50,57	32.133,00
22-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	49,60	1.100,00	54.559,05	49,11	49,65	50,57	32.133,00
22-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	24,21	700,00	16.944,26	23,73	24,16	24,50	11.215,00
22-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	6,18	4.100,00	25.321,27	5,99	6,16	6,29	15.812,00
22-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	SRNA3	8,93	6.600,00	58.967,03	8,76	8,91	9,00	6.024,00
22-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	SRNA3	8,85	1.300,00	11.501,99	8,76	8,91	9,00	6.024,00
22-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	SRNA3	8,86	1.700,00	15.063,32	8,76	8,91	9,00	6.024,00
22-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	SRNA3	8,97	10.900,00	97.773,00	8,76	8,91	9,00	6.024,00
22-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	60,83	600,00	36.500,41	60,55	60,86	61,86	18.316,00
22-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	22,52	700,00	15.765,08	22,04	22,44	22,75	5.136,00
22-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	14,17	3.600,00	51.024,73	13,90	14,10	14,36	11.885,00
23-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	21,74	2.100,00	45.657,79	21,29	21,70	21,91	8.240,00
23-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	21,90	800,00	17.520,00	21,29	21,70	21,91	8.240,00
23-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL66	9,30	12.500,00	116.224,55	9,19	9,26	9,41	16.125,00
23-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	37,29	5.200,00	193.908,53	37,06	37,26	37,53	20.928,00
23-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENJU3	1,94	2.200,00	4.273,14	1,90	1,93	1,99	347,00
23-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	14,73	3.600,00	53.023,69	14,44	14,65	14,79	23.143,00
23-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	14,57	4.500,00	65.577,47	14,44	14,65	14,79	23.143,00
23-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	14,64	5.100,00	74.647,00	14,44	14,65	14,79	23.143,00
23-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,62	10.600,00	38.417,51	3,54	3,60	3,66	23.313,00
23-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	20,88	1.000,00	20.883,06	20,46	20,86	21,10	12.453,00
23-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	9,59	4.000,00	38.360,00	9,46	9,59	9,69	20.056,00
23-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	9,64	40.100,00	386.748,94	9,46	9,59	9,69	20.056,00
23-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	32,00	1.100,00	35.200,00	31,40	31,95	32,31	49.358,00
23-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	32,20	12.000,00	386.441,16	31,40	31,95	32,31	49.358,00
23-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	MGLU3	1,47	26.700,00	39.249,00	1,42	1,46	1,53	54.043,00
23-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	16,20	1.500,00	24.299,98	15,80	16,55	16,96	16.261,00
23-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	PETR3	43,51	2.700,00	117.466,29	43,14	43,54	43,83	16.173,00
23-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	21,01	6.400,00	134.462,94	20,78	21,02	21,11	16.595,00
23-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	20,60	1.400,00	28.843,48	20,25	20,79	21,09	10.146,00
23-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	49,62	1.100,00	54.578,86	48,75	49,90	50,47	22.464,00
23-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	SRNA3	8,75	23.500,00	205.648,70	8,64	8,77	8,92	3.695,00
24-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	21,66	1.700,00	36.820,81	21,53	21,62	21,92	9.892,00
24-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	21,60	5.100,00	110.138,48	21,53	21,62	21,92	9.892,00
24-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALPA4	9,37	1.300,00	12.187,00	9,12	9,30	9,46	10.490,00
24-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	BSEF3	32,48	400,00	12.993,25	32,10	32,34	32,61	12.345,00
24-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	32,65	500,00	16.322,63	32,25	32,60	32,75	15.435,00
24-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL66	9,13	5.500,00	50.236,95	9,08	9,13	9,22	21.014,00
24-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	36,81	1.600,00	58.892,32	36,67	36,82	37,22	25.316,00
24-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,52	2.100,00	26.282,38	12,37	12,49	12,89	15.440,00
24-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	31,40	1.300,00	40.820,51	31,17	31,33	31,50	13.333,00
24-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	14,52	1.000,00	14.520,23	14,35	14,50	14,75	8.216,00
24-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	3,63	4.300,00	15.603,19	3,60	3,64	3,71	23.451,00
24-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGT11	21,26	1.600,00	34.021,17	20,76	21,16	21,64	16.063,00
24-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	9,60	25.600,00	245.760,00	9,53	9,57	9,63	18.668,00
24-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	31,98	9.300,00	297.414,00	31,62	31,86	32,09	41.859,00
24-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	MGLU3	1,40	88.800,00	124.429,04	1,36	1,40	1,44	39.746,00
24-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	PETR3	43,43	600,00	26.055,00	43,21	43,47	43,96	33.010,00
24-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	PETR3	43,37	6.900,00	299.266,75	43,21	43,47	43,96	33.010,00
24-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	48,31	300,00	14.493,00	48,12	48,57	49,33	22.579,00
24-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	20,63	4.600,00	94.891,54	20,51	20,66	21,05	32.042,00
24-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	20,73	3.300,00	68.408,48	20,51	20,66	21,05	32.042,00
24-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	21,85	600,00	13.110,72	21,09	21,78	22,12	17.241,00
24-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	49,55	1.200,00	59.455,87	49,26	49,89	50,99	26.196,00
24-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	24,70	700,00	17.291,00	24,27	24,74	25,06	9.622,00
24-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	6,15	1.800,00	11.075,00	6,03	6,10	6,18	10.243,00
24-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	SRNA3	8,83	6.200,00	54.740,05	8,61	8,69	8,89	5.797,00
24-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	60,23	2.800,00	168.653,33	59,91	60,27	60,56	16.699,00
24-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	14,34	1.000,00	14.339,19	14,01	14,22	14,45	9.380,00
24-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	23,90	1.420,00	33.938,00	23,61	23,82	24,01	13.218,00
24-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	23,89	1.809,00	43.217,01	23,61	23,82	24,01	13.218,00
24-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	23,82	800,00	19.056,00	23,61	23,82	24,01	13.218,00
24-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	23,91	4.792,00	114.576,72	23,61	23,82	24,01	13.218,00
24-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	23,85	3.197,00	76.248,45	23,61	23,82	24,01	13.218,00
24-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	23,80	1,00	23,80	23,61	23,82	24,01	13.218,00
24-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	23,85	9.434,00	225.000,90	23,61	23,82	24,01	13.218,00
24-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	23,83	5.935,00	141.431,05	23,61	23,82	24,01	13.218,00
24-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	23,88	1.933,00	46.160,04	23,61	23,82	24,01	13.218,00
24-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	23,84	19.243,00	458.753,12	23,61	23,82	24,01	13.218,00
24-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	23,86	750,00	17.895,00	23,61	23,82	24,01	13.218,00
24-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	23,87	15.723,00	375.308,01	23,61	23,82	24,01	13.218,00
24-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	23,81	560,00	13.333,60	23,61	23,82	24,01	13.218,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – ABRIL 2024

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE ABRIL DE 2024 À 30 DE ABRIL DE 2024



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBovespa			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
24-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	23,87	768,00	18.332,16	23,61	23,82	24,01	13.218,00
24-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RENT3	49,71	1.083,00	53.835,93	49,26	49,89	50,99	26.196,00
24-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RENT3	49,64	523,00	25.961,72	49,26	49,89	50,99	26.196,00
24-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RENT3	49,67	639,00	31.739,13	49,26	49,89	50,99	26.196,00
24-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RENT3	49,73	925,00	46.000,25	49,26	49,89	50,99	26.196,00
24-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RENT3	49,56	1,00	49,56	49,26	49,89	50,99	26.196,00
24-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RENT3	49,63	653,00	32.408,39	49,26	49,89	50,99	26.196,00
24-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RENT3	49,62	3.283,00	162.902,46	49,26	49,89	50,99	26.196,00
24-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RENT3	49,61	599,00	29.716,39	49,26	49,89	50,99	26.196,00
24-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RENT3	49,74	8,00	397,92	49,26	49,89	50,99	26.196,00
24-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RENT3	49,70	693,00	34.442,10	49,26	49,89	50,99	26.196,00
24-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RENT3	49,66	841,00	41.764,06	49,26	49,89	50,99	26.196,00
24-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RENT3	49,60	1.466,00	72.713,60	49,26	49,89	50,99	26.196,00
24-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RENT3	49,69	892,00	44.323,48	49,26	49,89	50,99	26.196,00
24-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RENT3	49,59	557,00	27.621,63	49,26	49,89	50,99	26.196,00
24-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RENT3	49,72	1.092,00	54.294,24	49,26	49,89	50,99	26.196,00
24-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RENT3	49,68	1.099,00	54.598,32	49,26	49,89	50,99	26.196,00
24-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RENT3	49,65	593,00	29.442,45	49,26	49,89	50,99	26.196,00
24-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RENT3	49,62	911,00	45.203,82	49,26	49,89	50,99	26.196,00
24-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	22,69	1.609,00	36.508,21	22,49	22,62	22,96	21.390,00
24-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	22,55	1.512,00	34.095,60	22,49	22,62	22,96	21.390,00
24-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	22,68	1.649,00	37.399,32	22,49	22,62	22,96	21.390,00
25-04-24	FIA EMB VIII ETF	Compra	BOVA11	120,30	1.000,00	120.300,00	120,05	120,72	121,13	39.628,00
25-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	20,61	1.200,00	24.728,01	20,42	20,96	21,68	27.970,00
25-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	21,33	400,00	8.530,88	20,42	20,96	21,68	27.970,00
25-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	21,34	1.100,00	23.476,60	20,42	20,96	21,68	27.970,00
25-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	20,59	400,00	8.236,64	20,42	20,96	21,68	27.970,00
25-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	B3SA3	10,84	1.000,00	10.837,08	10,75	10,84	10,94	17.217,00
25-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	27,36	600,00	16.417,85	27,23	27,41	27,65	22.890,00
25-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	32,20	500,00	16.099,00	31,99	32,15	32,46	9.698,00
25-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	32,56	600,00	19.537,60	32,31	32,60	32,88	18.353,00
25-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPLÉ3	8,18	1.800,00	14.722,50	8,14	8,18	8,28	10.055,00
25-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	36,42	400,00	14.569,70	36,30	36,94	37,29	24.797,00
25-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,59	2.500,00	31.473,50	12,40	12,59	12,72	9.613,00
25-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENJU3	1,97	8.300,00	16.383,73	1,85	1,96	2,04	601,00
25-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENJU3	1,97	10.700,00	21.079,31	1,85	1,96	2,04	601,00
25-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	31,02	1.700,00	52.725,52	30,85	31,00	31,26	10.606,00
25-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	14,59	1.300,00	18.963,57	14,39	14,58	14,67	5.072,00
25-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,55	10.800,00	38.286,59	3,49	3,56	3,63	36.637,00
25-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	9,58	25.800,00	247.164,00	9,46	9,53	9,61	12.568,00
25-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	31,93	8.400,00	268.212,00	31,45	31,73	32,00	28.602,00
25-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	MGLU3	1,39	19.500,00	27.105,00	1,36	1,38	1,40	52.557,00
25-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	16,52	900,00	14.870,38	16,16	16,46	16,64	12.641,00
25-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	PETR3	43,76	5.000,00	218.800,19	43,17	43,93	44,45	14.196,00
25-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	48,87	400,00	19.547,38	47,75	48,66	49,56	25.345,00
25-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	21,68	700,00	15.177,14	21,04	21,60	22,07	10.327,00
25-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	48,55	700,00	33.986,56	48,21	48,56	49,30	35.345,00
25-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	48,56	1.800,00	87.408,79	48,21	48,56	49,30	35.345,00
25-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	48,52	3.000,00	145.548,69	48,21	48,56	49,30	35.345,00
25-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	24,38	900,00	21.939,04	24,11	24,39	24,56	10.240,00
25-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	6,05	2.100,00	12.703,07	6,00	6,06	6,13	10.302,00
25-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	60,33	600,00	36.198,45	59,78	60,18	60,93	15.852,00
25-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	22,35	600,00	13.410,80	22,16	22,36	22,68	8.203,00
25-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	14,84	1.200,00	17.807,42	14,01	14,75	15,12	13.435,00
25-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	23,66	6.454,00	152.705,32	22,72	23,29	23,81	14.152,00
25-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	23,67	18.962,00	448.830,53	22,72	23,29	23,81	14.152,00
25-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RENT3	48,55	5.803,00	281.739,53	48,21	48,56	49,30	35.345,00
25-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RENT3	48,40	3.028,00	146.555,20	48,21	48,56	49,30	35.345,00
25-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RENT3	48,52	6.057,00	293.881,61	48,21	48,56	49,30	35.345,00
25-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	22,71	2.737,00	62.148,66	22,23	22,69	22,90	20.421,00
25-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	22,66	1.846,00	41.829,73	22,23	22,69	22,90	20.421,00
26-04-24	FIA RVA EMB II	Compra	CEAB3	11,56	21.500,00	248.547,46	10,90	11,63	11,96	11.308,00
26-04-24	FIA RVA EMB II	Compra	MULT3	24,35	8.600,00	209.449,74	23,68	24,18	24,54	26.308,00
26-04-24	FIA RVA EMB II	Compra	NTCO3	16,90	8.900,00	150.393,81	16,52	16,86	17,02	10.165,00
26-04-24	FIA RVA EMB II	Compra	PETR3	43,57	5.700,00	248.320,71	43,06	43,63	43,93	15.303,00
26-04-24	FIA RVA EMB II	Compra	PETRE421	1,32	89.800,00	118.387,00		1,37		
26-04-24	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	62,69	7.400,00	463.924,88	62,35	62,78	63,16	28.628,00
26-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	21,02	300,00	6.305,60	20,86	21,34	21,67	20.738,00
26-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	21,23	400,00	8.491,09	20,86	21,34	21,67	20.738,00
26-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ6	9,13	6.200,00	56.625,93	9,00	9,11	9,19	24.126,00
26-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	37,69	1.500,00	56.535,87	37,34	37,73	38,45	25.581,00
26-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,83	1.400,00	17.962,00	12,73	12,81	12,98	10.625,00
26-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,84	8.800,00	112.964,85	12,73	12,81	12,98	10.625,00
26-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENJU3	2,10	7.500,00	15.763,59	1,98	2,06	2,19	1.579,00
26-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENJU3	2,01	24.500,00	49.166,80	1,98	2,06	2,19	1.579,00
26-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	3,78	20.000,00	75.589,03	3,63	3,77	3,82	20.907,00
26-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	20,58	3.600,00	74.100,22	20,42	21,02	21,32	17.637,00
26-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	9,67	27.600,00	266.892,00	9,52	9,67	9,73	15.926,00
26-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	32,21	8.300,00	267.343,00	31,72	32,16	32,35	31.834,00
26-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	MGLU3	1,41	41.600,00	58.794,67	1,40	1,41	1,44	21.619,00
26-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	50,56	2.100,00	106.174,40	49,15	50,38	50,70	19.747,00
26-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	50,55	1.300,00	65.715,00	49,15	50,38	50,70	19.747,00
26-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	59,81	1.000,00	59.810,25	59,46	59,87	60,67	14.707,00
26-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	AURE3	11,52	2.827,00	32.573,44	11,37	11,50	11,63	6.445,00
26-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	AURE3	11,50	15.384,00	176.888,39	11,37	11,50	11,63	6.445,00
26-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	24,25	9.969,00	241.731,07	23,68	24,18	24,54	26.308,00
26-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	24,50	6.270,00	153.615,00	23,68	24,18	24,54	26.308,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – ABRIL 2024

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE ABRIL DE 2024 À 30 DE ABRIL DE 2024



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
26-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	24,35	5.455,00	132.805,85	23,68	24,18	24,54	26.308,00
26-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	23,61	2,00	47,21	22,97	23,58	23,72	16.242,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ABEV3	12,03	1.355,00	16.300,65	11,98	12,03	12,08	14.380,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ALOS3	21,54	164,00	3.531,98	20,86	21,34	21,67	20.738,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ALPA4	9,45	54,00	510,30	9,34	9,44	9,55	5.943,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ARZZ3	51,84	20,00	1.036,80	51,35	52,15	53,18	8.798,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ASAI3	13,34	416,00	5.549,44	13,18	13,37	13,52	25.767,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	AZUL4	9,76	101,00	985,76	9,32	9,60	9,84	15.053,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	B3SA3	11,23	1.727,00	19.394,21	10,87	11,12	11,27	53.916,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBA53	27,60	875,00	24.150,00	27,44	27,56	27,70	25.033,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBDC3	12,27	462,00	5.668,74	12,02	12,20	12,29	4.555,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBDC4	13,98	1.586,00	22.172,28	13,70	13,89	14,00	17.519,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBSE3	32,16	207,00	6.657,12	32,06	32,18	32,35	10.270,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BEEF3	6,12	81,00	495,72	6,03	6,12	6,17	8.127,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BHIA3	5,44	29,00	157,76	5,42	5,49	5,66	6.019,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BPAC11	34,07	355,00	12.094,85	32,73	33,73	34,23	27.869,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRAP4	21,11	78,00	1.646,58	20,95	21,10	21,22	9.521,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRFS3	17,49	517,00	9.042,33	17,35	17,55	17,78	12.664,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRKM5	22,78	82,00	1.867,92	22,43	22,83	23,06	5.718,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CCRO3	12,47	307,00	3.828,29	12,28	12,46	12,54	10.870,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CIEL3	5,58	338,00	1.886,04	5,56	5,57	5,59	18.862,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CMIG4	12,62	443,00	5.590,61	12,57	12,63	12,78	15.316,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CMIN3	5,00	342,00	1.710,00	4,95	4,99	5,03	9.973,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	COGN3	2,18	560,00	1.220,80	2,14	2,17	2,22	10.679,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CPFE3	34,89	58,00	2.023,62	34,75	34,95	35,20	6.863,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CPL6	9,14	518,00	4.734,52	9,00	9,11	9,19	24.126,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CRFB3	11,50	165,00	1.897,50	11,27	11,43	11,63	12.676,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CSAN3	14,76	360,00	5.313,60	14,37	14,75	14,88	15.205,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CSNA3	14,12	185,00	2.612,20	14,08	14,17	14,33	9.433,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CVCB3	2,11	162,00	341,82	2,04	2,07	2,14	8.875,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CYRE3	20,90	82,00	1.713,80	20,65	20,94	21,29	18.455,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	DXCO3	7,34	94,00	689,96	7,12	7,30	7,36	5.769,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	EGIE3	39,79	78,00	3.103,62	39,55	39,74	39,91	4.474,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ELET3	37,77	610,00	23.039,70	37,34	37,73	38,45	25.581,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ELET6	42,58	83,00	3.534,14	42,28	42,69	43,40	8.287,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	EMBR3	33,25	226,00	7.514,50	32,25	33,11	33,44	15.968,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ENEV3	12,76	487,00	6.214,12	12,73	12,81	12,98	10.625,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ENGI11	46,35	100,00	4.635,15	45,61	46,30	46,57	12.817,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	EQTL3	31,24	337,00	10.527,88	30,93	31,22	31,59	17.813,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	EZTC3	13,87	28,00	388,36	13,40	13,78	13,95	4.597,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	FLRY3	14,57	74,00	1.078,18	14,55	14,64	14,89	6.706,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	GGBR4	18,59	416,00	7.733,44	18,15	18,51	18,68	23.276,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	GOAU4	10,64	203,00	2.159,92	10,38	10,58	10,68	11.017,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	HAPV3	3,77	1.354,00	5.104,58	3,63	3,77	3,82	20.907,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	HYPE3	28,36	127,00	3.601,59	27,31	28,15	28,66	20.423,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	IGTI11	21,13	67,00	1.415,71	20,42	21,02	21,32	17.637,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	IRBR3	42,30	25,00	1.057,50	41,25	42,19	42,76	5.374,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ITSA4	9,72	1.657,00	16.106,04	9,52	9,67	9,73	15.926,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ITUB4	32,28	1.480,00	47.774,40	31,72	32,16	32,35	31.834,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	JBSS3	22,88	350,00	8.008,00	22,16	22,86	23,05	18.777,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	KLBN11	23,07	218,00	5.029,26	23,03	23,16	23,48	12.571,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	LREN3	15,64	294,00	4.598,16	15,58	15,71	15,92	15.954,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	LWSA3	4,69	121,00	567,49	4,55	4,65	4,71	9.579,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	MGLU3	1,42	968,00	1.374,56	1,40	1,44	1,44	21.619,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	MRFG3	9,76	103,00	1.005,28	9,66	9,76	9,87	9.029,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	MRVE3	6,63	116,00	769,08	6,42	6,62	6,70	11.481,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	MULT3	24,09	83,00	1.999,47	23,68	24,18	24,54	26.308,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	NTCO3	16,84	260,00	4.378,40	16,52	16,86	17,02	10.165,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PCAR3	2,77	11.710,00	32.436,70	2,72	2,78	2,90	14.670,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PETR3	43,68	734,00	32.061,12	43,06	43,63	43,93	15.303,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PETRA	41,37	1.407,00	58.208,13	41,07	41,47	41,78	57.312,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PETZ3	5,03	96,00	482,88	4,85	5,02	5,17	13.785,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PRIQ3	49,26	247,00	12.167,22	48,95	49,33	49,95	20.139,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RADL3	25,55	394,00	10.066,70	24,99	25,46	25,62	9.647,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RAIL3	20,87	376,00	7.847,12	20,61	20,88	21,05	15.749,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RAI24	3,09	367,00	1.134,03	3,04	3,07	3,11	11.725,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RDR3	25,84	360,00	9.302,40	25,08	25,84	26,16	13.881,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RECV3	22,56	85,00	1.917,60	21,94	22,41	22,70	8.549,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RENT3	50,42	263,00	13.260,46	49,15	50,38	50,70	19.747,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RRRP3	35,28	73,00	2.575,28	34,35	35,32	35,67	18.223,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SANB11	27,46	106,00	2.910,76	26,55	27,21	27,50	8.515,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SBS3	82,26	104,00	8.555,04	81,81	82,30	82,74	8.762,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SLCE3	18,78	60,00	1.126,80	18,65	18,76	18,98	6.645,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SMTQ3	28,15	44,00	1.238,56	27,46	27,97	28,26	4.810,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SOMA3	6,08	153,00	930,24	6,01	6,10	6,30	17.601,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SUZB3	59,66	210,00	12.528,60	59,46	59,87	60,67	14.707,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	TAE11	35,41	68,00	2.407,88	35,22	35,43	35,67	5.104,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	TIMS3	17,53	249,00	4.364,97	17,39	17,49	17,63	8.957,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	TOTS3	28,05	159,00	4.459,95	28,01	28,25	28,49	8.072,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	TRPL4	25,42	122,00	3.101,24	25,15	25,40	25,57	8.883,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	UGPA3	26,75	335,00	8.961,25	26,25	26,60	26,78	8.923,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	USIM5	8,18	159,00	1.300,62	8,11	8,19	8,40	22.809,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VALE3	62,91	1.293,00	81.342,63	62,35	62,78	63,16	28.628,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VAMO3	7,22	130,00	938,60	6,93	7,16	7,28	17.876,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VBRR3	23,65	343,00	8.111,95	22,97	23,58	23,72	16.242,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VIVT3	48,34	131,00	6.332,56	47,81	48,13	48,38	6.955,00
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	WEGE3	39,15	457,00	17.891,55	38,66	39,18	39,38	17.373,00

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE ABRIL DE 2024 À 30 DE ABRIL DE 2024



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
26-04-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	YDUQ3	15,61	89,00	1.389,29	15,20	15,49	15,68	10.817,00
29-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALPA4	9,69	7.600,00	73.606,10	9,35	9,63	9,80	9.291,00
29-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALPA4	9,56	1.700,00	16.254,04	9,35	9,63	9,80	9.291,00
29-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENJU3	2,20	17.200,00	37.842,73	2,13	2,19	2,30	3.353,00
29-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	20,80	4.700,00	97.738,91	20,63	20,79	20,94	16.826,00
29-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	58,85	800,00	47.081,34	58,55	58,99	59,66	21.192,00
29-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	AURE3	11,62	1.300,00	15.101,44	11,49	11,60	11,68	4.473,00
29-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	ITUB4	31,86	6.498,00	207.012,29	31,71	31,91	32,30	29.134,00
29-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	24,05	31.883,00	766.797,36	23,74	23,96	24,17	13.926,00
30-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	20,89	200,00	4.178,00	20,45	20,74	21,33	19.074,00
30-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	20,62	300,00	6.184,73	20,45	20,74	21,33	19.074,00
30-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALPA4	9,73	600,00	5.840,33	9,42	9,52	9,86	7.064,00
30-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	33,47	700,00	23.431,56	33,33	33,49	33,88	21.804,00
30-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPLF6	9,07	1.600,00	14.510,96	8,98	9,05	9,15	18.007,00
30-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	37,73	900,00	33.958,15	37,36	37,68	38,01	27.995,00
30-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,40	2.600,00	32.238,52	12,34	12,41	12,60	10.800,00
30-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQL3	30,57	1.400,00	42.797,47	30,44	30,58	30,92	14.405,00
30-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQL3	30,58	1.100,00	33.638,00	30,44	30,58	30,92	14.405,00
30-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	14,53	1.400,00	20.346,85	14,43	14,54	14,70	10.626,00
30-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	3,72	5.200,00	19.347,01	3,68	3,72	3,82	23.055,00
30-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGT11	20,88	1.300,00	27.146,72	20,71	20,91	21,37	20.444,00
30-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	9,60	3.900,00	37.443,71	9,54	9,60	9,72	28.973,00
30-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	1,36	9.300,00	12.627,66	1,34	1,38	1,45	34.874,00
30-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	MULT3	22,75	16.400,00	373.100,00	22,54	22,74	22,90	21.320,00
30-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRIQ3	48,13	400,00	19.252,11	47,98	48,24	49,43	23.311,00
30-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	20,20	6.600,00	133.292,17	20,04	20,25	20,80	33.377,00
30-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	21,61	800,00	17.284,96	21,47	21,76	22,39	10.708,00
30-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	49,06	1.000,00	49.064,54	48,94	49,22	50,44	20.136,00
30-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	SCAR3	26,75	100,00	2.674,77	26,40	27,23	27,78	196,00
30-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	24,32	800,00	19.457,70	23,98	24,37	25,06	6.615,00
30-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	6,01	1.900,00	11.410,09	5,94	6,02	6,10	20.800,00
30-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	SRNA3	8,22	1.500,00	12.326,59	8,13	8,27	8,51	6.144,00
30-04-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	58,42	5.400,00	315.464,96	58,10	58,42	59,21	21.152,00
30-04-24	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	14,58	1.300,00	18.958,08	14,45	14,65	15,24	17.132,00
30-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	AURE3	11,60	1.016,00	11.783,28	11,52	11,57	11,62	6.658,00
30-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	AURE3	11,58	10.826,00	125.313,04	11,52	11,57	11,62	6.658,00
30-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	ITUB4	31,82	598,00	19.028,31	31,36	31,65	32,20	47.376,00
30-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	ITUB4	31,36	2.884,00	90.442,24	31,36	31,65	32,20	47.376,00
30-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	ITUB4	31,52	18.142,00	571.788,72	31,36	31,65	32,20	47.376,00
30-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	ITUB4	31,59	11.536,00	364.396,02	31,36	31,65	32,20	47.376,00
30-04-24	FIA RVA EMB IV	Venda	ITUB4	31,72	14.420,00	457.403,10	31,36	31,65	32,20	47.376,00
30-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	22,75	2.789,00	63.449,75	22,54	22,74	22,90	21.320,00
30-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	22,74	59,00	1.341,88	22,54	22,74	22,90	21.320,00
30-04-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	22,75	20.921,00	475.952,75	22,54	22,74	22,90	21.320,00

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.