



# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO

Agosto/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 – AGOSTO 2024



Data: 30/08/2024

## Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS  
 CNPJ: 10679245000140

		Dados Gerais			
PL:	4.916.798.801,80	VAR / PL:	1,8648%	Limite Fundo:	0,00%
VAR:	91.689.400,50	ETL / PL:	2,3386%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	114.982.207,31	VAR / Cdi:	0,0204%	Benchmark:	
				Datation DC:	1.551,53
				Datation DU:	1.066,63

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	140.261.567,31	Cenário Baixa - 10000 (+):	183.201.645,72	CENARIO BRADESCO 1 (+):	270.732.858,12	CENARIO BRADESCO 2 (+):	1.248.257.656,74
Cenário Alta - 09999 (-):	-235.591.724,24	Cenário Baixa - 10000 (-):	-146.638.489,67	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-4.610.989,24	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-1.548.659.341,19
Cenário Alta - 09999:	-95.330.156,93	Cenário Baixa - 10000:	36.563.156,05	CENARIO BRADESCO 1:	266.121.868,87	CENARIO BRADESCO 2:	-300.401.684,45

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	6.569.955,74	54.996,52	7.628,23	0,01%	0,00	0,00	0,00	0,00
AEGP23	7.461.400,14	42.634,06	19.121,76	0,02%	-278.404,74	-44.696,80	73.275,55	-97.725,00
CCRDD1	3.277.587,87	10.383,83	8.652,78	0,01%	650.743,78	-1.394.487,10	681.421,70	-686.999,50
CMDD33	728.724,87	3.130,58	1.542,18	0,00%	-182.445,92	-1.291,77	45.930,07	-61.880,32
CSMG33	5.539.511,33	22.297,67	14.124,50	0,02%	-4.863,56	4.012,63	6.730,24	-9.321,24
ELET42	14.948.527,26	159.893,14	43.280,78	0,05%	995.820,48	-995.820,48	291.974,57	-294.364,53
ENJG21	1.431.125,38	11.812,59	1.603,21	0,00%	0,00	0,00	778.457,09	-785.937,37
ENM21	933.350,50	7.926,00	1.003,91	0,00%	15.005,38	-15.005,38	8.739,15	-8.871,18
ENTV12	32.870.934,57	358.817,61	241.671,50	0,26%	-1.363.145,73	-106.869,65	544.910,90	-679.231,67
ERDV17_VENCIMENTO	6.527.670,75	22.755,45	4.167,54	0,00%	-110.490,92	-23.954,94	28.607,76	-37.879,14
ERDV36	2.248.095,50	7.122,26	5.934,94	0,01%	-58,80	48,06	89,53	-131,39
GASP17	61.894.525,64	583.460,05	451.556,72	0,49%	-371.651,51	-68.619,14	116.180,00	-150.644,90
GRRB24_VENCIMENTO	16.377.933,35	192.979,21	42.701,50	0,05%	-225,53	183,35	325,95	-471,28
IGSN15	2.615.908,12	48.469,29	43.094,57	0,05%	-793,03	640,43	1.139,68	-1.654,36
LFSN16000GM	15.760.172,00	58.668,41	37.682,87	0,04%	-449.919,68	-86.561,65	139.291,46	-179.799,91
LFSN1800DC5	1.517.032,07	38.843,89	19.514,12	0,02%	105.428,86	-97.898,23	55.199,54	-55.651,38
NEOE16	7.547.272,87	83.308,59	25.034,07	0,03%	-490.169,64	-28.131,68	214.575,95	-260.314,50
NTNB20260815 - 760199_VENCIMENTO	42.748.918,02	209.625,07	137.871,43	0,15%	558.505,80	-692.547,20	327.507,80	-330.188,63
NTNB20300815 - 760199_VENCIMENTO	26.340.067,28	404.912,45	382.576,16	0,42%	24.607,51	-14.354,38	6.012,43	-6.061,65
NTNB20350515 - 760199_VENCIMENTO	238.705.237,31	5.860.358,83	5.518.927,53	6,02%	0,00	0,00	0,00	0,00
NTNB20400815 - 760199_VENCIMENTO	29.833.006,39	923.312,02	890.832,97	0,97%	1.477.410,20	-1.477.410,20	865.353,34	-873.444,91
NTNB20450515 - 760199_VENCIMENTO	225.380.510,31	7.856.669,41	7.607.946,85	8,30%	-744.173,56	-48.398,41	320.960,48	-391.382,14
NTNB20500815 - 760199_VENCIMENTO	701.096.318,92	26.085.270,94	25.204.497,36	27,49%	1.842.977,77	-1.842.977,77	1.080.722,16	-1.089.568,46
NTNB20550515 - 760199_VENCIMENTO	223.868.978,12	8.599.728,05	8.280.720,65	9,03%	102.603,38	-102.603,38	60.166,62	-60.659,12
OMGE31	13.080.790,68	124.473,99	4.337,38	0,00%	1.843.213,10	-1.843.213,10	1.080.860,16	-1.089.707,59
SBSPC2	8.913.067,75	38.290,32	18.862,53	0,02%	634.870,70	-634.870,70	465.360,23	-469.169,45
TAE33	4.462.380,20	7.277,70	4.208,17	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
020913	718.264,39	49.434,69	-2.680,33	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ABEV3	4.648.169,84	550.157,73	480.250,40	0,52%	-10,23	8,79	17,82	-26,66
AEGP11	1.945.201,85	1.218,43	1.101,01	0,00%	-163,80	140,28	284,57	-424,66
AIEC11	1.991.640,96	38.320,81	22.814,28	0,02%	3.829,26	-3.829,26	2.245,48	-2.263,86
ALOS3	5.316.896,95	378.322,61	318.186,81	0,35%	0,00	0,00	0,00	0,00
ALP44	60.921,50	4.624,74	-1.543,74	0,00%	3.609.522,30	-3.609.522,30	529.155,97	-533.487,40
ANEM11	10.581.443,90	297.116,82	275.108,25	0,00%	2.201.117,77	-2.567.970,73	1.075.612,89	-1.084.417,36
ANET11	1.951.168,53	15.941,77	2.889,18	0,00%	4.817.380,56	-4.817.380,56	706.227,96	-712.008,82
ANHB10	469.230,97	8,81	5,69	0,00%	19.182,82	-19.182,82	11.248,80	-11.340,88
APPSA2	3.461.385,94	51.182,04	44.499,73	0,05%	310.517,30	-310.517,30	182.087,34	-183.577,83
APRB28	1.024.804,04	42,34	33,75	0,00%	222.485,31	-222.485,31	69.396,48	-69.964,53
ARTRA1	2.666.100,78	138,69	104,91	0,00%	23.931,86	-13.053,99	6.378,93	-6.431,15
ASAB11	4.448.677,96	66.801,41	57.856,35	0,06%	-1.486.642,32	-209.560,30	533.701,56	-677.564,39
ASAJ3	376.531,65	36.006,48	27.980,05	0,03%	-3.041,17	2.455,43	4.301,62	-6.194,45
ASER12	2.851.756,16	114.371,04	108.807,39	0,12%	-233,85	193,28	370,24	-549,03
AURE3	2.234.023,21	187.979,74	-138.973,86	-0,15%	-739.877,91	-178.056,46	192.783,84	-254.627,28
AZUL4	41.012,51	8.608,79	1.760,04	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
AZZA3	2.883.307,00	242.188,47	168.533,10	0,18%	-844.618,90	-118.246,03	293.500,49	-374.714,14
B3SA3	5.909.640,80	929.172,41	790.430,86	0,96%	-212.291,71	179.695,37	276.966,05	-365.603,46
ENJG21	4.997.726,71	174.368,06	165.422,91	0,18%	-1.942.681,86	-308.444,24	956.823,19	-841.379,05
BBAS3	7.371.911,08	598.865,71	441.667,27	0,48%	-436.221,61	-65.527,95	150.011,10	-191.795,23
BBDC3	110.413,50	95.421,99	76.053,61	0,08%	910,65	-810,65	267,00	-269,19
BBDC4	7.372.852,40	1.832.345,03	1.469.508,38	1,60%	-30.678,92	-10.025,70	4.934,88	-6.685,02
BBS3	3.174.353,52	250.780,05	226.690,87	0,25%	56.494,69	-56.494,69	33.128,49	-33.399,66
BBTOPIMA	81.445.402,41	503.633,63	435.069,21	0,47%	0,00	0,00	0,00	0,00
BBTOPIND	262.996.339,31	4.285.703,82	3.929.705,88	4,29%	-1.508,41	1.220,48	2.114,64	-3.027,41
BCBF14	178.653,28	1,33	-0,12	0,00%	-725,57	585,59	1.055,00	-1.537,12
BCBF15	2.036.646,24	20,58	1,37	0,00%	-199,80	166,67	323,25	-481,53
BEF3	15.317,05	2.881,70	1.784,54	0,00%	329.208,90	-329.208,90	96.524,05	-97.314,15
BKBR18	2.611.149,51	0,00	0,00	0,00%	-6.935,25	5.726,91	9.680,11	-13.448,71
BMLC11	3.609.522,30	105.966,21	-35.235,24	-0,04%	-446.733,52	-17.848,77	189.999,54	-237.148,78
BPAC11	7.337.059,24	978.321,72	895.268,56	0,91%	-387.956,01	-57.628,76	132.247,05	-170.086,52
BPML11	4.817.380,36	249.447,44	86.476,98	0,07%	-783.415,58	-100.946,48	277.372,63	-353.290,15
BRG14	7.821,39	74.444,16	62,26	0,00%	-369.751,47	-44.776,20	133.127,91	-168.629,03
BRFS3	1.242.069,19	227.684,43	44.440,73	0,05%	-13.666,12	11.553,87	19.192,06	-25.640,31
BRIT3	473.373,00	65.283,62	-36.823,91	-0,04%	-11.893,57	-1.943,84	2.095,34	-2.833,89
BRKM5	43.512,48	4.775,53	822,25	0,00%	476.751,50	-572.101,80	279.567,08	-281.855,49
BRKP28	10.833.209,41	327.100,13	298.556,91	0,33%	72.299,58	-72.299,58	30.283,20	-30.531,08
BRKPA0	2.907.372,25	614,89	501,35	0,00%	133.489,50	-133.489,50	39.139,12	-39.459,50
CAEC11	2.610.844,79	29,17	9,01	0,00%	-1.247.402,47	-138.357,65	462.948,33	-586.360,27
CAEC21	9.312.744,76	102.748,04	8.374,88	0,01%	7.661,38	-10.725,94	4.492,64	-4.529,41
CAIXA	57.113,85	0,00	0,00	0,00%	-46.110,81	47.030,24	161.680,33	-246.091,04
CART13	4.751.592,42	150.969,16	135.385,27	0,15%	0,00	0,00	0,00	0,00
CBAN22	9.621.799,44	78.194,17	72.834,12	0,08%	39.033,05	-39.033,05	28.611,23	-28.845,42
CBAN32	16.335.689,64	333.636,85	299.228,13	0,33%	1.253.822,72	-1.253.822,72	835.501,87	-842.340,97
CBAN72	3.961.157,00	78.524,72	70.928,09	0,08%	1.950.563,63	-1.950.648,64	1.299.841,32	-1.310.481,22
CBOP11	7.821,39	76,90	62,26	0,00%	0,18	-0,18	0,62	-0,62
CCRO3	225.976,75	21.779,99	19.756,87	0,02%	-3.837,71	3.222,86	5.376,96	-7.262,36
CDB323R5TI	6.803.046,80	0,00	0,00	0,00%	8.622,41	-8.622,41	5.056,18	-5.097,57
CEAB13	1.508.592,36	322,41	270,84	0,00%	-618.795,28	-106.995,21	187.817,01	-245.109,60
CEEB43	1.920.150,34	125,36	91,34	0,00%	-459.447,94	-30.329,65	193.414,97	-237.777,98
CELGI2	1.562.585,18	25,91	2,79	0,00%	-4.661,42	3.946,69	6.528,51	-8.686,01
CEOC11	658.417,80	30.535,42	20.742,61	0,02%	149.491,72	-149.491,72	87.661,95	-88.379,51
CGBP13	4.609.905,85	1.704,25	1.536,40	0,00%	-250.796,72	-54.676,35	70.351,15	-92.245,21
CGOS16	3.165.616,38	115.921,43	105.991,15	0,12%	-386.661,10	-63.831,52	128.025,48	-164.375,75
CHSF13	3.226.972,19	69.896,51	64.214,24	0,07%	-105.334,92	-8.710,01	22.797,56	-30.753,88
CJEN13	7.086.803,21	143.691,86	128.600,62	0,14%	106.303,55	-79.727,66	38.960,25	-39.279,16
CLCD27	2.625.102,74	81.650,67	74.317,84	0,08%	200.088,00	-200.088,00	97.776,34	-98.576,69
CLM12	2.554.550,15	3.653,17	3.393,29	0,00%	27.587,88	-27.587,88	8.088,77	-8.154,98

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2024



Data: 30/08/2024

## Relatório de Risco de Mercado

<b>FUNDO:</b>	<b>EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS</b>							
<b>CNPJ:</b>	<b>10679245000140</b>							

Dados Gerais			Limite Fundo:			ENQUADRADO			0,00% Dutation DC:		
PL:	4.916.798.801,80	VAR / PL:	1,8648%	Status:		Dutation DC:					1.551,53
VAR:	91.689.400,50	ETL / PL:	2,3386%	Benchmark:		Dutation DU:					1.066,63
ETL:	114.982.207,31	VAR / Cdi:	0,0204%								

Cenários de STRESS											
Cenário Alta - 09999 (+):	140.261.567,31	Cenário Baixa - 10000 (-):	183.201.645,72	CENARIO BRADESCO 1 (+):	270.732.858,12	CENARIO BRADESCO 2 (+):	1.248.257.656,74				
Cenário Alta - 09999 (-):	-235.591.724,24	Cenário Baixa - 10000 (-):	-146.638.489,67	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-4.610.989,24	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-1.548.659.341,19				
Cenário Alta - 09999:	-95.330.156,93	Cenário Baixa - 10000:	36.563.156,05	CENARIO BRADESCO 1:	266.121.868,87	CENARIO BRADESCO 2:	-300.401.684,45				

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
CMG4	1.907.005,99	236.235,48	190.667,21	0,21%	166.266,42	-166.266,42	121.873,29	-122.870,88
CMN3	206.570,24	30.127,58	6.224,70	0,01%	37.488,51	-33.973,96	17.174,42	-17.315,00
CNES11	266.979,00	23.420,64	18.300,96	0,02%	-216.386,42	196.253,75	146.299,53	-146.500,81
CNRD11	10.210.993,01	254.980,11	230.278,48	0,25%	-1.471.448,62	1.288.094,10	1.378.323,19	-1.349.615,82
COGN3	30.645,53	4.904,25	-1.095,42	0,00%	-603.115,52	520.649,51	590.823,01	-566.041,20
COMPROMISSADA PRE	1.608.375.492,04	5.022,43	-3.549,83	0,00%	106.921,73	-96.966,15	-115.844,99	104.097,45
CONTAS_A PAGAR_RECEBER	5.140.512,52	0,00	0,00	0,00%	-1.087.216,73	857.017,86	1.003.479,92	-990.229,72
CPEF3	195.165,25	7.994,86	4.697,08	0,01%	-1.906.398,04	1.673.750,64	1.851.694,47	-1.788.272,57
CPLE3	5.699.194,20	326.685,36	255.084,59	0,28%	207.063,04	-180.915,69	-205.904,78	194.853,07
CPLE6	8.866.584,72	456.159,95	228.300,77	0,25%	280.998,14	-250.894,38	-292.112,22	270.552,97
CPMU24C100500	-436,47	148,39	-21,18	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPTe12	1.788.639,45	1.002,61	926,01	0,00%	-11.191,00	9.609,08	15.855,79	-20.642,70
CRFB3	34.489,65	4.647,61	1.231,63	0,00%	-3.106,76	2.548,67	4.374,91	-6.174,22
CRMG15	7.546.570,62	78.676,84	56.771,10	0,06%	-662.301,74	509.497,89	1.232.453,20	-1.854.958,57
CRTR12	2.969.199,34	105.535,09	99.349,09	0,11%	-676.399,24	499.545,45	907.781,21	-1.316.804,32
CSAN23	1.096.525,38	1.267,51	1.180,66	0,00%	211.788,73	-162.530,87	-277.395,21	388.135,76
CSAN3	597.966,88	54.855,07	20.130,93	0,02%	-327.060,58	262.693,68	437.615,16	-590.153,19
CSMGB8	2.835.519,42	28.814,21	14.339,01	0,02%	190.880,77	-157.656,76	-262.240,69	340.970,43
CSMGB9	3.376.565,94	63.389,70	56.325,31	0,06%	109.768,37	-94.353,21	-157.417,72	190.391,01
CSNA3	265.758,88	31.007,71	4.568,85	0,00%	183.806,13	-164.527,49	-276.434,85	311.157,94
DASAC5	686.960,00	53.072,24	31.830,98	0,03%	-73.616,17	56.058,42	107.070,69	-158.292,25
CVCB3	55.175,76	11.406,68	6.494,02	0,01%	658.853,57	-501.111,85	373.414,96	-1.244.596,73
CXSE3	831.332,10	100.839,75	68.203,94	0,07%	28.025,32	-22.103,91	37.044,56	50.902,62
CYRE3	117.151,58	16.923,57	13.477,46	0,01%	14.191,18	-14.474,15	-49.759,15	75.737,60
DAPK25	21.998,32	35.343,28	-5.323,98	-0,01%	-159.620,07	163.675,07	562.258,85	-853.501,59
DAPK27	40.764,05	396.149,60	321.268,30	0,35%	-24.256,87	18.358,16	33.369,54	-48.858,36
DAPK29	-35.277,68	178.983,15	166.864,25	0,18%	442.629,00	-442.634,10	216.298,04	-218.068,55
DAPK35	7.275,14	38.291,94	-36.808,57	-0,04%	-1.257.816,74	1.278.543,06	-1.635.962,23	1.645.320,03
DAPQ26	69.441,27	245.899,60	158.464,65	0,17%	-1.313,60	1.576,32	-770,30	776,60
DAPQ28	-54.372,57	555.662,08	490.991,38	0,54%	95.716,62	-95.716,62	77.955,87	-78.593,98
DAPQ30	13.346,91	66.328,50	-64.172,88	-0,07%	-548,18	446,69	836,79	-1.234,13
DAPQ32	18.594,66	99.709,46	-97.452,03	-0,11%	-369.921,94	-62.965,80	119.916,45	-154.987,27
DASA42	1.327.789,80	0,00	0,00	0,00%	-3.557,93	2.908,92	4.925,27	-6.321,70
DASAC5	2.002.580,85	3.101,25	2.908,32	0,00%	4.072.779,30	-4.072.779,30	1.990.231,49	-2.006.522,60
DESK13	2.719.834,49	706,76	621,11	0,00%	-1.354.370,02	-358.602,32	342.852,28	-451.756,72
DHF25	-462,41	72.097,63	-14.069,24	-0,02%	48.350,11	-48.350,11	23.627,09	-23.820,49
DHF26	-8.836,69	127.669,84	95.288,16	0,10%	68.102,53	-68.102,53	39.935,32	-40.262,21
DHF27	12.385,43	55.911,87	-49.950,79	-0,05%	1.236.357,30	-1.704.168,17	489.864,81	-493.874,62
DHF28	-26.278,42	94.557,76	87.908,35	0,10%	-292.020,34	-34.823,10	108.672,76	-137.600,37
DHF29	17.593,70	56.250,54	-53.175,96	-0,06%	2.628.475,00	-3.401.555,88	2.266.673,15	-2.285.227,09
DHF31	10.951,24	31.504,59	-29.780,58	-0,03%	13,02	-13,02	2,39	-2,41
DHF33	19.517,55	52.150,13	-49.027,72	-0,05%	-58.587,26	-9.825,61	14.971,71	-19.987,75
DHN25	609,98	9.810,16	3.510,65	0,00%	-39.034,42	-6.528,21	10.005,36	-13.356,06
DHN26	25.855,18	156.081,38	-132.395,81	-0,14%	-3.038.001,49	-615.538,00	890.256,14	-1.162.743,89
DHN27	2.001,53	7.878,25	-7.199,22	-0,01%	0,00	0,00	13.024,25	-13.130,86
DHU24	-84,53	1.545,72	1.092,51	0,00%	5.494.777,20	-5.494.777,20	4.027.671,69	-4.060.640,35
DHU24	373,72	16.333,22	-6.436,97	-0,01%	-114.668,78	-5.598,88	25.883,83	-34.906,69
DHU24	21,74	3.946,24	2.415,50	0,00%	-153.673,53	-7.511,27	54.743,40	-46.854,62
DIRR3	1.475.430,00	115.738,72	35.558,99	0,04%	-21.042,65	-6.876,62	3.384,83	-4.585,25
DOLV24	-47.211,08	672.177,28	509.134,04	0,56%	-183.926,54	-16.616,34	46.805,59	-62.772,97
DXCO3	-5.254,40	894,57	-794,65	0,00%	3.361.393,74	-3.361.393,74	492.780,32	-496.814,00
EGIE3	531.759,00	25.245,82	-2.956,86	0,00%	9.352,61	-14.029,41	6.855,71	-6.911,82
ELET13	2.078.419,41	70,06	39,66	0,00%	355.752,00	-355.752,00	104.306,49	-105.160,29
ELET14	3.284.246,83	58.134,51	53.179,22	0,06%	832.427,31	-832.427,31	610.169,22	-615.163,78
ELET24	2.769.341,94	850,35	752,06	0,00%	381.893,75	-381.893,75	111.971,25	-112.887,79
ELET3	13.575.931,00	1.331.687,38	1.090.481,73	1,19%	-360.297,78	-15.917,15	151.589,41	-189.933,20
ELET6	161.167,02	14.802,29	12.196,57	0,01%	-1.437.941,68	1.650.321,90	1.190.128,69	-1.573.394,59
EMBR3	272.410,11	20.205,91	9.139,14	0,01%	-749.179,67	-52.622,95	322.935,61	-390.987,53
ENEV3	3.341.906,22	237.834,16	129.874,99	0,14%	403.835,25	-403.835,25	236.808,99	-238.747,40
ENEVA0	2.146.813,41	66.758,90	60.753,71	0,17%	3.337.064,15	-3.337.064,15	1.087.141,34	-1.095.040,18
ENGB11	15.461.617,65	1.682.473,58	1.071.753,73	1,17%	1.153.693,61	-1.025.837,31	939.933,44	-947.611,92
ENGM4	16,28	1,23	1,23	0,00%	100.899,11	-84.082,60	49.306,03	-49.709,63
EQLT1	88.842,10	430.595,94	310.366,44	0,34%	-102,45	84,05	156,38	-229,96
EQLT3	27.473.886,00	2.243.385,67	1.437.266,19	1,57%	-881.727,95	-226.079,77	227.819,14	-300.010,34
ERDV17	4.863.114,71	16.952,81	3.104,82	0,00%	-1.531.487,87	-392.681,69	395.702,83	-521.092,93
ERDV38	5.951.424,96	44.588,59	6.975,41	0,01%	-1.386,42	1.128,90	2.023,92	-2.932,68
EVBI11	3.361.393,74	4.324.456,40	3.287.085,29	3,59%	574.626,15	-574.626,15	168.480,39	-169.859,49
EZTC3	46.764,71	5.160,83	2.543,12	0,00%	-1.084,83	895,63	1.505,96	-2.088,17
FIGS11	711.504,00	15.210,13	2.761,64	0,00%	3.682.914,63	-3.682.914,63	1.587.986,13	-1.600.984,65
FLRY3	4.162.136,55	252.088,23	133.904,84	0,15%	-1.214.972,85	-97.531,84	476.352,93	-598.681,95
FVPR11	763.787,50	52.551,21	20.227,33	0,02%	0,00	0,00	48.480,41	-48.877,25
GASC16	2.950.042,02	96.518,77	87.204,51	0,10%	-698.058,83	-94.045,57	247.984,58	-315.577,52
GBSP11	4.863.146,09	167.248,28	159.688,82	0,17%	42.581,97	-38.879,19	27.141,37	-27.363,54
GGBR4	1.615.341,00	124.838,21	29.476,32	0,03%	-172.680,28	-35.676,48	96.049,37	-122.461,85
GGPS3	7.415.698,10	641.740,89	550.937,85	0,60%	-26,12	37.471,33	-26,12	135.081.726,22
GMAT3	6.411.483,20	1.145.764,74	829.747,44	0,90%	26,12	-43.549,82	26,12	-135.330.323,45
GOAU4	336.330,38	25.709,52	1.133,28	0,00%	3.213,56	-811.703,35	3.213,56	-53.698.849,90
GRRB14	1.055.613,36	14,80	8,84	0,00%	-8.243,48	902.593,51	-8.243,48	53.788.804,68
GRRB24	9.429.315,05	111.104,48	24.584,66	0,03%	-17.811,16	534.312,76	-17.811,20	24.909.765,00
GUAR15	2.652.977,74	253,51	199,68	0,00%	60.332,70	-1.133.042,45	60.333,60	-49.882.379,84
GZTI11	1.149.252,30	97.024,38	76.957,75	0,08%	-48.240,00	593.101,57	-48.244,80	24.966.892,44
HAPV22	584.219,18	275,00	248,78	0,00%	-24.165,21	1.483.711,76	-24.165,23	45.510.338,18
HAPV3	10.832.101,84	1.203.915,80	1.047.489,10	1,14%	59.030,92	-3.120.381,75	59.031,00	-91.181.662,26
HARG11	10.315.875,50	264.504,59	241.370,37	0,26%	-35.081,21	1.636.753,61	-35.081,28	45.671.108,58
HOFCT11	330.698,55	33.105,63	18.180,22	0,02%	-20,01	249,02	-21,23	121.884.196,88
HVRD15	5.560.359,05	126.125,20	112.920,34	0,12%	20,23	-291,44</		

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2024



## Relatório de Risco de Mercado

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

Dados Gerais			
PL:	4.916.798.801,80	VAR / PL:	1,8648%
VAR:	91.689.400,50	ETL / PL:	2,3386%
ETL:	114.982.207,31	VAR / Cdi:	0,0204%
Limite Fundo:	0,00%	Dutação DC:	1.551,53
Status:	ENQUADRADO	Dutação DU:	1.066,63
Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	140.261.567,31	Cenário Baixa - 10000 (+):	183.201.645,72	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	270.732.858,12	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	1.248.257.656,74
Cenário Alta - 09999 (-):	-235.591.724,24	Cenário Baixa - 10000 (-):	-146.638.489,67	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	-4.610.989,24	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	-1.548.659.341,19
Cenário Alta - 09999:	-95.330.156,93	Cenário Baixa - 10000:	36.563.156,05	CENÁRIO BRADESCO 1:	266.121.868,87	CENÁRIO BRADESCO 2:	-300.401.684,45

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	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
HYPE3	185.138,98	16.890,61	12.089,22	0,01%	40,80	-693,61	42,40	-244.261.686,82
HZTC14	2.495.158,05	49.790,09	44.558,19	0,05%	-20,13	413,04	-20,73	119.628.022,62
IDIF25P419600	26,12	38,10	-9,23	0,00%	-11,99	305,34	-12,25	70.812.930,05
IDIF25P419700	-26,12	39,24	9,50	0,00%	-9,28	303,62	-9,42	54.546.760,64
IDIF25P421800	-3.213,56	5.358,54	1.297,74	0,00%	-28,53	1.772,98	-28,68	166.638.977,20
IDIF25P421900	8.243,48	11.572,13	-2.802,56	0,00%	28,78	-2.721,61	28,85	-167.911.742,19
IDIF25P422000	17.811,20	18.859,07	-4.518,89	0,00%	36,34	-5.749,89	36,37	-212.098.696,92
IDIF25P422300	-60.333,60	53.677,86	12.999,80	0,01%	-53,63	16.134,10	-53,64	313.253.463,58
IDIF25P422400	48.244,80	35.956,45	-8.708,00	-0,01%	17,10	-11.616,90	17,10	-100.031.616,62
IDJ25P432500	24.165,23	26.702,71	-743,71	0,00%	-11,34	21.563,43	-11,34	66.448.787,04
IDJ25P432600	-59.031,00	63.286,51	1.762,62	0,00%	9,13	-56.768,00	9,13	-53.589.088,76
IDJ25P432700	35.081,28	36.745,43	-1.023,41	0,00%	2,30	-35.468,63	2,30	-13.522.711,79
IDIV24P410000	21,23	5,81	-2,29	0,00%	7,216,06	-21.340,25	7.221,15	-4.771.130,38
IDIV24P410100	-21,23	6,18	2,43	0,00%	-280.385,00	-42.150,65	94.732,91	-121.399,29
IDIV24P410200	-42,40	13,17	5,19	0,00%	83,94	-86,00	-295,20	449,39
IDIV24P410300	20,73	6,91	-2,72	0,00%	1.894.747,66	-1.894.747,66	1.388.850,04	-1.400.218,52
IDIV24P410400	12,25	4,41	-1,74	0,00%	601.132,91	-599.861,95	473.192,50	-475.425,27
IDIV24P410500	9,42	3,69	-1,45	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
IDIV24P410700	28,68	13,63	-5,37	0,00%	289.826,00	-202.878,20	84.976,98	-85.672,57
IDIV24P410800	-28,85	15,40	6,07	0,00%	-447.009,78	-63.379,61	151.983,67	-194.510,59
IDIV24P410900	-36,37	22,19	8,74	0,00%	-532.916,62	-69.886,42	143.876,58	-192.351,47
IDIV24P411000	53,64	38,27	-15,08	0,00%	134.687,50	-113.966,78	30.377,21	-30.625,87
IDIV24P411100	-17,10	14,76	5,82	0,00%	-568.476,89	-35.394,46	245.699,97	-299.062,83
IDIV24P411200	11,34	12,47	-4,92	0,00%	-1.179.552,46	-113.350,34	453.607,18	-571.181,17
IDIV24P411300	-9,13	14,04	5,53	0,00%	1.867.383,87	-1.867.383,87	1.440.834,08	-1.452.628,08
IDIV24P411400	-2,30	6,11	2,41	0,00%	3.064.780,30	-2.911.541,29	2.246.483,96	-2.264.872,64
IDIV24P411600	-7.221,15	1.967,59	775,45	0,00%	-457.511,46	-53.131,21	171.227,44	-216.661,87
IGTA37	2.152.302,02	9,25	3,41	0,00%	1.281.472,50	-1.281.472,50	536.753,91	-541.147,53
IGTH11	9.473.738,30	881.240,92	703.635,12	0,77%	-370.931,82	-63.706,39	119.499,45	-154.543,69
INDV24	10.776,00	251.063,89	197.400,04	0,22%	25.882,14	-25.882,14	14.593,63	-14.713,09
INSSSN1	468.749,65	60.570,77	-47.971,84	-0,05%	50.515,20	-40.412,16	29.622,12	-29.864,59
INTB3	579.652,00	48.618,24	-2.392,65	0,00%	-2.496,32	2.015,52	3.530,95	-5.084,66
IPIL11	4.519.936,94	74.613,35	65.475,44	0,07%	-2.148.656,23	-366.139,14	695.998,81	-899.606,49
IRBR12	11.606.595,52	142.348,63	14.836,51	0,02%	-466.925,90	-114.957,94	124.075,45	-163.341,36
IRBR3	207.211,54	121.967,99	83.472,24	0,08%	0,00	0,00	0,00	0,00
IRJS14	3.354.752,78	130.988,21	124.361,22	0,14%	0,00	0,00	0,00	0,00
ITPO14	8.859.899,88	249.913,39	229.232,75	0,25%	0,00	0,00	0,00	0,00
ITSA4	9.828.336,16	677.184,09	486.887,14	0,53%	0,00	0,00	0,00	0,00
ITUB4	15.323.901,50	1.087.306,98	806.758,19	0,88%	0,00	0,00	0,00	0,00
JALL15	3.343.540,14	105.498,60	95.984,07	0,10%	0,00	0,00	0,00	0,00
JBSS3	3.661.350,00	401.970,40	60.796,98	0,07%	0,00	0,00	0,00	0,00
JSMILB5	3.383.798,94	57.114,15	51.962,21	0,06%	0,00	0,00	0,00	0,00
JSRE11	99.547,30	5.595,19	1.447,06	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
KLBN11	202.060,81	13.154,62	8.853,01	0,01%	0,00	0,00	0,00	0,00
LCAMC3	3.050.110,27	504,73	411,53	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LCAMD1	19.141.270,80	336.810,24	307.908,42	0,34%	-343.365,50	279.271,36	463.235,02	-647.886,59
LF00100FAU	4.753.527,75	76.468,70	-197,67	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002100HDP	1.656.657,69	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002100HDQ	3.016.905,41	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002200USM	10.867.899,74	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002200USN	11.394.333,72	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306J15	11.299.155,99	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306U55	6.789.504,32	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306Z8P	5.592.443,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306ZK1	5.610.177,42	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024000XE	10.867.655,80	0,00	0,00	0,00%	539,51	-527,12	-1.209,46	1.843,73
LF0024000XG	10.848.150,32	0,00	0,00	0,00%	817,12	-798,36	-1.831,80	2.792,44
LF0024000XN	10.824.334,21	0,00	0,00	0,00%	601,10	-577,31	-1.303,81	1.987,80
LF0024000ZC7	6.847.330,45	93.261,25	83.313,56	0,09%	-6.143,49	4.933,21	8.551,44	-12.256,48
LF0024000ZSX	4.654.799,91	0,00	0,00	0,00%	-201.815,83	-13.467,90	42.964,94	-58.145,91
LF0024000ZTZ	16.810.776,48	0,00	0,00	0,00%	-121.244,65	9.452,34	35.340,92	-47.571,94
LF002400033U	6.923.907,21	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF00240003CF	11.391.090,68	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF00240006I2	11.436.148,49	0,00	0,00	0,00%	-10,74	11,66	0,64	-0,97
LF00240007F1	6.975.868,34	0,00	0,00	0,00%	-2.510,47	2.802,40	-133,98	203,99
LF00240009LF	6.864.939,81	0,00	0,00	0,00%	-88.156,39	126.635,69	-2.089,94	3.182,13
LF0024000D4A	3.453.322,60	0,00	0,00	0,00%	-48.794,64	87.853,96	167,55	-255,08
LFSC1900089	3.905.010,61	0,00	0,00	0,00%	-48.949,74	92.680,91	330,32	-502,88
LFSC190054B	972.132,10	0,00	0,00	0,00%	-33.308,84	91.098,94	2.755,51	-4.193,12
LFSC190059S	1.472.356,01	0,00	0,00	0,00%	-670,60	2.227,98	90,83	-138,18
LFSC19005L1	974.048,40	0,00	0,00	0,00%	-26.652,40	118.803,92	7.405,77	-11.250,98
LFSC22002DX	5.038.615,04	1.327,16	1.106,13	0,00%	-10.478,92	34.021,26	2.242,99	-3.405,24
LFSC210029N	4.753.335,97	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFSC2301ERT	4.618.570,33	0,00	0,00	0,00%	-1.310,32	1.070,56	1.790,12	-2.498,26
LFT20250091 - 210100	1.283.055,61	1,13	-0,18	0,00%	-1.096,71	896,74	1.666,61	-2.452,08
LFT20250301 - 210100	2.169.502,66	397,81	249,72	0,00%	-736.307,09	-105.782,14	249.090,13	-321.830,92
LFT20250901 - 210100	32.665.049,78	7.005,27	3.710,24	0,00%	328.987,01	-328.987,01	241.147,48	-243.121,40
LFT20260301 - 210100	13.227.063,27	1.678,09	-20,14	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20260901 - 210100	10.064.605,41	1.640,68	144,55	0,00%	-1.007.519,68	781.916,42	1.349.298,21	-1.922.500,20
LFT20270301 - 210100	7.107.143,57	1.848,28	815,30	0,00%	189.546,23	-189.546,23	69.472,51	-70.041,18
LFT20270901 - 210100	137.115,21	56,68	30,28	0,00%	1.533.257,51	-1.533.257,51	864.521,35	-871.597,93
LFT20290301 - 210100	4.370.044,81	1.388,84	193,11	0,00%	-7.931,69	6.639,65	11.095,65	-11.095,93
LFT20300301 - 210100	999.323,29	718,54	-36,76	0,00%	211.928,41	-211.928,41	103.562,35	-104.410,86
LIGHB4	4.220.695,39	0,00	0,00	0,00%	1.216.126,00	-1.216.126,00	356.568,14	-359.486,85
LIGHD3	1.016.251,82	334,92	298,90	0,00%	434.688,38	-376.172,64	122.548,69	-123.551,81
LMTP17	2.675.360,18	158,82	92,61	0,00%	-3.554,86	2.935,35	4.927,08	-6.820,05



# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2024



Data: 30/08/2024

## Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS  
 CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais		Limite Fundo:		ENQUADRADO		0,00% Dutation DC:		1.551,53	
PL:	4.916.798.801,80	VAR / PL:	1,8648%	Status:	ENQUADRADO	Dutation DC:			1.551,53
VAR:	91.689.400,50	ETL / PL:	2,3386%	Benchmark:		Dutation DU:			1.066,63
ETL:	114.982.207,31	VAR / Cdi:	0,0204%						

### Cenários de STRESS

Cenário Alta - 09999 (+):	140.261.567,31	Cenário Baixa - 10000 (+):	183.201.645,72	CENARIO BRADESCO 1 (+):	270.732.858,12	CENARIO BRADESCO 2 (+):	1.248.257.656,74
Cenário Alta - 09999 (-):	-235.591.724,24	Cenário Baixa - 10000 (-):	-146.638.489,67	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-4.610.989,24	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-1.548.659.341,19
Cenário Alta - 09999:	-95.330.156,93	Cenário Baixa - 10000:	36.563.156,05	CENARIO BRADESCO 1:	266.121.868,87	CENARIO BRADESCO 2:	-300.401.684,45

### Parâmetros do Cálculo

Modelo:	Var paramétrico	Modelo Volatilidade:	EWM
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
LORTA7	6.608.933,79	120.248,45	110.290,25	0,12%	-987.472,01	-169.304,79	318.504,34	-411.859,46
LREN3	1.644.935,04	520.650,35	445.061,43	0,49%	798.266,56	-598.699,92	292.564,69	-294.959,49
LREN1	672.250,54	0,00	0,00	0,00%	33.644,13	-33.645,63	16.440,77	-16.575,34
LTN20260701 - 100000	24.997.022,38	240.143,13	202.941,34	0,22%	-1.012.319,09	-192.334,66	303.219,43	-394.889,80
LWSA3	473.891,60	72.240,85	61.461,44	0,07%	1.669.425,53	-1.391.187,94	815.792,61	-822.470,31
MALL11	5.897.144,26	225.592,04	-10.757,72	-0,01%	-717.635,99	-191.356,66	182.121,71	-239.786,92
MAINT2	2.588.436,02	2.060,52	1.886,99	0,00%	3.530.509,84	-3.530.509,84	1.035.145,49	-1.043.616,71
MATD3	706.428,04	70.590,68	44.718,76	0,05%	1.850.337,30	-1.850.337,30	271.259,45	-273.479,85
MAXR11	2.432.252,00	97.957,25	-36.966,44	-0,04%	1.025.193,00	-1.025.193,00	601.173,18	-606.094,10
MGLU3	835.939,20	214.519,53	141.882,55	0,15%	-231.958,54	-49.252,84	63.662,22	-83.690,70
MOVI27	1.197.199,99	893,68	808,57	0,00%	-134.340,52	128.884,94	80.244,35	-108.100,80
MOV13	8.961.871,58	152.640,09	139.026,41	0,15%	-825.510,26	869.244,99	721.588,86	-957.911,79
MRF3	1.995.666,40	476.404,20	207.658,42	0,23%	-897.001,26	784.080,04	784.080,04	-1.040.869,05
MV3	112.147,11	15.796,13	10.214,94	0,01%	-525.932,82	529.098,50	458.371,92	-604.061,48
MTRJ19	11.423.809,26	128.453,98	98.621,53	0,11%	-1.173.273,48	1.188.506,10	1.070.195,62	-1.392.503,34
MULT3	5.564.751,76	480.871,22	423.642,55	0,46%	-34.621,29	31.119,36	30.169,68	-38.994,50
NEWL11	7.061.019,68	310.547,85	-145.545,00	-0,16%	-1.422.542,58	1.265.033,49	1.245.193,57	-1.592.181,77
NEWU11	1.850.337,30	203.034,08	30.203,71	0,03%	-18.590.479,82	17.727.481,31	17.849.767,78	-21.889.906,98
NTCO3	4.100.772,00	344.933,25	-94.200,35	-0,10%	-3.187.674,36	2.622.237,49	2.918.569,07	-3.444.462,30
NTEN11	3.179.781,66	27.253,23	13.431,14	0,01%	-26.105.314,75	24.583.149,65	26.136.337,77	-29.770.824,64
NTNB20250515 - 760199. NEGOCIACAO	13.058.772,14	20.998,53	-5.072,83	-0,01%	-784.352,46	1.765.680,18	871.253,85	-899.361,96
NTNB20260815 - 760199. NEGOCIACAO	39.341.829,25	192.917,96	126.883,08	0,14%	-89.326.111,02	87.197.338,15	92.857.848,17	-102.480.929,49
NTNB20270515 - 760199. NEGOCIACAO	19.198.397,63	146.814,01	120.959,15	0,13%	-30.074.937,91	28.807.936,05	31.427.605,37	-33.884.378,56
NTNB20280815 - 760199. NEGOCIACAO	31.318.800,64	345.061,87	305.933,40	0,33%	-17.493,71	15.249,71	25.124,89	-31.786,13
NTNB20290515 - 760199. NEGOCIACAO	779.698,93	9.643,19	8.929,26	0,01%	-6.682,78	5.497,39	9.274,47	-12.918,42
NTNB20250815 - 760199. NEGOCIACAO	6.156.168,84	229.048,89	221.315,01	0,24%	-453.036,65	-39.692,33	120.860,21	-161.894,70
NTSD36	2.816.499,20	4.880,12	4.590,51	0,01%	306.552,33	-306.552,33	89.881,14	-90.616,87
OMGE13	4.191.274,37	1.636,98	1.469,16	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
OULG11	613.104,66	21.244,80	16.417,51	0,02%	-452,95	374,04	703,87	-1.036,64
OUTRAS DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-2.126,39	1.758,27	2.951,96	-4.083,31
OVSA10	1.792.864,63	64,11	37,16	0,00%	-235.001,47	-47.698,94	65.144,84	-85.638,54
OVSA8	682.050,79	542,55	492,39	0,00%	2.151.254,00	-2.151.254,00	630.747,67	-635.910,68
PAN12	3.253.125,25	28.502,20	14.017,70	0,02%	19.553,31	-19.555,04	7.916,97	-7.983,79
PATY11	4.302.508,00	168.219,33	44.220,17	0,05%	-540.334,15	-107.099,87	164.943,71	-213.737,28
PCAR3	54.017,54	9.709,82	5.366,13	0,01%	1.930.314,03	-2.316.394,81	1.131.936,14	-1.141.201,65
PEJA11	4.988.524,63	74.084,34	62.215,28	0,07%	4.503.327,61	-5.403.993,13	2.640.751,31	-2.662.367,28
PETR3	7.721.256,10	839.959,01	377.910,68	0,41%	30.464,81	-40.886,99	11.753,00	-11.849,21
PETR4	18.013.310,43	1.932.721,20	966.307,94	1,05%	9.804.737,57	-6.104.836,60	2.712.027,41	-2.734.226,82
PETZ3	80.170,56	35.377,40	23.088,42	0,03%	2.661.952,28	-2.661.963,52	780.487,70	-786.876,42
PRIO3	18.499.504,84	1.866.986,79	1.100.593,51	1,20%	-108.633,09	-1.225,88	30.217,71	-40.572,30
QAGR11	5.323.927,04	91.477,28	37.234,87	0,04%	637.980,93	-637.980,93	467.640,02	-471.467,91
QUAT12	3.438.356,70	35.471,27	15.313,20	0,02%	-1.626.059,37	-132.498,72	551.161,46	-808.725,08
RADL3	3.189.904,64	364.943,28	240.395,33	0,26%	8.439.195,42	-6.188.743,31	2.749.302,33	-2.771.806,85
RAHD11	12.782.753,43	345.546,78	321.522,66	0,35%	29.354,81	-29.354,81	12.295,47	-12.396,12
RAIL3	18.753.767,60	1.485.238,43	550.009,23	0,60%	0,00	0,00	0,00	0,00
RAIZ2	83.870,88	8.412,35	5.869,69	0,01%	1.053.038,14	-1.053.038,14	308.750,78	-311.278,07
RAMPMZ	504.884,84	2.727,27	133,28	0,00%	133,28	0,00	0,00	0,00
RBRP11	2.106.076,98	132.823,32	93.993,97	0,10%	1.314,03	1.071,04	1.948,40	-2.843,06
RCRB11	5.388.739,98	222.697,51	73.060,70	0,08%	1.022.366,67	-1.022.366,67	499.596,51	-503.685,98
RDCO10	3.755.336,01	215,75	154,98	0,00%	-4.430,56	3.751,80	6.204,89	-8.253,12
RDR3	3.407.888,90	545.315,85	414.654,18	0,45%	-6.335,70	5.365,07	8.872,99	-11.801,96
RDRB9	1.087.524,55	1.204,90	1.122,42	0,00%	-515.074,78	-53.648,38	192.279,73	-242.504,37
RDR0C9	1.555.160,11	1.723,01	1.605,06	0,00%	1.245.260,88	-1.245.260,88	304.258,74	-306.749,62
RDVE11	4.938.235,27	101.084,41	91.929,72	0,10%	3.699.350,49	-2.914.639,78	1.643.408,43	-1.656.886,62
RECV3	2.075.434,80	216.671,38	135.502,49	0,15%	0,00	0,00	10.352,69	-10.437,43
RENT3	11.210.153,01	1.282.246,92	607.455,23	0,66%	-341.086,62	-53.394,94	115.964,71	-148.475,05
RENT9	70.618,59	7.981,07	4.010,47	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
RIS412	2.787.669,08	62.053,33	56.435,81	0,06%	-1.958.941,43	-119.040,81	842.309,06	-1.028.582,90
RLOG11	483.283,04	0,00	0,00	0,00%	-16.896,04	14.174,28	23.602,66	-31.958,46
RMSA12	11.909.221,89	455.509,70	431.195,01	0,47%	241.199,53	-150.180,84	66.716,70	-67.262,81
RMOA11	2.868.819,95	11,81	1,90	0,00%	246,06	0,00	365,64	-541,03
RRRP3	455.093,46	61.546,28	49.712,61	0,05%	-576.267,40	-109.807,47	167.088,27	-218.601,08
RSAN24	1.800.943,76	31,16	10,90	0,00%	119.897,76	-119.897,76	87.885,06	-88.604,45
RSAN44	7.449.351,27	71.419,76	47.432,57	0,05%	374.580,63	-374.580,63	109.827,04	-110.726,03
SANB11	599.488,80	52.700,15	45.626,89	0,05%	445.452,78	-468.911,58	171.853,61	-173.260,32
SARE11	749.161,25	30.609,03	1.394,77	0,00%	1.545.117,35	-1.545.117,35	906.056,81	-913.473,38
SBF3	1.172.262,00	208.839,54	196.545,28	0,21%	-145.470,85	-23.775,22	25.628,17	-34.661,39
SBP3	6.180.469,39	796.411,25	673.854,66	0,73%	-2.803,36	2.277,85	3.949,91	-5.643,83
SBP3C7	2.378.700,53	600,39	508,23	0,00%	89.280,00	-89.280,00	21.814,08	-21.992,64
SCAR3	148.800,00	12.224,51	9.430,44	0,01%	43.803,86	-43.803,86	21.405,49	-21.580,70
SLCE3	146.012,88	12.194,46	-3.609,44	0,00%	2.220.876,00	-2.220.876,00	813.951,05	-820.613,68
SMFT3	5.552.190,00	654.510,53	435.292,54	0,47%	9.264,02	-9.264,14	4.527,02	-4.564,08
SMTO3	30.880,00	4.325,36	-3.073,66	0,00%	-96,86	82,53	164,59	-245,15
SNCO18	1.049.387,60	11,81	1,90	0,00%	0,00	0,00	94.585,58	-94.585,58
SRNA3	642.330,00	49.524,27	1.275,71	0,00%	145.299,70	-145.299,70	60.859,82	-61.357,99
STBP3	415.142,00	46.716,48	-10.049,20	-0,01%	3.609.320,00	-2.887.456,00	2.116.505,25	-2.133.829,98
SUZB3	14.437.280,00	1.599.320,90	659.405,89	0,72%	58.855,86	-58.855,86	34.513,08	-34.795,59
TAE11	235.423,45	17.348,85	13.188,65	0,01%	-26.158,15	-9.757,56	3.883,47	-5.264,67
TBSP11	2.478.056,95	478,58	410,91	0,00%	-2.218,99	1.810,00	3.132,70	-4.457,36
TCH11	9.748.954,51	283.630,00	266.276,32	0,29%	-1.340.550,80	-106.346,25	545.769,89	-673.258,59
TEPA12	2.700.006,01	32.020,83	23.312,41	0,03%	-264.117,35	-53.046,84	78.139,39	-101.858,90
TMS3	872.961,08	97.661,49	91.349,50	0,10%	279.347,55	-200.781,05	127.976,09	-129.023,65
TOTS3	1.287.631,08	168.980,19	54.751,40	0,06%	257.526,22	-257.526,22	188.766,72	-190.311,87
TRPL4	524.197,94	45.772,84	-6.016,58	-0,01%	104.839,59	-131.049,49	76.847,42	-77.476,46
TRXF11	8.292.900,72	244.884,18	124.269,38	0,14%	2.156.146,38	-2.156.162,00	1.215.739,25	-1.225.690,73

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2024

## Relatório de Risco de Mercado



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

Dados Gerais		Limite Fundo:		0,00%		Dutacion DC:		1.551,53	
PL:	4.916.798.801,80	VAR / PL:	1,8648%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:			1.066,63
VAR:	91.689.400,50	ETL / PL:	2,3386%	Benchmark:					
ETL:	114.982.207,31	VAR / Cdi:	0,0204%						

Cenários de STRESS										
Cenário Alta - 09999 (+):	140.261.567,31	Cenário Baixa - 10000 (+):	183.201.645,72	CENARIO BRADESCO 1 (+):	270.732.858,12	CENARIO BRADESCO 2 (+):	1.248.257.656,74			
Cenário Alta - 09999 (-):	-235.591.724,24	Cenário Baixa - 10000 (-):	-146.638.489,67	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-4.610.989,24	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-1.548.659.341,19			
Cenário Alta - 09999:	-95.330.156,93	Cenário Baixa - 10000:	36.563.156,05	CENARIO BRADESCO 1:	266.121.868,87	CENARIO BRADESCO 2:	-300.401.684,45			

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
UNEG11	9.722.729,64	347.187,04	323.270,76	0,35%	-1.431.633,20	-71.649,61	608.778,27	-752.885,01
USIMS	25.985,33	7.253,14	-2.916,89	0,00%	10.134,28	-5.716,77	3.809,45	-3.840,63
UTPS21	3.350.616,39	94.846,42	87.185,82	0,10%	-434.794,98	-41.944,77	167.130,07	-210.630,90
VALE3	16.201.887,30	919.833,50	-46.440,88	-0,05%	4.050.471,83	-4.050.471,83	2.375.196,68	-2.394.638,94
VAMO22	701.295,33	28,90	17,76	0,00%	-197,06	160,18	291,88	-428,07
VAMO3	187.210,80	36.265,62	-11.277,11	-0,01%	65.523,78	-74.884,32	27.445,10	-27.669,76
VAMO33	4.162.578,18	67.731,64	60.812,05	0,07%	-469.771,46	-86.698,30	147.264,11	-190.733,06
VAMO34	7.393.169,92	129.314,21	117.951,59	0,13%	-825.271,37	-140.918,47	267.014,64	-345.099,39
VBBR3	6.454.845,52	894.862,94	822.065,73	0,90%	1.613.711,38	946.280,35	946.280,35	-954.026,17
VCCS11	1.327.749,85	10.523,80	9.953,22	0,01%	-35.414,60	30.632,97	49.859,51	-64.369,49
VECS11	3.493.158,63	17,37	-2,58	0,00%	-127,54	113,82	235,98	-353,77
VERDECS2	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
VERO12	8.410.336,55	83.312,60	39.390,85	0,04%	-725.623,56	-163.878,54	199.718,90	-262.143,17
VIMT13	8.888.312,33	222.314,95	203.257,01	0,22%	-1.080.027,06	-114.134,40	405.240,07	-511.973,32
VIVA3	490.223,10	78.464,75	75.397,87	0,08%	147.066,93	-147.066,93	71.866,71	-72.454,97
VIVT3	2.397.137,50	201.379,28	174.193,96	0,19%	359.570,63	-359.575,25	351.420,36	-354.296,92
VIXL18	2.340.997,96	1.804,99	1.658,97	0,00%	-6.879,59	5.741,15	9.582,09	-13.068,74
VRDN12	6.840.839,79	135.801,27	120.819,07	0,13%	-771.454,84	-114.422,03	264.209,88	-337.775,50
VWIR11	3.995.550,00	147.606,77	-15.010,31	-0,02%	0,00	0,00	585.747,63	-590.542,29
VVRT11	2.570.099,72	234,56	191,91	0,00%	-1.214,81	988,58	1.742,99	-2.506,85
WDQU24	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
WDOV24	-8.261,94	117.631,02	89.098,46	0,10%	-220.117,93	223.745,04	-286.293,39	287.931,01
WEGE3	5.315.309,85	528.148,20	403.238,91	0,44%	1.328.827,46	-1.328.827,46	779.224,42	-785.602,80
WINV24	1.167,40	27.198,59	21.385,00	0,02%	65.122,73	-64.985,04	51.262,52	-51.504,40
XPIN11	2.846.795,70	121.119,38	70.550,54	0,08%	1.423.397,85	-1.423.397,85	417.340,25	-420.756,40
XPRR11	2.808.817,28	259.157,83	76.387,32	0,08%	1.154.408,64	-1.154.408,64	338.472,61	-341.243,19
YDUQ3	1.787.400,70	228.334,83	91.778,04	0,10%	697.086,27	-446.850,18	262.032,94	-264.177,82
<b>Total Var:</b>	<b>4.991.510.946,21</b>	<b>116.379.015,60</b>	<b>91.689.400,50</b>	<b>99,94%</b>	<b>-95.330.156,92</b>	<b>36.563.156,05</b>	<b>266.121.868,88</b>	<b>-300.401.684,45</b>

## Relatório de Risco de Mercado



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

Dados Gerais		Limite Fundo:		0,00%		Dutacion DC:		1.770,14	
PL:	4.207.782.497,56	VAR / PL:	1,5021%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:			1.217,04
VAR:	63.205.483,19	ETL / PL:	1,8837%	Benchmark:					
ETL:	79.262.226,96	VAR / Cdi:	0,0164%						

Cenários de STRESS										
Cenário Alta - 09999 (+):	0,00	Cenário Baixa - 10000 (+):	170.810.671,57	CENARIO BRADESCO 1 (+):	198.806.167,11	CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00			
Cenário Alta - 09999 (-):	-227.189.260,13	Cenário Baixa - 10000 (-):	-4.948.463,30	CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-225.575.522,49			
Cenário Alta - 09999:	-227.189.260,13	Cenário Baixa - 10000:	165.862.208,28	CENARIO BRADESCO 1:	198.806.167,11	CENARIO BRADESCO 2:	-225.575.522,49			

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
CAIXA	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
FI RF EMB II	3.368.366.074,72	55.061.662,58	54.912.645,45	86,88%	-174.689.813,50	163.677.359,50	175.391.906,10	-196.993.002,70
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	117.807.161,19	660.825,30	385.166,00	0,61%	-5.144.596,79	-611.832,28	1.508.952,41	-1.993.137,05
FIM EMB II A	240.612.255,32	476.319,28	385.860,04	0,61%	-1.937.231,80	2.004.550,18	1.596.662,91	-2.144.811,16
FIM EMB VI A CRED PRIV	247.335.681,19	2.442.182,43	2.197.079,61	3,48%	-12.030.202,60	5.128.761,89	8.437.020,53	-9.396.059,57
FIM EMB VII A CRED PRIV	326.268.055,24	5.928.351,11	5.324.732,09	8,42%	-33.387.415,44	-4.336.631,02	11.871.625,17	-15.048.511,99
<b>Total Var:</b>	<b>4.300.389.227,66</b>	<b>64.569.340,69</b>	<b>63.205.483,19</b>	<b>100,00%</b>	<b>-227.189.260,13</b>	<b>165.862.208,28</b>	<b>198.806.167,11</b>	<b>-225.575.522,49</b>

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2024

## Relatório de Risco de Mercado



Data: 30/08/2024

FUNDO: EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL  
CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais			
PL:	541.312.285,73	VAR / PL:	7,5198%
VAR:	40.705.398,10	ETL / PL:	9,4301%
ETL:	51.046.211,42	VAR / CDI:	0,0823%
Limite Fundo:		Status:	ENQUADRADO
Benchmark:		Dutacion DC:	0,00%
		Dutacion DU:	1,42

Cenários de STRESS			
Cenário Alta - 09999 (+):	124.078.753,57	Cenário Baixa - 10000 (-):	0,00
Cenário Alta - 09999 (-):	0,00	Cenário Baixa - 10000 (-):	-118.123.251,54
Cenário Alta - 09999:	124.078.753,57	Cenário Baixa - 10000:	-118.123.251,54

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

Produto	M/M	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	99.552.650,26	7.878.679,09	7.842.310,61	19,27%	25.435.616,03	-25.275.972,15	14.315.844,93	-14.433.060,16
FIA RVA EMB III	113.890.683,10	8.474.418,11	8.307.732,68	20,41%	28.870.121,12	-26.589.194,09	13.985.193,05	-14.103.897,21
FIA RVA EMB IV	109.450.350,44	7.931.022,31	7.741.264,61	19,02%	29.722.719,06	-26.064.196,72	14.809.337,52	-14.930.947,42
FIC FIA EMB VIII ETF	93.490.753,37	7.054.346,92	6.982.098,30	17,15%	8.386.077,27	-8.386.077,23	6.830.003,25	-6.885.914,35
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	124.929.163,55	9.904.503,68	9.831.991,89	24,15%	31.664.220,09	-31.807.811,36	18.067.281,23	-18.213.453,39
Total Var:	541.313.600,72	41.242.970,12	40.705.398,10	100,00%	124.078.753,57	-118.123.251,54	68.007.659,99	-68.567.272,54

## Relatório de Risco de Mercado



Data: 30/08/2024

FUNDO: FI RF EMB II  
CNPJ: 11005764000196

Dados Gerais			
PL:	3.316.709.777,27	VAR / PL:	1,6601%
VAR:	55.061.485,68	ETL / PL:	2,0819%
ETL:	69.049.324,42	VAR / CDI:	0,0182%
Limite Fundo:		Status:	ENQUADRADO
Benchmark:		Dutacion DC:	0,00%
		Dutacion DU:	1,941,56

Cenários de STRESS			
Cenário Alta - 09999 (+):	0,00	Cenário Baixa - 10000 (+):	164.557.052,29
Cenário Alta - 09999 (-):	-174.689.252,25	Cenário Baixa - 10000 (-):	-880.218,66
Cenário Alta - 09999:	-174.689.252,25	Cenário Baixa - 10000:	163.676.833,63

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

Produto	M/M	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
CSMGC3	5.539.511,33	22.297,67	13.558,46	0,02%	0,00	0,00	0,00	0,00
ELET42	14.948.527,26	159.893,14	43.283,99	0,08%	0,00	0,00	0,00	0,00
ENTV12	14.201.663,90	155.024,71	99.363,01	0,18%	0,00	0,00	0,00	0,00
GASP17	51.284.035,53	483.438,32	402.517,84	0,73%	-41.123,07	41.943,05	144.191,61	-219.471,74
IGSN15	2.615.908,12	48.469,29	40.940,35	0,07%	0,00	0,00	0,00	0,00
NEOE16	7.547.272,87	83.308,59	25.955,62	0,05%	-105.334,92	-8.710,01	22.797,56	-30.753,88
NTNB20260815 - 760199_VENCIMENTO	42.748.918,02	209.625,07	142.820,02	0,26%	0,00	0,00	0,00	0,00
NTNB20300815 - 760199_VENCIMENTO	26.340.067,28	404.912,45	394.015,90	0,72%	-1.354.370,02	-358.602,32	342.852,28	-451.756,72
NTNB20350515 - 760199_VENCIMENTO	238.703.237,31	5.860.388,83	5.823.573,68	10,58%	-1.312.547,90	-265.939,01	384.629,12	-502.355,60
NTNB20400815 - 760199_VENCIMENTO	29.393.006,39	923.312,02	922.040,51	1,67%	-1.191.437,39	1.367.409,57	96.106,63	-1.303.669,61
NTNB20450515 - 760199_VENCIMENTO	225.380.510,31	7.856.659,41	7.820.606,18	14,20%	-280.385,00	-42.150,65	94.732,91	-121.399,29
NTNB20500815 - 760199_VENCIMENTO	701.096.318,92	26.085.270,94	26.063.719,95	47,34%	-717.635,99	-191.356,66	182.121,71	-239.786,92
NTNB20550515 - 760199_VENCIMENTO	223.868.978,12	8.599.728,05	8.593.522,99	15,61%	-897.001,26	944.523,51	784.080,04	-1.040.869,05
SBSPC2	5.046.006,92	21.677,52	10.951,67	0,02%	-1.422.542,58	1.265.033,49	1.245.193,57	-1.592.181,77
BBTOPIMA	81.445.402,41	503.633,63	447.071,07	0,81%	-18.590.479,82	17.727.481,31	17.849.767,78	-21.889.906,98
BBTOPIND	262.996.339,31	4.285.703,82	4.220.388,32	7,66%	-3.187.674,36	2.622.237,49	2.918.569,07	-3.444.462,30
CAIXA	5.000,00	0,00	0,00	0,00%	-26.105.314,75	24.583.149,65	26.136.337,77	-29.770.824,64
COMPROMISSADA PRE	1.435.291.730,63	4.479,16	-2.843,89	-0,01%	-89.326.111,02	87.197.338,15	92.857.848,17	-102.480.929,49
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-97.181,99	0,00	0,00	0,00%	-30.074.937,91	28.807.936,05	31.427.605,37	-33.884.378,56
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-82.356,26	-13.460,00	14.509,03	-19.623,06
Total Var:	3.368.355.252,63	55.707.832,63	55.061.485,68	99,99%	-174.689.252,25	163.676.833,63	175.391.342,59	-196.992.369,79



# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2024



bradesco

Data: 30/08/2024

## Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FI RF EMB V CREDITO PRIVADO  
CNPJ: 20726178000121

Dados Gerais		Limite Fundo:	ENQUADRADO	0,00%	Dutacion DC:	657,38
PL:	114.947.532,31	VAR / PL:	0,5749%	Status:	Dutacion DU:	452,10
VAR:	660.825,30	ETL / PL:	0,7209%	Benchmark:		
ETL:	828.701,58	VAR / CDI:	0,0063%			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	0,00	Cenário Baixa - 10000 (+):	292.385,23	CENARIO BRADESCO 1 (+):	1.508.952,41	CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00
Cenário Alta - 09999 (-):	-5.144.596,79	Cenário Baixa - 10000 (-):	-904.217,51	CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-1.993.137,05
Cenário Alta - 09999:	-5.144.596,79	Cenário Baixa - 10000:	-611.832,28	CENARIO BRADESCO 1:	1.508.952,41	CENARIO BRADESCO 2:	-1.993.137,05

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

Produto	MtM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
17H0164854	6.569.955,74	54.996,52	42.280,70	6,40%	-278.404,74	-44.696,80	73.275,55	-97.725,00
AEGP23	7.461.400,14	42.634,06	31.746,47	4,90%	-182.445,92	-1.291,77	45.930,07	-61.880,32
CCRD1	3.277.587,87	10.383,83	3.616,45	0,55%	0,00	0,00	0,00	0,00
CMDT33	728.724,87	3.130,58	1.624,90	0,25%	-30.678,92	-10.025,70	4.934,88	-6.685,02
ENJG21	1.431.125,38	11.612,89	8.728,01	1,32%	-11.893,57	-1.943,84	2.095,34	-2.833,89
ENM21	933.350,50	7.926,00	5.821,61	0,88%	-20,16	20,56	70,68	-107,58
ENTV12	18.669.270,67	203.792,90	192.972,33	29,20%	0,00	0,00	0,00	0,00
ERDV17_VENCIMENTO	6.527.670,75	22.755,45	14.133,31	2,14%	0,00	0,00	0,00	0,00
ERDV36	2.248.095,50	7.122,26	2.480,52	0,38%	-58.587,26	-9.825,61	14.971,71	-19.987,75
GASP17	10.610.490,11	100.021,72	56.443,69	8,54%	-39.034,42	-6.528,21	10.005,36	-13.356,06
GRRB24_VENCIMENTO	16.377.933,35	192.979,21	157.163,48	23,78%	-1.725.453,59	-349.598,99	505.627,03	-660.388,29
LFSN16000GM	15.760.172,00	58.668,41	31.662,88	4,79%	-153.673,53	-7.515,27	34.743,40	-46.854,62
LFSN18000DC5	5.117.032,07	38.843,89	28.721,98	4,35%	-21.042,65	-6.876,62	3.384,83	-4.585,25
OMGE31	13.080.790,68	124.473,99	73.299,76	11,09%	-246.504,29	282.912,33	204.022,06	-269.724,79
SBSPC2	3.867.060,83	16.612,80	8.622,72	1,30%	-1.531.487,87	-392.681,69	395.702,83	-521.092,93
TAE33	4.462.380,20	7.277,70	1.506,90	0,23%	-201.815,83	-13.467,90	42.984,94	-58.145,91
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	-121.244,65	9.452,34	35.340,92	-47.571,94
COMPROMISSADA_PRE	703.521,80	2,20	-0,42	0,00%	-453.036,65	-39.692,33	120.860,21	-161.894,70
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-20.401,28	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-63.114,59	-10.315,22	11.119,15	-15.038,34
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-26.158,15	-9.757,56	3.883,47	-5.264,67
<b>Total Var:</b>	<b>117.807.161,18</b>	<b>903.434,09</b>	<b>660.825,30</b>	<b>100,00%</b>	<b>-5.144.596,79</b>	<b>-611.832,28</b>	<b>1.508.952,41</b>	<b>-1.993.137,05</b>

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2024



Data: 30/08/2024

## Relatório de Risco de Mercado

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

Dados Gerais		Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	1,014,33
PL:	250.293.431,53	VAR / PL:	1,0516%	Dutacion DU:	697,61
VAR:	2.632.043,89	ETL / PL:	1,3187%		
ETL:	3.300.639,22	VAR / CDI:	0,0115%	ENQUADRADO	
		Status:			
		Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	600.261,21	Cenário Baixa - 10000 (+):	7.666.820,01	CENARIO BRADESCO 1 (+):	9.720.867,37	CENARIO BRADESCO 2 (+):	192.978.735,87
Cenário Alta - 09999 (-):	-13.565.722,29	Cenário Baixa - 10000 (-):	-2.139.335,16	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-627.931,45	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-203.105.268,96
Cenário Alta - 09999:	-12.965.461,08	Cenário Baixa - 10000:	5.527.484,86	CENARIO BRADESCO 1:	9.092.935,92	CENARIO BRADESCO 2:	-10.126.533,09

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
020913	718.264,39	49.434,69	100,09	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
AEPA1	1.945.201,85	1.218,43	1.088,51	0,04%	-4.863,56	4.012,63	6.730,24	-9.321,24
APRB28	1.024.804,04	42,34	38,31	0,00%	-225,53	183,35	325,95	-471,28
ARTR1	2.666.100,78	138,69	124,36	0,00%	-793,03	640,43	1.139,68	-1.654,36
BARU11	1.600.674,50	68.112,91	62.472,35	2,37%	-290.692,80	-18.905,63	125.375,19	-152.883,65
BCBF15	2.036.646,24	20,58	8,77	0,00%	-163,80	140,28	284,57	-424,66
BKBR18	2.611.149,51	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
BRKPA0	2.907.372,25	614,89	554,08	0,02%	-3.041,17	2.455,43	4.301,62	-6.194,45
CAEC11	2.610.844,79	29,17	18,71	0,00%	-233,85	193,28	370,24	-549,03
CAIXA	10.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CART13	987.560,44	20.007,96	18.855,08	0,72%	-111.937,45	-15.671,16	38.897,66	-49.660,91
CBAN22	5.770.778,26	46.897,80	39.020,34	1,48%	-127.324,25	107.774,24	167.312,90	-219.274,63
CEAB13	1.508.592,36	322,41	290,80	0,01%	-1.508,41	1.220,48	2.114,64	-3.027,41
CELG12	1.562.585,18	25,91	12,20	0,00%	-199,80	166,67	323,25	-481,53
CGBP13	2.578.016,76	953,08	853,61	0,03%	-3.878,43	3.202,69	5.413,45	-7.520,98
CLH12	2.554.550,15	3.653,17	3.220,12	0,12%	-13.665,12	11.553,87	19.192,06	-25.640,31
COMPROMISSADA_PRE	36.792.964,20	114,82	-55,13	0,00%	-1.054,17	1.075,19	3.696,28	-5.626,05
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-80.945,72	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CRTR12	2.969.199,34	105.535,09	97.134,94	3,69%	-459.447,04	-30.329,65	193.414,97	-237.777,98
CSAN23	1.096.525,38	1.267,51	1.113,72	0,04%	-4.661,42	3.946,69	6.528,51	-8.886,01
CSMG88	2.835.519,42	28.814,21	22.079,04	0,84%	-250.796,72	-54.676,35	70.351,15	-92.245,21
DAPK25	21.998,32	35.343,28	5.585,18	0,21%	-216.386,42	196.253,75	146.299,53	-146.500,81
DAPK27	40.764,05	396.149,60	387.362,10	14,72%	-1.471.448,62	1.288.094,10	1.378.323,19	-1.349.615,82
DAPK29	-35.277,68	178.983,15	175.447,35	6,67%	-603.115,52	520.649,51	590.823,01	-566.041,45
DAPK35	7.275,14	38.291,94	-33.265,04	-1,26%	106.921,73	-96.966,15	-115.644,99	104.097,45
DAPQ26	69.441,27	245.899,60	221.256,86	8,41%	-1.087.218,73	957.017,66	1.003.479,92	-990.228,72
DAPQ28	-54.372,57	555.662,08	549.325,94	20,87%	-1.906.398,04	1.673.750,64	1.851.694,47	-1.788.272,57
DAPQ30	13.346,91	66.328,50	-63.021,19	-2,39%	207.063,04	-180.915,69	-205.904,78	194.853,07
DAPQ32	18.594,66	99.709,46	-90.319,03	-3,43%	280.998,14	-250.894,38	-292.112,22	270.552,97
DASAA2	1.327.789,80	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DASAC5	2.002.580,85	3.101,25	2.701,36	0,10%	-11.191,00	9.609,08	15.855,79	-20.642,70
DESK13	2.719.634,49	706,76	638,34	0,02%	-3.106,76	2.546,67	4.374,91	-6.174,22
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DHF27	-9.050,89	40.858,67	35.893,28	1,36%	-154.788,69	118.772,56	202.711,88	-283.637,67
DHF28	-26.278,42	94.557,76	82.149,53	3,12%	-327.060,58	262.693,68	437.615,16	-590.153,19
DHF29	-5.498,03	17.578,29	15.119,81	0,57%	-59.650,24	49.267,74	81.950,22	-106.553,26
DHN25	609,98	9.810,16	6.663,05	0,25%	-73.616,17	56.058,42	107.070,69	-158.299,25
DHN26	-14.031,96	84.707,48	74.957,32	2,85%	-357.568,77	271.960,20	474.014,15	-675.459,53
ELET24	2.769.341,94	850,35	762,85	0,03%	-3.557,93	2.908,92	4.926,27	-6.921,70
GUAR15	2.652.977,74	253,51	229,14	0,01%	-1.386,42	1.128,90	2.023,92	-2.932,68
HAPV22	584.219,18	275,00	245,21	0,01%	-1.084,83	895,63	1.505,96	-2.088,17
HZTC14	2.495.158,05	49.790,09	46.729,79	1,78%	-272.680,28	-35.676,48	96.049,97	-122.465,85
IDIF25P421800	-3.213,56	5.358,54	-328,24	-0,01%	3.213,56	-811.703,35	3.213,56	-53.698.849,90
IDIF25P421900	8.243,48	11.572,13	708,85	0,03%	-8.243,48	902.593,51	-8.243,48	53.788.804,68
IDIV24P410000	2,73	0,75	-0,11	0,00%	-2,57	32,02	-2,73	15.673.285,80
IDIV24P410100	-2,73	0,79	0,11	0,00%	2,60	-37,48	2,73	-15.700.256,17
IDIV24P410200	-21,29	6,61	0,95	0,00%	20,49	-348,28	21,29	-122.649.323,40
IDIV24P410300	13,36	4,45	-0,64	0,00%	-12,97	266,19	-13,36	77.097.461,76
IDIV24P410400	7,93	2,90	-0,41	0,00%	-7,76	197,66	-7,93	45.640.533,50
IG1A7	2.152.302,02	8,25	1,32	0,00%	83,94	-96,00	-295,20	449,39
INSSN11	468.749,65	60.570,77	-36.651,79	-1,39%	0,00	0,00	0,00	0,00
IRJ514	3.354.752,78	130.988,21	120.585,22	4,58%	-568.476,89	-35.394,46	245.699,97	-299.062,83
JSMIL85	3.383.798,94	57.114,15	54.605,82	2,07%	-370.931,82	-63.706,39	118.499,45	-154.543,69
LCAM01	7.732.967,94	136.069,48	129.753,50	4,93%	-868.045,28	-147.918,20	281.175,64	-363.436,07
LF001800FAU	4.753.527,75	76.468,70	26.167,52	0,99%	-466.725,90	-114.757,94	124.075,45	-163.344,36
LF002306Z8P	5.592.443,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306ZK1	5.610.177,42	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFSC190054B	972.132,10	0,00	0,00	0,00%	539,51	-527,12	-1.209,46	1.843,73
LFSC190059S	1.472.356,01	0,00	0,00	0,00%	817,12	-798,36	-1.831,80	2.792,44
LFSC19005L1	974.048,40	0,00	0,00	0,00%	601,10	-577,31	-1.303,81	1.987,80
LFSC22002X	5.038.615,04	1.327,16	1.190,12	0,05%	-6.143,49	4.933,21	8.551,44	-12.256,48
LFSN210029N	4.753.335,97	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFSN2301ERT	4.618.570,33	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20240901 - 210100	1.283.055,61	1,13	-0,13	0,00%	-10,74	11,66	0,64	-0,97
LFT20250901 - 210100	21.282.700,81	4.564,24	1.899,58	0,06%	-57.437,72	82.508,66	-1.361,69	2.073,30
LIGHB4	4.220.695,39	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LIGHD3	1.016.251,82	334,92	297,79	0,01%	-1.310,32	1.070,56	1.790,12	-2.498,26
LIMP17	2.675.360,18	158,82	131,30	0,00%	-1.096,71	896,74	1.666,61	-2.452,08
LREN81	672.250,54	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
MANT12	2.588.436,02	2.060,52	1.829,12	0,07%	-7.931,69	6.639,65	11.095,65	-15.071,93
MOVIZ7	1.197.199,99	893,68	797,96	0,03%	-3.554,86	2.935,35	4.927,08	-6.820,05
MTRJ19	2.738.195,71	30.789,39	28.504,49	1,08%	-242.644,79	-46.101,08	72.679,27	-94.651,93
NTEN11	3.179.871,66	27.253,23	20.320,46	0,77%	-231.958,54	-49.252,84	63.662,22	-83.690,70
NTNB20250515 - 760199_NEGOCIACAO	614.323,96	987,83	117,78	0,00%	-6.319,78	6.063,14	3.774,94	-5.985,39
NTNB20260815 - 760199_NEGOCIACAO	21.173.539,09	103.827,30	95.215,89	3,62%	-444.284,72	467.822,50	388.354,84	-515.542,44
NTNB20270515 - 760199_NEGOCIACAO	5.051.296,30	38.628,28	37.869,20	1,44%	-138.378,35	139.211,27	120.602,38	-158.934,80
NTNB20280815 - 760199_NEGOCIACAO	8.116.217,55	89.422,24	88.370,94	3,36%	-304.051,96	307.999,47	277.339,50	-360.865,04
NTNB20500815 - 760199_NEGOCIACAO	883.660,60	32.877,83	28.150,04	1,07%	-112.586,48	109.903,38	117.037,87	-129.166,79
NTSD36	2.816.499,20	4.880,12	4.216,05	0,16%	-17.493,71	15.249,71	25.124,89	-31.786,13
OMGE13	3.241.189,53	1.265,91	1.134,18	0,04%	-5.167,92	4.251,24	7.172,12	-9.990,05
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
OVSAT10	1.792.864,63	64,11	52,98	0,00%	-452,95	374,04	703,87	-1.036,64
OVSAA8	682.090,79	542,55	463,45	0,02%	-2.126,39	1.758,27	2.951,96	-4.083,31
RHDD11	3.548.843,22	95.933,27	89.200,11	3,39%	-451.438,71	-36.785,28	180.780,29	-224.524,28

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2024



bradesco

Data: 30/08/2024

## Relatório de Risco de Mercado

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

Dados Gerais									
PL:	250.293.431,53	VAR / PL:	1,0516%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	1,014,33		
VAR:	2.632.043,89	ETL / PL:	1,3187%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	697,61		
ETL:	3.300.689,22	VAR / Cdt:	0,0115%	Benchmark:					

Cenários de STRESS									
Cenário Alta - 09999 (+):	600.261,21	Cenário Baixa - 10000 (+):	7.666.820,01	CENARIO BRADESCO 1 (+):	9.720.867,37	CENARIO BRADESCO 2 (+):	192.978.735,87		
Cenário Alta - 09999 (-):	-13.565.722,29	Cenário Baixa - 10000 (-):	-2.139.335,16	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-627.931,45	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-203.105.268,96		
Cenário Alta - 09999:	-12.965.461,08	Cenário Baixa - 10000:	5.527.484,86	CENARIO BRADESCO 1:	9.092.935,92	CENARIO BRADESCO 2:	-10.126.533,09		

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
RBCAPMZ	504.884,84	7.127,27	-425,73	-0,02%	0,00	0,00	0,00	0,00
RDCO10	3.755.336,01	215,75	191,42	0,01%	-1.314,03	1.071,04	1.948,40	-2.843,06
RDORB9	1.087.524,55	1.204,90	1.058,63	0,04%	-4.430,56	3.751,80	6.204,89	-8.253,12
RDORC9	1.555.160,11	1.723,01	1.513,84	0,06%	-6.335,70	5.365,07	8.872,99	-11.801,96
RIS412	2.787.889,08	62.053,33	58.319,40	2,22%	-341.086,62	-53.394,94	115.984,71	-148.475,05
RLOG11	483.283,04	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
RODB11	2.868.819,96	4.484,89	3.967,73	0,15%	-16.896,04	14.174,28	23.602,66	-31.958,46
RSAN24	1.800.943,76	31,16	21,01	0,00%	-240,06	195,91	365,64	-541,03
SNGO18	1.049.387,60	11,81	6,05	0,00%	-96,86	82,53	164,59	-245,15
TBSP11	2.478.056,95	478,58	433,52	0,02%	-2.218,99	1.810,00	3.132,70	-4.457,36
UNEG11	4.656.375,69	166.273,60	151.414,88	5,75%	-685.632,77	-34.314,18	291.553,96	-360.569,06
VAMO33	2.861.690,04	46.564,16	44.867,98	1,70%	-322.271,09	-59.596,49	101.241,16	-131.125,20
VCCS11	1.327.749,85	10.523,80	9.042,51	0,34%	-35.414,60	30.632,97	49.859,51	-64.369,49
VECS11	3.493.158,63	17,37	3,25	0,00%	-127,54	113,82	235,98	-353,77
VERDECS2	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
VIXL18	2.340.997,96	1.804,99	1.600,90	0,06%	-6.879,59	5.741,15	9.582,09	-13.068,74
VVRT11	2.570.099,72	234,56	213,12	0,01%	-1.214,81	988,58	1.742,99	-2.506,85
<b>Total Var:</b>	<b>266.564.184,63</b>	<b>3.462.788,05</b>	<b>2.632.043,89</b>	<b>99,97%</b>	<b>-12.965.461,08</b>	<b>5.527.484,86</b>	<b>9.092.935,92</b>	<b>-10.126.533,09</b>

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2024



Data: 30/08/2024

## Relatório de Risco de Mercado

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

Dados Gerais		Limite Fundo:		0,00%		Dutacion DC:		1,770,12	
PL:	299.507.873,75	VAR / PL:	2,1051%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:			1,217,21
VAR:	6.304.884,97	ETL / PL:	2,6399%	Benchmark:					
ETL:	7.906.580,11	VAR / CDI:	0,023%						

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	0,00	Cenário Baixa - 10000 (+):	753,78	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	12.625.640,71	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	0,00
Cenário Alta - 09999 (-):	-35.507.986,94	Cenário Baixa - 10000 (-):	-4.612.821,99	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	-16.004.304,63
Cenário Alta - 09999:	-35.507.986,94	Cenário Baixa - 10000:	-4.612.068,21	CENÁRIO BRADESCO 1:	12.625.640,71	CENÁRIO BRADESCO 2:	-16.004.304,63

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
ANEM11	10.681.443,90	297.114,62	294.643,98	4,67%	-1.353.145,73	-106.869,65	544.910,90	-679.231,67
ANET11	1.951.168,53	15.941,77	6.826,21	0,11%	-110.490,92	-23.954,94	28.607,76	-37.879,14
APPSA2	3.461.385,94	51.182,04	49.981,88	0,79%	-371.651,51	-68.619,14	116.180,00	-150.644,90
ASAB11	4.448.677,96	66.801,41	66.071,62	1,05%	-449.919,68	-86.561,65	139.291,46	-179.799,91
ASER12	2.851.756,16	114.371,04	111.712,49	1,77%	-490.169,64	-28.131,68	214.575,95	-260.314,50
BARU11	2.497.052,21	106.256,15	103.474,91	1,64%	-453.480,76	-29.492,78	195.585,29	-238.498,49
BRKP28	10.833.209,41	327.100,13	321.956,07	5,11%	-1.486.642,32	-209.560,30	533.701,56	-677.564,39
CAEC21	9.312.744,76	102.748,04	34.547,11	0,55%	-739.877,91	-178.056,46	192.783,84	-254.627,28
CAIXA	999,93	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CART13	6.464.031,98	130.961,20	130.890,47	2,08%	-732.681,46	-102.574,87	254.602,83	-325.053,23
CBAN32	16.335.689,64	333.636,85	332.856,29	5,28%	-1.942.681,86	-304.244,24	656.823,19	-841.379,05
CBAN72	3.561.157,00	78.524,72	78.317,59	1,24%	-436.221,61	-65.527,95	150.011,10	-191.795,23
CGOS16	3.165.616,38	115.921,43	113.455,32	1,80%	-446.733,52	-17.848,77	189.999,54	-237.148,78
CHSF13	3.226.972,19	69.896,51	69.445,76	1,10%	-387.956,01	-57.628,76	132.247,05	-170.086,52
CJEN13	7.086.803,21	143.691,86	143.575,86	2,28%	-783.415,58	-100.946,48	277.372,63	-353.290,15
CLCD27	2.625.102,74	81.650,67	80.352,87	1,27%	-360.751,47	-44.776,20	133.127,91	-168.629,03
CNRD11	10.210.993,01	254.980,11	253.833,00	4,03%	-1.247.402,47	-138.357,65	462.948,33	-586.360,27
COMPROMISSADA_PRE	25.794.409,47	80,50	-42,69	0,00%	-739,05	753,78	2.591,35	-3.944,25
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-155.874,90	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CRMG15	7.546.570,62	78.676,84	70.589,91	1,12%	-619.795,28	-106.995,21	187.817,01	-245.109,60
CSMG89	3.376.565,94	63.389,70	63.167,15	1,00%	-386.666,10	-63.831,52	128.025,48	-164.375,75
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ELET14	3.284.246,83	58.134,51	57.495,42	0,91%	-369.921,94	-62.965,80	119.916,45	-154.987,27
ENEVA0	2.146.813,41	66.758,90	65.654,15	1,04%	-292.020,34	-34.823,10	108.672,76	-137.600,73
ERDV17	4.863.114,71	16.952,81	4.774,17	0,08%	-114.486,78	-5.998,88	25.883,83	-34.906,69
ERDV38	5.951.424,96	44.588,59	44.630,95	0,23%	-183.926,54	-16.616,34	46.805,59	-62.772,97
GASC16	2.595.040,02	96.518,77	94.178,22	1,49%	-360.297,78	-15.917,15	151.589,41	-189.933,20
GBSP11	4.663.146,09	167.248,28	163.546,03	2,59%	-749.179,67	-52.622,95	322.935,61	-390.987,53
GRRB24	9.429.315,05	111.104,48	88.220,53	0,76%	-881.727,95	-226.079,77	227.819,14	-300.010,34
HARG11	10.315.875,50	264.504,59	262.704,08	4,17%	-1.214.972,85	-97.531,84	476.352,93	-598.681,95
HVRD15	5.560.359,05	126.125,20	125.954,37	2,00%	-698.058,83	-94.045,57	247.984,58	-315.577,52
IPIL11	4.519.932,94	74.613,35	74.369,52	1,18%	-447.009,78	-63.379,61	151.983,67	-194.510,59
IRBR12	11.606.566,52	142.348,63	44.162,57	0,70%	-532.619,62	-69.886,42	143.876,58	-192.161,47
ITPO14	8.859.899,88	249.913,39	248.035,50	3,93%	-1.179.552,46	-113.350,34	453.607,18	-571.181,17
JALL15	3.343.540,14	105.498,60	103.696,75	1,64%	-457.511,46	-53.131,21	171.227,44	-216.661,87
LCAMD1	11.408.302,86	200.740,76	198.565,66	3,15%	-1.280.610,95	-218.220,95	414.813,16	-536.170,43
LORTA7	6.608.933,79	120.248,45	118.839,28	1,88%	-736.307,09	-105.782,14	349.090,13	-321.830,92
MOV137	8.961.871,58	152.640,09	151.093,82	2,40%	-987.472,01	-169.304,79	318.504,34	-411.859,46
MTRJ19	8.685.613,55	97.664,69	90.979,01	1,44%	-769.674,30	-146.233,58	230.540,16	-300.237,88
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PASN12	3.253.125,25	28.502,20	20.213,79	0,32%	-235.001,47	-47.698,94	65.144,84	-85.638,54
PEJA11	4.988.524,63	74.084,34	71.874,51	1,14%	-540.334,15	-107.099,87	164.943,71	-213.737,28
QUAT12	3.438.356,70	35.471,27	20.341,90	0,32%	-108.633,09	-1.225,88	30.217,71	-40.572,30
RAHD11	9.233.910,20	249.613,51	247.781,26	3,93%	-1.174.620,65	-95.713,44	470.381,16	-584.200,80
RDVE11	4.938.235,27	101.084,41	100.901,76	1,60%	-515.074,78	-53.648,38	192.279,73	-242.504,37
RMSA12	11.909.221,89	455.509,70	446.222,75	7,08%	-1.958.941,43	-119.040,81	842.309,06	-1.028.582,90
RSAN44	7.449.351,27	71.419,76	60.670,49	0,96%	-576.267,40	-109.807,47	167.088,27	-218.601,08
TCM11	9.748.954,51	283.632,00	280.954,15	4,46%	-1.340.550,80	-106.346,25	545.769,89	-673.258,59
TEPA12	2.700.006,01	32.020,83	28.509,24	0,45%	-264.117,35	-53.046,84	78.139,39	-101.858,90
UNEG11	5.066.353,96	180.913,44	177.755,28	2,82%	-746.000,43	-37.335,43	317.224,31	-392.315,95
UTPS21	3.350.616,39	94.846,42	93.823,80	1,49%	-434.794,98	-41.944,77	167.130,07	-210.630,90
VAMOS33	1.300.888,14	21.167,48	20.854,77	0,33%	-146.500,37	-27.091,81	46.022,95	-59.607,86
VAMOS34	7.393.169,92	129.314,21	128.160,41	2,03%	-825.271,37	-140.918,47	267.014,64	-345.099,39
VERO12	6.410.336,55	63.312,60	57.507,35	0,91%	-725.623,56	-163.870,54	199.718,90	-262.143,17
VIMT13	6.888.312,33	222.314,95	221.084,62	3,51%	-1.080.027,06	-114.134,40	405.240,07	-511.973,32
VRDNI2	6.940.839,79	135.801,27	135.673,09	2,15%	-771.454,84	-114.422,03	264.209,88	-337.775,50
<b>Total Var:</b>	<b>346.990.675,77</b>	<b>6.727.537,93</b>	<b>6.304.884,97</b>	<b>99,98%</b>	<b>-35.507.986,94</b>	<b>-4.612.068,22</b>	<b>12.625.640,71</b>	<b>-16.004.304,62</b>

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2024



## Relatório de Risco de Mercado

Data: 30/08/2024

FUNDO: FIRM II A CRED PRIV  
CNPJ: 20725957000102

Dados Gerais			
PL: 226.323.882,70	VAR / PL: 0,1988%	Limite Fundo: 0,00%	Dutacion DC: 689,22
VAR: 449.825,05	ETL / PL: 0,2492%	Status: ENQUADRADO	Dutacion DU: 474,68
ETL: 564.036,77	VAR / CDI: 0,0022%	Benchmark:	

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	828.922,20	Cenário Baixa - 10000 (+):	2.567.950,03	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	2.645.671,44	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	15.331.261,44
Cenário Alta - 09999 (-):	-2.658.399,70	Cenário Baixa - 10000 (-):	-674.898,58	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	-1.137.819,43	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	-17.356.772,16
Cenário Alta - 09999:	-1.829.477,50	Cenário Baixa - 10000:	1.893.051,44	CENÁRIO BRADESCO 1:	1.507.852,01	CENÁRIO BRADESCO 2:	-2.025.510,72

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
CAIXA	9.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CDB323R5TI	6.803.046,80	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	4.735.793,42	14,78	-5,26	0,00%	-135,69	138,39	475,77	-724,15
CONTAS_A PAGAR_RECEBER	-36.257,52	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
DHF26	-3.731,05	53.905,04	44.626,51	9,92%	-285.590,79	210.919,19	383.285,40	-555.984,05
DHF27	21.436,32	96.770,54	-73.898,43	-16,43%	366.557,42	-281.303,43	-480.107,09	671.773,43
DHF29	23.091,73	73.828,84	-53.023,70	-11,79%	250.531,02	-206.924,50	-344.190,90	447.523,69
DHF33	19.517,55	52.150,13	-35.003,83	-7,78%	183.806,13	-164.527,49	-276.434,85	311.157,94
DHN27	2.001,53	7.878,25	-5.886,18	-1,31%	28.025,32	-22.103,91	-37.044,56	50.902,62
DHV25	21,74	3.846,24	3.189,82	0,71%	-24.256,87	18.358,16	33.369,54	-48.858,36
IDIV24P410200	-2,40	0,75	0,01	0,00%	2,31	-39,26	2,40	-13.826.133,22
IDIV24P410300	2,40	0,80	-0,01	0,00%	-2,33	47,82	-2,40	13.849.843,43
LF002200U5M	10.867.899,74	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002200U5N	11.394.333,72	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306J15	11.299.155,99	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306J55	6.789.504,32	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024000XE	10.867.655,80	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024000XG	10.848.150,32	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024000XN	10.824.334,21	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024002C7	6.647.330,45	93.261,25	71.226,29	15,83%	-343.365,50	279.271,36	463.235,02	-647.886,59
LF0024002SX	4.654.799,91	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024002TZ	10.810.776,48	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF00240033U	6.923.907,21	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024003QF	11.391.090,68	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024006I2	11.436.148,49	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024007F1	6.975.868,34	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024009LF	6.864.939,81	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002400D4A	3.453.322,60	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20250301 - 210100	641.683,89	117,66	37,59	0,01%	-742,53	828,88	-39,63	60,34
LFT20260301 - 210100	274.927,41	34,88	0,08	0,00%	-1.014,21	1.826,06	3,48	-5,30
LFT20260901 - 210100	946.897,63	154,36	16,45	0,00%	-4.605,29	8.719,60	31,08	-47,31
LFT20270301 - 210100	411.787,29	107,09	30,75	0,01%	-1.929,91	5.278,27	159,65	-242,95
LFT20270901 - 210100	137.115,21	56,68	18,55	0,00%	-670,60	2.227,98	90,83	-138,18
LFT20300301 - 210100	989.323,29	718,54	73,38	0,02%	-10.478,92	34.021,26	2.242,99	-3.405,24
NTNB20250515 - 760199_NEGOCIACAO	12.444.448,18	20.010,70	6.117,47	1,36%	-128.020,74	122.821,80	76.489,42	-103.015,41
NTNB20260815 - 760199_NEGOCIACAO	18.168.290,16	89.090,66	87.342,99	19,42%	-381.225,54	401.422,49	333.234,02	-442.369,35
NTNB20270515 - 760199_NEGOCIACAO	14.147.101,33	108.185,73	107.199,39	23,83%	-387.554,47	389.887,23	337.769,55	-445.126,68
NTNB20280815 - 760199_NEGOCIACAO	23.202.583,09	255.639,63	247.650,18	55,05%	-869.221,52	880.506,63	792.856,12	-1.031.638,31
NTNB20290515 - 760199_NEGOCIACAO	779.698,93	9.643,19	9.068,87	2,02%	-34.621,29	31.119,36	30.169,68	-38.994,50
NTNB20500815 - 760199_NEGOCIACAO	1.451.728,13	54.013,58	41.044,11	9,12%	-184.963,50	180.555,55	192.276,51	-212.202,58
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
Total Var:	227.228.723,12	919.429,31	449.825,05	99,99%	-1.829.477,50	1.893.051,44	1.507.852,01	-2.025.510,72

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2024

## Relatório de Risco de Mercado



Data: 30/08/2024

FUNDO:		FIM EMB I A							
CNPJ:		20725946000122							
Dados Gerais									
PL:	190.243.410,11	VAR / PL:	0,1564%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	431,33		
VAR:	297.577,49	ETL / PL:	0,1962%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	296,33		
ETL:	373.174,18	VAR / CDI:	0,0017%	Benchmark:					
Cenários de STRESS									
Cenário Alta - 09999 (+):	1.267.117,13	Cenário Baixa - 10000 (+):	7.285.404,67	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	4.454.192,68	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	1.039.383.578,65		
Cenário Alta - 09999 (-):	-3.348.326,25	Cenário Baixa - 10000 (-):	-5.313.098,91	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	-1.983.484,03	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	-1.048.596.046,47		
Cenário Alta - 09999:	-2.081.209,12	Cenário Baixa - 10000:	1.972.305,76	CENÁRIO BRADESCO 1:	2.470.708,65	CENÁRIO BRADESCO 2:	-9.212.467,82		
Parâmetros do Cálculo									
Modelo:	Var paramétrico	Modelo Volatilidade:	EWMA						
Int. Confiança:	95	Lâmbda:	0,94						
Horizonte:	21								
Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2	
ANHB10	469.230,97	8,81	7,31	0,00%	-58,80	48,06	89,53	-131,99	
BCBF14	178.653,28	1,33	0,25	0,00%	-10,23	8,79	17,82	-26,66	
CAXA	9.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
CBAN22	3.851.021,18	31.296,37	28.197,50	9,48%	-84.967,46	71.921,13	111.653,14	-146.328,83	
CEBEA3	1.920.150,34	125,36	109,42	0,04%	-725,57	585,59	1.055,00	-1.537,12	
CGBP13	2.031.889,10	751,18	704,26	0,24%	-3.056,82	2.524,23	4.266,66	-5.927,73	
COMPROMISSADA PRE	90.602.067,55	282,75	-146,11	-0,05%	-2.595,87	2.647,63	9.102,02	-13.854,04	
CONTAS A PAGAR RECEBER	-18.847,93	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
CPMU24C100500	-436,47	148,39	5,37	0,00%	0,18	-0,18	-0,62	0,94	
CPT12	1.788.639,45	1.002,61	944,50	0,32%	-3.837,71	3.222,86	5.376,96	-7.262,36	
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
DHF25	-462,41	72.097,63	5.390,12	1,81%	-662.301,74	509.497,89	1.232.453,20	-1.854.958,57	
DHF26	-5.105,64	73.764,80	64.300,98	21,61%	-390.808,45	288.626,26	524.495,81	-760.820,27	
DHF31	10.951,24	31.504,59	-29.366,52	-9,87%	109.768,37	-94.353,21	-157.417,72	190.391,01	
DHN26	39.887,13	240.788,87	-218.324,97	-73,37%	1.016.422,34	-773.072,04	-1.347.429,10	1.920.056,26	
DH124	-84,53	1.545,72	798,77	0,27%	14.191,18	-14.474,15	-49.759,15	75.737,60	
DH124	373,72	16.333,22	-2.961,46	-1,00%	-159.620,07	163.675,07	562.298,85	-853.001,59	
ELET13	2.078.419,41	76,06	56,58	0,02%	-548,18	446,69	836,79	-1.234,13	
GRBR14	1.055.813,36	14,80	11,82	0,00%	-102,45	84,05	156,38	-229,96	
IDIF25P419600	26,12	38,10	-0,31	0,00%	-26,12	37.471,33	-26,12	135.081.726,22	
IDIF25P419700	-26,12	39,24	0,31	0,00%	26,12	-43.549,82	26,12	-135.330.323,45	
IDIF25P422200	17.811,20	18.659,07	-149,44	-0,05%	-17.811,16	534.312,76	-17.811,20	24.909.765,00	
IDIF25P422300	-60.333,60	53.677,86	429,90	0,14%	60.332,70	-1.133.042,45	60.333,60	-49.882.379,84	
IDIF25P422400	48.244,80	35.956,45	-287,97	-0,10%	-48.240,00	593.101,57	-48.244,80	24.966.892,44	
IDJ25P432500	24.165,23	26.702,71	6.684,42	2,25%	-24.165,21	1.483.711,76	-24.165,23	45.510.338,18	
IDJ25P432600	-59.031,00	63.286,51	-15.842,35	-5,32%	59.030,92	-3.120.381,75	59.031,00	-91.181.662,26	
IDJ25P432700	35.081,28	36.745,43	9.198,39	3,09%	-35.081,22	1.636.753,61	-35.081,28	45.671.108,58	
IDIV24P410000	18,50	5,06	-0,92	0,00%	-17,44	217,00	-18,50	106.210.911,08	
IDIV24P410100	-18,50	5,38	0,98	0,00%	17,63	-253,96	18,50	-106.393.677,31	
IDIV24P410200	-18,71	5,81	1,06	0,00%	18,00	-306,07	18,71	-107.786.230,20	
IDIV24P410300	4,97	1,66	-0,30	0,00%	-4,83	99,03	-4,97	28.680.717,44	
IDIV24P410400	4,32	1,55	-0,28	0,00%	-4,23	107,68	-4,32	24.972.396,56	
IDIV24P410500	9,42	3,69	-0,67	0,00%	-9,28	303,62	-9,42	54.546.760,64	
IDIV24P410700	28,68	13,63	-2,49	0,00%	-28,53	1.772,98	-28,68	166.638.977,20	
IDIV24P410800	-28,85	15,40	2,81	0,00%	28,78	-2.721,61	28,85	-167.911.742,19	
IDIV24P410900	-36,37	22,19	4,05	0,00%	36,34	-5.749,89	36,37	-212.038.686,82	
IDIV24P411000	53,64	38,27	-6,98	0,00%	-53,63	16.134,10	-53,64	313.253.463,58	
IDIV24P411100	-17,10	14,76	2,69	0,00%	17,10	-11.616,90	17,10	-100.031.616,62	
IDIV24P411200	11,34	12,47	-2,27	0,00%	-11,34	21.563,43	-11,34	66.448.787,04	
IDIV24P411300	-9,13	14,04	2,56	0,00%	9,13	-56.768,00	9,13	-53.589.088,76	
IDIV24P411400	-2,30	6,11	1,11	0,00%	2,30	-35.468,63	2,30	-13.522.711,79	
IDIV24P411600	-7.221,15	1.967,59	358,86	0,12%	7.216,06	-21.340,25	7.221,15	-4.771.130,38	
LCAMC3	3.050.110,27	504,73	459,28	0,15%	-2.496,32	2.015,52	3.530,95	-5.084,66	
LF002100HDP	1.656.057,68	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
LF002100HDQ	3.016.905,41	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
LFSC1900089	3.905.010,61	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
LFT20250301 - 210100	1.527.818,78	280,15	149,78	0,05%	-1.767,94	1.973,52	-94,35	143,65	
LFT20250901 - 210100	10.480.928,04	2.247,72	1.051,57	0,35%	-28.285,91	40.632,41	-670,58	1.021,02	
LFT20260301 - 210100	12.952.135,86	1.643,21	120,23	0,04%	-47.780,43	86.027,90	164,06	-249,78	
LFT20260901 - 210100	9.117.707,78	1.486,32	135,06	0,05%	-44.344,46	83.961,31	299,24	-455,57	
LFT20270301 - 210100	6.695.356,28	1.741,19	603,48	0,20%	-31.378,93	85.820,67	2.595,85	-3.950,17	
LFT20290301 - 210100	4.370.044,81	1.388,84	27,20	0,01%	-26.652,40	118.803,92	7.405,77	-11.250,98	
LITN20260701 - 100000	24.997.022,38	240.143,13	216.885,98	72,88%	-1.007.519,68	781.916,42	1.349.298,21	-1.922.500,20	
NTNB20500815 - 760199 NEGOCIACAO	3.620.780,11	142.157,48	125.665,39	42,23%	-406.802,48	475.201,26	506.049,47	-558.492,59	
OMGE13	950.084,84	371,07	347,16	0,12%	-1.514,86	1.246,16	2.102,35	-2.928,37	
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
SBSPC7	2.378.700,53	600,39	553,94	0,19%	-2.803,36	2.277,85	3.949,91	-5.643,83	
VAMO22	701.295,33	28,90	23,39	0,01%	-197,06	160,18	291,88	-428,07	
WDOU24	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
WDOU24	-8.734,05	124.352,80	101.434,05	34,09%	-232.696,10	236.530,47	-302.653,01	304.384,21	
<b>Total Var:</b>	<b>193.620.901,09</b>	<b>1.223.921,40</b>	<b>297.577,49</b>	<b>100,00%</b>	<b>-2.081.209,12</b>	<b>1.972.305,76</b>	<b>2.470.708,65</b>	<b>-9.212.467,82</b>	



# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2024

## Relatório de Risco de Mercado



Data: 30/08/2024

FUNDO: FIM EMB III A IMOBILIÁRIO  
CNPJ: 3271193000162

Dados Gerais			
PL:	70.951.359,70	VAR / PL:	7,2927%
VAR:	5.174.250,50	ETL / PL:	9,1453%
ETL:	6.488.718,88	VAR / CDI:	0,0789%
Limite Fundo:		Status:	ENQUADRADO
Benchmark:		Dutacion DC:	0,00%
		Dutacion DU:	3,00

Cenários de STRESS			
Cenário Alta - 09999 (+):	33.997.440,86	Cenário Baixa - 10000 (-):	7,74 CENARIO BRADESCO 1 (+): 9.608.416,25 CENARIO BRADESCO 2 (+): 0,00
Cenário Alta - 09999 (-):	-7,58	Cenário Baixa - 10000 (-):	-33.997.467,88 CENARIO BRADESCO 1 (-): 0,00 CENARIO BRADESCO 2 (-): -9.687.079,98
Cenário Alta - 09999:	33.997.433,28	Cenário Baixa - 10000:	-33.997.460,15 CENARIO BRADESCO 1: 9.608.416,25 CENARIO BRADESCO 2: -9.687.079,98

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
AIEC11	1.991.640,96	38.320,81	24.952,67	0,48%	395.820,48	-995.820,48	291.974,57	-294.364,53
BMLC11	3.609.522,30	105.966,21	-22.981,47	-0,44%	3.609.522,30	-3.609.522,30	529.155,97	-533.487,40
BPML11	4.817.380,36	249.447,44	50.917,87	0,98%	4.817.380,36	-4.817.380,36	706.227,96	-712.008,82
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CBOP11	1.821,30	76,90	49,37	0,00%	910,65	-910,65	267,00	-269,19
CEOC11	658.417,80	30.535,42	21.590,21	0,42%	329.208,90	-329.208,90	96.524,05	-97.314,15
CNES11	266.979,00	23.420,64	15.177,09	0,29%	133.489,50	-133.489,50	39.139,12	-39.459,50
COMPROMISSADA_PRE	264.675,78	0,83	-0,41	0,00%	-7,58	7,74	26,59	-40,47
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-244.595,61	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
EVBI11	3.361.393,74	4.324.456,40	4.174.683,30	80,68%	3.361.393,74	-3.361.393,74	492.780,32	-496.814,00
FIGS11	711.504,00	15.210,13	1.894,89	0,04%	355.752,00	-355.752,00	104.306,49	-105.160,29
FVPQ11	763.787,50	52.551,21	26.019,17	0,50%	381.893,75	-381.893,75	111.971,25	-112.887,79
GZT11	1.149.252,30	97.024,38	68.925,93	1,33%	574.626,15	-574.626,15	168.480,39	-169.859,49
HOFIC11	330.699,55	33.105,63	17.123,45	0,33%	0,00	0,00	48.480,41	-48.877,25
JSRE11	99.547,30	5.595,19	2.670,07	0,05%	25.882,14	-25.882,30	14.593,63	-14.713,09
MALL11	5.897.144,26	228.592,04	46.701,00	0,90%	1.533.257,51	-1.533.257,51	864.521,35	-871.597,92
MAXR11	2.432.252,00	97.957,25	-3.074,69	-0,06%	1.216.126,00	-1.216.126,00	356.568,14	-359.486,85
NEWL11	7.061.019,68	310.547,85	-47.424,53	-0,92%	3.530.509,84	-3.530.509,84	1.035.145,49	-1.043.618,71
NEWU11	1.850.337,30	203.034,08	62.752,25	1,21%	1.850.337,30	-1.850.337,30	271.259,45	-273.479,85
OULG11	613.104,66	21.244,80	14.663,65	0,28%	306.552,33	-306.552,33	89.881,14	-90.616,87
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PATC11	4.302.508,00	168.219,33	103.960,78	2,01%	2.151.254,00	-2.151.254,00	630.747,67	-635.910,68
QAGR11	5.323.927,04	91.477,28	36.967,38	0,71%	2.661.952,28	-2.661.963,52	780.487,70	-786.876,42
RBRP11	2.106.076,28	132.823,32	74.131,57	1,43%	1.053.038,14	-1.053.038,14	308.750,78	-311.278,07
RCRB11	5.388.739,98	222.697,51	126.503,59	2,44%	0,00	0,00	0,00	0,00
SARE11	749.161,25	30.609,03	11.664,76	0,23%	374.580,63	-374.580,63	109.827,04	-110.726,03
TRXF11	8.292.900,72	244.884,18	170.238,76	3,29%	2.156.146,38	-2.156.162,00	1.215.739,25	-1.225.690,73
VVMR11	3.995.550,00	147.606,77	-5.012,83	-0,10%	0,00	0,00	585.747,63	-590.542,29
XPIN11	2.846.795,70	121.119,38	75.801,50	1,46%	1.423.397,85	-1.423.397,85	417.340,25	-420.756,40
XPPR11	2.308.817,28	259.157,83	125.355,17	2,42%	1.154.408,64	-1.154.408,64	338.472,61	-341.243,19
<b>Total Var:</b>	<b>70.951.359,44</b>	<b>7.252.681,82</b>	<b>5.174.250,50</b>	<b>99,96%</b>	<b>33.997.433,28</b>	<b>-33.997.460,15</b>	<b>9.608.416,25</b>	<b>-9.687.079,98</b>

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2024



Data: 30/08/2024

## Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIA RVA EMB II CNPJ: 13294268000125

Dados Gerais		Limite Fundo:		ENQUADRADO		0,00% Dutation DC:		3,00	
PL:	99.552.650,88	VAR / PL:	7,9141%	Status:		Dutation DU:			1,00
VAR:	7.878.679,09	ETL / PL:	9,9246%	Benchmark:					
ETL:	9.880.181,43	VAR / CDI:	0,0867%						

Cenários de STRESS				
Cenário Alta - 09999 (+):	25.435.633,96	Cenário Baixa - 10000 (+):	18,29	CENÁRIO BRADESCO 1 (+): 14.315.844,93 CENÁRIO BRADESCO 2 (+): 0,00
Cenário Alta - 09999 (-):	-17,94	Cenário Baixa - 10000 (-):	-25.275.990,43	CENÁRIO BRADESCO 1 (-): 0,00 CENÁRIO BRADESCO 2 (-): -14.433.060,15
Cenário Alta - 09999:	25.435.616,02	Cenário Baixa - 10000:	-25.275.972,14	CENÁRIO BRADESCO 1: 14.315.844,93 CENÁRIO BRADESCO 2: -14.433.060,15

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
ABEV3	2.074.382,30	245.524,05	216.809,84	2,75%	220.413,52	-622.338,82	304.184,45	-306.593,70
B3SA3	2.768.411,72	435.277,18	414.090,08	5,26%	692.102,93	-692.102,93	405.849,16	-409.171,25
BBAS3	3.059.456,00	248.539,69	224.787,41	2,85%	764.864,00	-764.864,00	448.516,25	-452.187,60
BBDC4	2.994.747,20	744.272,35	637.448,41	8,09%	748.686,80	-748.686,80	439.029,94	-442.623,64
BBSE3	602.372,00	47.588,55	41.713,84	0,53%	120.474,40	-120.474,40	88.307,74	-89.030,58
BPAC11	3.289.300,00	438.594,47	388.793,23	4,93%	986.790,00	-1.151.255,00	482.211,38	-486.158,54
BRFS3	742.309,00	136.073,10	86.651,59	1,10%	185.577,25	-185.577,25	108.822,50	-109.713,27
BRIT3	473.373,00	65.283,62	-37.798,82	-0,48%	222.485,31	-222.485,31	69.396,48	-69.964,53
CAIXA	10.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CMG4	1.511.085,90	187.189,82	169.750,79	2,15%	377.771,48	-453.325,77	221.525,19	-223.338,50
COMPROMISSADA_PRE	626.002,05	1,95	-1,41	0,00%	-17,94	18,29	62,89	-95,72
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	1.264.656,09	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPLE6	1.569.715,00	80.757,26	40.704,57	0,52%	345.322,25	-345.337,30	230.120,22	-232.003,88
CURY3	666.960,00	53.072,24	42.527,29	0,54%	200.088,00	-200.088,00	97.776,34	-98.576,69
CXSE3	528.105,00	64.058,61	56.149,10	0,71%	105.621,00	-105.621,00	77.420,19	-78.053,92
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DIRR3	1.475.430,00	115.738,72	-17.667,09	-0,22%	442.629,00	-442.634,10	216.298,04	-218.068,55
ELT3	4.998.383,50	490.301,37	460.450,76	5,84%	1.499.518,05	-1.499.518,05	732.764,49	-738.763,56
ENGH11	657.609,00	71.558,47	63.673,08	0,81%	111.793,53	-114.673,98	96.405,48	-97.194,61
EQLT3	2.708.640,00	221.174,54	183.521,56	2,33%	541.728,00	-541.728,00	397.086,62	-400.336,99
GGBR4	1.314.306,00	101.573,36	54.176,92	0,69%	328.576,50	-328.576,50	192.677,26	-194.254,43
GMAT3	873.892,00	156.168,96	132.434,19	1,68%	157.289,47	-139.822,72	128.112,57	-129.161,24
HAPV3	797.493,12	88.636,04	60.961,20	0,77%	271.147,66	-271.147,66	116.912,49	-117.869,48
IGTI11	346.813,00	32.260,32	30.247,65	0,38%	69.362,60	-69.362,60	50.842,79	-51.258,56
INTB3	579.652,00	48.618,24	14.323,66	0,18%	289.826,00	-202.878,20	84.976,98	-85.672,57
ITSA4	2.021.506,24	139.284,19	128.811,46	1,63%	384.086,19	-384.086,19	296.352,82	-298.778,62
ITUB4	9.304.807,90	660.222,37	615.286,81	7,81%	1.860.961,58	-1.767.913,50	1.364.084,84	-1.375.250,61
JBSS3	2.334.500,00	256.298,88	45.850,89	0,58%	817.075,00	-817.075,00	342.237,70	-345.039,10
LREN3	997.636,50	315.769,19	296.688,53	3,77%	199.527,30	-199.527,30	146.253,51	-147.450,68
LWSA3	461.370,00	70.332,04	63.801,06	0,81%	184.537,86	-184.548,00	67.636,84	-68.190,49
MRFG3	1.799.616,00	429.603,18	322.492,07	4,09%	719.846,40	-539.884,80	263.823,71	-265.983,25
MULT3	466.648,00	40.324,82	35.986,11	0,46%	139.994,40	-116.662,00	68.410,60	-68.970,57
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PETR3	2.086.884,00	227.022,26	177.449,38	2,25%	521.721,00	-626.070,06	305.937,19	-308.441,46
PETR4	8.683.407,63	931.678,08	779.776,07	9,00%	2.170.851,96	-2.605.022,35	1.272.987,59	-1.283.407,68
PRIO3	1.672.188,00	168.758,73	97.252,38	1,23%	886.259,64	-551.822,04	245.142,76	-247.149,39
RADL3	1.303.477,76	148.125,29	40.354,53	0,51%	260.695,55	-260.695,55	191.089,84	-192.654,01
RAI3	1.286.965,00	101.923,51	20.609,03	0,26%	579.134,25	-424.698,45	188.669,07	-190.213,43
RDR3	2.184.012,00	349.476,29	326.127,14	4,14%	655.203,60	-655.203,60	320.176,16	-322.796,97
RENT3	3.003.462,00	343.543,92	133.484,61	1,69%	991.142,46	-780.900,12	440.307,53	-443.911,68
SBFG3	1.172.282,00	208.839,54	163.113,37	2,07%	445.452,78	-468.911,58	171.853,61	-173.260,32
SBSF3	2.709.278,00	349.115,79	249.915,50	3,17%	677.319,50	-677.319,50	397.180,16	-400.431,29
SRNA3	642.330,00	49.524,27	6.856,34	0,09%	0,00	0,00	94.165,58	-94.936,37
SUZB3	3.162.500,00	350.332,77	250.088,94	3,17%	790.625,00	-632.500,00	463.622,50	-467.417,50
TIMS3	760.836,00	85.117,63	68.570,55	0,87%	243.467,52	-174.992,28	111.538,56	-112.451,56
TOTS3	1.087.911,00	142.770,24	91.080,03	1,16%	217.582,20	-217.582,20	159.487,75	-160.793,25
VALE3	10.271.294,10	583.134,56	235.102,71	2,98%	2.567.823,53	-2.567.823,53	1.505.771,72	-1.518.097,27
VBBR3	905.344,00	125.511,72	110.334,36	1,40%	226.336,00	-226.336,00	132.723,43	-133.809,84
VIVT3	1.814.050,00	152.395,13	128.272,69	1,63%	272.107,50	-272.111,00	265.939,73	-268.116,59
WEGE3	3.487.260,00	346.506,63	227.626,63	2,89%	871.815,00	-871.815,00	511.232,32	-515.417,03
<b>Total Var:</b>	<b>99.552.650,21</b>	<b>10.648.873,92</b>	<b>7.878.679,09</b>	<b>99,97%</b>	<b>25.435.616,02</b>	<b>-25.275.972,14</b>	<b>14.315.844,93</b>	<b>-14.433.060,15</b>

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2024



## Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIA RVA EMB III  
CNPJ: 38452593000108

Data: 30/08/2024

Dados Gerais	
PL: 113.888.902,70	VAR / PL: 7,4410%
VAR: 8.474.416,11	ETL / PL: 9,3313%
ETL: 10.627.262,20	VAR / CDI: 0,0815%
Limite Fundo: 0,00%	Dutacion DC: 3,00
Status: ENQUADRADO	Dutacion DU: 1,00
Benchmark:	

Cenários de STRESS			
Cenário Alta - 09999 (+): 30.128.068,12	Cenário Baixa - 10000 (+): 1.278.675,92	CENARIO BRADESCO 1 (+): 15.621.155,28	CENARIO BRADESCO 2 (+): 1.645.320,03
Cenário Alta - 09999 (-): -1.257.947,00	Cenário Baixa - 10000 (-): -27.867.870,00	CENARIO BRADESCO 1 (-): -1.635.962,23	CENARIO BRADESCO 2 (-): -15.749.217,24
Cenário Alta - 09999: 28.870.121,12	Cenário Baixa - 10000: -26.589.194,09	CENARIO BRADESCO 1: 13.985.193,05	CENARIO BRADESCO 2: -14.103.897,21

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	4.716.958,74	335.570,11	302.453,70	3,57%	0,00	0,00	691.374,21	-697.033,48
AZZA3	2.560.103,00	215.040,38	120.436,73	1,42%	0,00	0,00	0,00	0,00
BBAS3	2.200.277,52	178.742,98	140.711,59	1,66%	550.069,38	-550.069,38	322.560,68	-325.201,02
BBDC4	1.955.000,00	485.868,20	364.218,79	4,30%	488.750,00	-488.750,00	286.603,00	-288.949,00
BBSE3	1.865.884,00	147.408,44	121.050,02	1,43%	373.176,80	-373.176,80	273.538,59	-275.777,66
BPAC11	3.483.848,76	464.535,56	381.533,52	4,50%	1.045.154,63	-1.219.347,07	510.732,23	-514.912,85
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	4.546.384,89	14,19	-10,35	0,00%	-130,26	132,86	456,74	-695,19
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	388.331,71	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPLE3	3.017.292,74	172.955,22	141.496,34	1,67%	663.804,40	-663.804,40	442.335,12	-445.955,87
CPLE6	3.075.890,44	158.245,60	98.384,69	1,16%	676.666,41	-676.695,90	450.925,54	-454.616,61
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DOLV24	-47.211,08	672.177,28	512.767,47	6,05%	-1.257.816,74	1.278.543,06	-1.635.962,23	1.645.320,03
ELET3	6.474.924,00	635.136,89	604.840,34	7,14%	1.942.477,20	-1.942.477,20	949.223,86	-956.993,77
ENEV3	2.891.422,95	205.799,15	158.215,70	1,87%	1.069.826,49	-1.474.625,71	423.882,60	-427.352,31
ENGH11	1.400.376,00	152.383,51	122.661,33	1,45%	238.063,92	-308.082,72	205.295,12	-206.975,57
EQTL1	34.876,40	169.037,38	132.239,71	1,56%	0,00	0,00	5.112,88	-5.154,73
EQTL3	9.301.032,00	759.477,63	686.232,30	8,10%	1.860.206,40	-1.860.206,40	1.363.531,29	-1.374.692,53
FLRY3	3.767.390,00	228.179,61	190.332,74	2,25%	753.478,00	-753.478,00	552.299,37	-556.820,24
GGPS3	1.868.175,00	161.668,43	108.859,65	1,28%	840.678,75	-840.678,75	273.874,46	-276.116,27
HAPV3	3.398.915,44	377.766,76	271.232,84	3,20%	1.155.631,25	-1.155.631,25	498.281,00	-502.359,70
IGTI11	9.070.308,63	843.714,16	807.722,42	9,53%	1.814.061,73	-1.814.061,73	1.329.707,25	-1.340.591,62
ITSA4	4.572.512,00	315.051,53	261.673,09	3,09%	868.777,28	-868.777,28	670.330,26	-675.817,27
MGLU3	781.571,84	200.567,73	183.245,71	2,16%	406.417,36	-351.707,33	114.578,43	-115.516,32
NTCO3	4.003.804,95	336.760,12	-26.025,09	-0,31%	1.000.901,24	-1.000.901,24	586.928,49	-591.732,81
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PRI03	3.601.996,00	363.516,70	258.947,79	3,06%	1.909.057,88	-1.188.658,68	528.052,61	-532.375,01
RAIL3	6.911.023,90	547.330,99	223.601,54	2,64%	3.109.960,76	-2.280.637,89	1.013.156,10	-1.021.449,33
RECV3	1.782.123,60	186.050,26	142.112,80	1,68%	1.069.274,16	-1.069.274,16	261.259,32	-263.397,87
RENT3	7.252.202,37	829.526,07	454.965,73	5,37%	2.393.226,78	-1.885.572,62	1.063.172,87	-1.071.875,51
RENT9	67.515,84	7.630,40	4.272,51	0,05%	0,00	0,00	9.897,62	-9.978,84
SCAR3	148.800,00	12.224,51	7.193,70	0,08%	89.280,00	-89.280,00	21.814,08	-21.992,64
SMFT3	5.552.190,00	654.510,53	565.294,02	6,67%	2.220.876,00	-2.220.876,00	813.951,05	-820.613,68
SUZB3	11.088.385,00	1.228.339,81	946.984,62	11,17%	2.772.096,25	-2.217.677,00	1.625.557,24	-1.638.863,30
VIV03	422.720,00	67.660,25	61.608,34	0,73%	126.816,00	-126.816,00	61.970,75	-62.478,02
WDOV24	472,11	6.721,77	-5.127,67	-0,06%	12.578,17	-12.785,43	16.359,62	-16.453,20
YDUQ3	1.735.284,35	221.677,13	130.325,50	1,54%	676.760,90	-433.821,09	254.392,69	-256.475,03
<b>Total Var:</b>	<b>113.890.683,10</b>	<b>11.341.289,29</b>	<b>8.474.416,11</b>	<b>100,01%</b>	<b>28.870.121,12</b>	<b>-26.589.194,09</b>	<b>13.985.193,05</b>	<b>-14.103.897,21</b>

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2024



## Relatório de Risco de Mercado

Data: 30/08/2024

FUNDO: FIA RVA EMB IV  
CNPJ: 38452613000132

Dados Gerais					
PL:	109.450.358,53	VAR / PL:	7,2462%	Limite Fundo:	0,00%
VAR:	7.931.022,31	ETL / PL:	9,0871%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	9.945.821,95	VAR / CDI:	0,0793%	Benchmark:	
				Dutacion DC:	3,00
				Dutacion DU:	1,00

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	29.722.934,10	Cenário Baixa - 10000 (+):	219,34	CENARIO BRADESCO 1 (+):	14.809.337,52
Cenário Alta - 09999 (-):	-215,05	Cenário Baixa - 10000 (-):	-26.064.416,05	CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00
Cenário Alta - 09999:	29.722.719,06	Cenário Baixa - 10000:	-26.064.196,72	CENARIO BRADESCO 1:	14.809.337,52
				CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	-14.930.947,42
				CENARIO BRADESCO 2:	-14.930.947,42

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
AURE3	2.115.316,63	177.991,29	-109.401,62	-1,39%	528.829,16	-655.748,16	310.105,42	-312.643,80
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA PRE	7.505.671,90	23,42	-17,11	0,00%	-215,05	219,34	754,03	-1.147,70
CONTAS_A PAGAR_RECEBER	930.148,61	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPLE3	2.681.901,46	153.730,15	133.772,60	1,69%	590.018,32	-590.018,32	393.166,75	-396.385,04
CPLE6	3.962.440,44	203.856,02	133.397,21	1,68%	871.698,91	-871.736,90	580.893,77	-585.648,70
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ENGH1	12.576.464,61	1.368.522,36	1.090.141,60	13,75%	2.137.998,98	-2.766.822,21	1.843.709,71	-1.858.801,47
ENGH4	16,28	1,76	1,39	0,00%	13,02	-13,02	2,39	-2,41
EQTL1	52.941,60	256.594,99	201.828,99	2,54%	0,00	0,00	7.761,24	-7.824,77
EQTL3	14.684.727,60	1.199.084,38	1.058.427,07	13,35%	2.936.945,52	-2.936.945,52	2.152.781,07	-2.170.402,74
GGPS3	5.547.523,10	480.072,45	347.448,01	4,38%	2.496.385,40	-2.496.385,40	813.266,89	-819.923,91
GMAT3	5.537.591,20	989.595,79	732.884,80	9,24%	996.696,14	-886.014,59	811.810,87	-818.455,98
HAPV3	6.409.701,28	712.395,50	557.289,22	7,03%	2.179.298,44	-2.179.298,44	939.662,21	-947.353,85
ITUB4	4.658.257,60	330.526,53	293.701,32	3,70%	931.651,52	-885.068,94	682.900,66	-658.490,47
MATD3	706.428,04	70.590,68	56.016,20	0,71%	211.928,41	-211.928,41	103.562,35	-104.410,06
MULT3	4.680.967,40	402.771,80	378.164,21	4,77%	1.398.290,22	-1.165.241,85	683.297,82	-688.890,98
OUTRAS DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PRI03	11.219.304,16	1.132.262,34	811.755,07	10,24%	5.946.231,21	-3.702.370,37	1.644.749,99	-1.658.213,16
RAIL3	9.734.808,65	770.965,72	319.880,71	4,03%	4.380.663,89	-3.212.486,86	1.427.122,95	-1.438.804,72
UGPA3	12.238.958,08	1.456.206,88	1.370.424,39	17,28%	3.059.739,52	-2.447.791,62	1.794.231,26	-1.808.918,00
YBBR3	4.226.181,80	585.893,72	555.306,26	7,00%	1.056.545,45	-1.056.545,45	619.558,25	-624.629,67
<b>Total Var:</b>	<b>109.450.350,44</b>	<b>10.291.085,78</b>	<b>7.931.022,31</b>	<b>100,01%</b>	<b>29.722.719,06</b>	<b>-26.064.196,72</b>	<b>14.809.337,52</b>	<b>-14.930.947,42</b>

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2024

## Relatório de Risco de Mercado



Data: 30/08/2024

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

Dados Gerais			
PL:	124.929.622,32	VAR / PL:	7,5281%
VAR:	9.904.503,72	ETL / PL:	9,9421%
ETL:	12.420.647,25	VAR / CDI:	0,0868%
Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	5,62
Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	-384,25
Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	31.666.724,95	Cenário Baixa - 10000 (-):	3.568,04	CENARIO BRADESCO 1 (+):	18.067.338,97	CENARIO BRADESCO 2 (+):	87,81
Cenário Alta - 09999 (-):	-2.504,73	Cenário Baixa - 10000 (-):	-31.811.379,52	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-57,67	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-18.213.541,28
Cenário Alta - 09999:	31.664.220,22	Cenário Baixa - 10000:	-31.807.811,49	CENARIO BRADESCO 1:	18.067.281,30	CENARIO BRADESCO 2:	-18.213.453,47

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
ABEV3	3.029.931,74	358.622,95	316.014,93	3,19%	424.190,44	-909.003,08	444.187,99	-447.823,91
ALOS3	614.524,21	43.726,33	39.669,20	0,40%	0,00	0,00	90.089,25	-90.826,68
ALPA4	69.623,40	5.364,58	-953,36	-0,01%	17.405,85	-17.405,85	10.206,79	-10.290,34
ASAI3	692.446,92	66.216,41	56.278,20	0,57%	193.885,14	-180.036,20	101.512,72	-102.343,66
AURE3	118.706,58	9.988,45	-6.405,57	-0,06%	29.676,65	-36.799,04	17.402,39	-17.544,83
AZUL4	94.907,12	19.921,61	-1.752,66	-0,02%	56.944,27	-33.217,49	13.913,38	-14.027,27
AZZA3	334.719,00	28.115,31	15.526,32	0,16%	0,00	0,00	0,00	0,00
B3SA3	3.746.559,60	589.071,30	562.152,26	5,68%	936.639,90	-936.639,90	549.245,64	-553.741,51
BBAS3	4.285.150,56	348.110,90	315.922,42	3,19%	1.071.287,64	-1.071.287,64	628.203,07	-633.345,25
BBDC3	1.125.232,92	261.618,98	232.062,39	2,34%	281.308,23	-281.308,23	164.959,15	-166.309,43
BBDC4	4.301.250,24	1.068.972,24	915.531,00	9,24%	1.075.312,56	-1.075.312,56	630.563,29	-635.724,79
BRFB3	1.254.843,72	99.135,07	86.554,19	0,87%	250.968,74	-250.968,74	183.960,09	-185.465,90
BRSF3	104.919,92	19.739,27	16.636,15	0,17%	26.229,98	-26.229,98	15.381,26	-15.607,16
BPAC11	2.453.924,48	327.205,70	287.767,26	2,91%	736.177,34	-858.873,57	359.745,33	-362.690,04
BRAP4	261.968,85	25.415,16	21.406,18	0,22%	65.492,21	-65.492,21	38.404,63	-38.719,00
BRFS3	1.145.437,87	209.970,89	133.596,80	1,35%	286.359,47	-286.359,47	167.921,19	-169.293,72
BRKM5	256.655,08	28.168,11	15.530,20	0,16%	141.160,29	-76.997,95	37.625,64	-37.933,62
CAIXA	9.113,92	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CCRO3	704.542,25	67.904,28	63.717,24	0,64%	176.135,56	-176.135,56	103.285,89	-104.131,35
CMG4	1.158.882,98	143.559,73	130.338,28	1,32%	289.720,75	-347.664,89	169.892,25	-171.282,90
CMN3	338.170,16	49.321,00	33.121,33	0,33%	118.359,56	-118.359,56	49.575,75	-49.981,55
COGN3	137.517,86	22.007,20	3.025,81	0,03%	34.379,47	-48.131,25	20.160,12	-20.325,14
COMPROMISSADA PRE	2.512.270,34	7,84	-5,64	0,00%	-71,98	73,42	252,39	-384,15
CONTAS_A PAGAR_RECEBER	1.496.452,52	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPFE3	343.047,67	13.877,03	9.898,89	0,10%	68.609,53	-68.609,53	50.290,79	-50.702,45
CPLF6	938.939,89	48.305,72	24.201,88	0,24%	206.557,77	-206.566,78	137.648,59	-138.775,32
CRFB3	255.779,55	34.467,23	15.120,96	0,19%	63.944,89	-63.944,89	37.497,26	-37.804,22
CSAN3	834.679,36	76.570,11	52.435,72	0,53%	208.669,84	-208.669,84	122.363,99	-123.365,61
CSNA3	468.137,92	54.620,51	32.501,85	0,33%	187.255,17	-140.441,38	68.629,02	-69.190,79
CVCB3	56.275,02	11.633,93	9.627,13	0,10%	28.137,51	-28.137,51	8.249,92	-8.317,45
CXSE3	303.227,10	36.781,14	32.812,04	0,33%	60.645,42	-60.645,42	44.453,09	-44.816,97
CYRE3	809.669,44	44.734,46	43.204,49	0,44%	99.094,22	-89.804,14	45.397,54	-45.769,14
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DXCO3	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
EGIE3	617.969,44	29.338,76	6.900,44	0,07%	111.234,50	-111.234,50	90.594,32	-91.335,88
ELET3	3.984.035,50	390.801,17	363.695,87	3,67%	1.195.210,65	-1.195.210,65	584.059,60	-588.840,45
ELET6	664.923,54	61.069,50	57.971,82	0,59%	199.477,06	-199.477,06	97.477,79	-98.275,70
EMBR3	1.844.399,55	136.807,59	54.436,97	0,55%	461.099,89	-461.099,89	270.388,97	-272.602,25
ENEV3	1.111.992,83	79.146,91	64.960,58	0,66%	411.437,35	-567.116,34	163.018,15	-164.352,54
ENGI11	827.168,04	90.009,24	80.214,42	0,81%	140.618,57	-181.976,97	121.262,84	-122.255,44
EQTLL1	7.791,90	37.655,43	34.009,36	0,34%	0,00	0,00	1.142,29	-1.151,64
EQTLL3	2.281.755,60	186.317,21	153.116,94	1,55%	456.351,12	-456.351,12	334.505,37	-337.243,48
EZTC3	73.465,26	8.107,44	6.481,60	0,08%	14.692,53	-22.039,58	10.770,01	-10.858,17
FLRY3	397.091,20	24.050,63	20.524,56	0,21%	79.418,24	-79.418,24	58.215,57	-58.690,08
GGBR4	1.219.127,70	94.217,70	50.845,59	0,51%	304.781,93	-304.781,93	178.724,12	-180.187,07
GOAU4	372.006,87	28.436,68	9.353,43	0,09%	111.602,06	-93.001,72	54.536,21	-54.982,62
HAPV3	1.086.389,76	120.744,97	80.777,64	0,82%	369.372,52	-369.372,52	159.264,74	-160.568,41
HYPE3	626.224,68	57.131,77	35.877,44	0,36%	144.031,68	-131.507,18	91.804,54	-92.556,01
IGTI11	250.390,15	23.291,13	21.700,67	0,22%	50.078,03	-50.078,03	36.707,20	-37.007,66
INDV24	10.776,00	251.063,89	250.487,39	2,53%	601.132,91	-599.861,95	473.192,50	-475.425,27
IRBR3	212.049,54	124.815,71	112.182,00	1,13%	137.832,20	-116.627,69	31.086,46	-31.340,92
ITSA4	3.234.317,92	222.848,36	207.841,26	2,10%	614.520,41	-614.520,41	474.151,01	-478.033,19
ITUB4	8.765.464,70	621.953,29	582.357,26	5,88%	1.753.092,94	-1.665.438,29	1.285.017,13	-1.295.535,68
JBS3	2.144.240,00	235.410,71	35.821,59	0,36%	750.484,00	-750.484,00	314.345,58	-316.918,67
KLBN11	886.312,68	57.700,97	42.259,07	0,43%	221.578,17	-177.262,54	129.933,44	-130.997,01
LFT20250901 - 210100	901.420,92	193,32	113,82	0,00%	-2.432,75	3.494,62	-57,67	87,81
LREN3	868.649,67	274.942,63	258.808,37	2,61%	173.729,93	-173.729,93	127.344,04	-128.386,42
LWSA3	102.611,60	15.642,29	14.121,52	0,14%	41.042,39	-41.044,64	15.042,86	-15.165,99
MGLU3	230.650,88	59.169,85	56.277,23	0,57%	119.939,46	-103.792,90	33.815,42	-34.090,20
MRFG3	235.755,52	56.279,41	42.050,74	0,42%	94.302,21	-70.726,66	34.561,76	-34.844,67
MRVE3	151.110,63	21.284,22	18.529,75	0,19%	45.333,19	-45.335,21	22.152,82	-22.334,15
MULT3	427.136,36	37.774,60	33.609,77	0,34%	131.140,91	-109.284,09	64.084,19	-64.608,75
NTCO3	616.945,05	51.893,85	-14.334,84	-0,14%	154.236,26	-154.236,26	90.444,14	-91.184,48
OUTRAS DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PCAR3	64.543,73	11.601,94	9.694,25	0,10%	23.363,59	-23.365,66	9.462,11	-9.539,56
PETR3	5.636.089,70	613.123,60	492.317,25	4,97%	1.409.022,43	-1.690.840,04	826.250,75	-833.014,06
PETRA	9.352.540,35	1.003.472,02	858.831,65	8,67%	2.338.135,09	-2.805.762,11	1.371.082,42	-1.382.305,46
PETZ3	80.170,56	35.377,40	32.553,62	0,33%	30.464,81	-40.886,99	11.753,00	-11.849,21
PRIO3	2.006.016,68	202.449,02	113.010,58	1,14%	1.063.188,84	-661.985,50	294.082,05	-296.489,27
RADL3	1.890.836,48	216.322,48	54.072,00	0,55%	378.167,30	-378.167,30	277.196,63	-279.465,63
RAIL3	1.424.401,50	112.808,04	20.629,35	0,21%	640.980,68	-470.052,50	208.817,26	-210.526,54
RAIZ4	205.276,29	20.589,47	18.555,68	0,19%	71.846,70	-71.846,70	30.093,50	-30.339,84
RDO3	1.960.565,86	313.721,39	292.495,68	2,95%	588.169,76	-588.169,76	287.418,96	-289.771,63
RECV3	301.471,20	20.296,65	20.296,65	0,20%	180.892,72	-180.892,72	44.195,68	-44.557,44
RENT3	2.168.408,55	248.028,90	92.905,66	0,94%	715.574,82	-563.786,22	317.888,69	-320.490,78
RENT9	3.102,75	350,66	137,67	0,00%	0,00	0,00	454,86	-458,59
RRRP3	658.032,86	88.721,08	75.094,99	0,76%	347.697,42	-216.490,84	96.174,42	-96.961,66
SANB11	600.116,80	52.755,36	46.987,41	0,47%	120.023,36	-120.023,36	87.977,12	-88.697,26
SBSF3	3.471.191,39	447.295,45	316.133,06	3,19%	867.797,85	-867.797,85	508.876,66	-513.042,09
SLEC3	183.893,58	15.358,12	435,54	0,00%	55.168,07	-55.168,07	26.958,80	-27.179,47
SMT03	211.669,92	31.019,43	-10.569,94	-0,11%	63.500,98	-63.501,74	31.030,81	-31.284,81
STBP3	415.142,00	46.716,48	-1.467,60	-0,01%	145.299,70	-145.299,70	60.859,82	-61.357,99
SUZB3	1.860.210,00	206.068,78	145.080,72	1,46%	465.052,50	-372.042,00	272.706,79	-274.939,04
TAEI11	415.332,20	30.606,71	28.899,82	0,29%	103.833,05	-103.833,05	60.887,70	-61.386,10
TIMS3	773.087,96	86.488,31	68.806,02	0,69%	247.388,15	-177.810,23	113.334,70	-114.262,40

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2024

## Relatório de Risco de Mercado



Data: 30/08/2024

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

Dados Gerais							
PL:	124.929.622,32	VAR / PL:	7,5281%	Limite Fundo:	0,00%	Dutation DC:	5,62
VAR:	9.904.503,72	ETL / PL:	9,9421%	Status:	ENQUADRADO	Dutation DU:	2,81
ETL:	12.420.647,25	VAR / CDI:	0,0868%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	31.666.724,95	Cenário Baixa - 10000 (+):	3.568,04	CENARIO BRADESCO 1 (+):	18.067.338,97	CENARIO BRADESCO 2 (+):	87,81
Cenário Alta - 09999 (-):	-2.504,73	Cenário Baixa - 10000 (-):	-31.811.379,52	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-57,67	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-18.213.541,28
Cenário Alta - 09999:	31.664.220,22	Cenário Baixa - 10000:	-31.807.811,49	CENARIO BRADESCO 1:	18.067.281,30	CENARIO BRADESCO 2:	-18.213.453,47

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
TOTS3	868.051,08	113.917,28	72.957,13	0,74%	173.610,22	-173.610,22	127.256,29	-128.297,95
TRPL4	524.197,94	45.772,84	11.995,55	0,12%	104.839,59	-131.049,49	76.847,42	-77.476,46
UGPA3	1.365.135,04	162.425,51	146.561,88	1,48%	341.283,76	-273.027,01	200.128,80	-201.766,96
USIM5	173.056,94	48.304,43	1.668,42	0,02%	67.492,21	-38.072,53	25.370,15	-25.577,82
VALE3	13.641.555,96	774.475,22	323.664,28	3,27%	3.410.388,99	-3.410.388,99	1.999.852,10	-2.016.221,97
VAMO3	197.683,60	38.294,36	-12.634,85	-0,13%	69.189,26	-79.073,44	28.980,42	-29.217,64
VBBR3	1.411.127,80	195.630,70	171.434,18	1,73%	352.781,95	-352.781,95	206.871,34	-208.564,69
VIVA3	178.335,00	28.544,17	25.678,09	0,26%	53.500,50	-53.500,50	26.143,91	-26.357,91
VIVT3	1.131.448,90	95.051,02	79.372,67	0,80%	169.717,34	-169.719,52	165.870,41	-167.228,15
WEGE3	3.683.932,80	366.048,74	235.714,03	2,38%	920.983,20	-920.983,20	540.064,55	-544.485,27
WINV24	1.167,40	27.198,59	27.136,13	0,27%	65.122,73	-64.985,04	51.262,52	-51.504,40
YDUQ3	153.689,35	19.633,36	9.577,01	0,10%	59.936,93	-38.422,39	22.530,69	-22.715,32
<b>Total Var:</b>	<b>124.929.164,06</b>	<b>13.241.025,94</b>	<b>9.904.503,72</b>	<b>100,00%</b>	<b>31.664.220,22</b>	<b>-31.807.811,49</b>	<b>18.067.281,30</b>	<b>-18.213.453,47</b>



## 3. RISCO DE CRÉDITO

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

### 3.1. Relatório de Risco de Crédito

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2024



## RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

30/08/2024

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	692.420,35	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	256.379,70	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	153.827,82	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	20/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	512.701,64	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	18/12/17	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	2.768.940,03	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	21/12/17	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	808.264,74	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/01/18	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	2.867.591,25	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB II	19/02/18	19/02/18	15/02/25	SABESP	5.004.800,12	brAAA	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/02/18	19/02/18	15/02/25	SABESP	3.106.025,20	brAAA	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	13/03/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	13.464.758,94	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB II	23/05/18	23/05/18	15/05/28	COMGAS	26.822.840,72	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	663.196,76	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	663.196,76	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	663.196,76	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	662.062,15	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	663.196,76	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	04/07/18	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	6.344.420,53	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/07/18	26/07/18	15/07/25	AEGEA SA	7.319.508,57	brA	Aa1.br	AA(bra)
FI RF EMB II	26/07/18	26/07/18	15/07/25	CSMG	5.472.310,36	-	Aa3.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/02/13	15/02/25	CEMG	715.049,91	brA+	A1.br	AA(bra)
FIM EMB I A	12/02/19	09/01/19	15/01/25	ITAUUBB	2.685.830,67	-	AAA.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	574.853,72	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	3.639.819,03	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	2.072.789,88	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	6.266.734,74	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	734.644,08	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	5.943.938,54	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	8.815.729,07	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	908.287,24	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	628.746,26	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	30/09/20	28/09/20	22/09/25	HAPVIDA	177.520,58	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	6.521.487,99	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	6.532.884,89	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	4.523.028,93	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/07/19	15/06/29	NEOENERG	643.527,97	brA+	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/07/19	15/06/29	NEOENERG	6.396.989,18	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	1.872.966,69	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	3.589.781,26	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	3.840.707,48	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	31/07/20	15/07/34	IGUA SAN	2.603.019,84	brAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	23/05/18	15/05/28	COMGAS	23.359.941,20	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	256.888,25	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	452.123,32	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	513.776,50	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	256.888,25	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	314.431,22	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	265.461,14	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	770.196,72	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	26/10/16	27/01/25	BRADESCO	15.597.019,40	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	12/12/17	15/11/24	CCR	3.261.109,29	brAAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	14/12/17	15/11/24	ECORODOV	2.236.197,18	brAA	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	19/02/18	15/02/25	SABESP	729.450,40	brAAA	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	23/05/18	15/05/28	COMGAS	10.382.082,89	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	28/06/18	15/06/27	JAGUARA	1.391.586,01	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	28/06/18	15/06/27	ENERGMIR	907.066,11	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	31/07/18	01/08/25	BRADESCO	5.018.853,93	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	22/12/20	15/12/26	IRB	2.776.951,44	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	1.371.428,81	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	07/04/21	15/03/31	LOCALIZA	5.595.714,44	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/06/21	06/01/21	15/11/25	QUATA	592.804,78	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	09/09/24	CSAN	9.380,72	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	217.605,81	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	09/09/24	CSAN	253.279,50	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	339.061,15	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	339.061,15	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	208.026,77	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	422.818,64	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	416.476,36	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	883.798,55	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	220.692,42	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	09/09/24	CSAN	63.319,88	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	09/09/24	CSAN	158.467,20	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	1.016.485,79	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	14/06/21	19/06/19	16/12/24	BNBM	611.894,00	brAAA	AAb	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	14/06/21	12/06/19	09/12/24	BNBM	927.267,97	brAAA	AAb	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	16/06/21	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	392.775,85	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	17/06/21	18/03/21	15/02/26	CORSAN	504.547,59	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	823.639,79	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	94.097,07	-	A.br	-

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2024



## RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

30/08/2024

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	25/06/21	25/06/21	20/06/26	OURO VER	1.454.587,31	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	3.485.076,67	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	01/07/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	3.048.280,40	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/07/21	01/03/21	18/02/25	RENNER	553.071,69	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/07/21	01/03/21	18/02/25	RENNER	116.966,85	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/07/21	07/04/21	15/03/29	CAGECE	1.300.585,86	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	08/07/21	08/07/21	15/06/31	VAMOS	271.210,08	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/07/21	07/04/21	15/03/29	CAGECE	2.964.098,24	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	12/07/21	12/07/21	15/07/26	BRADESCO	4.709.299,17	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	2.181.178,20	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	1.059.429,41	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	550.903,29	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	1.500.617,94	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	310.833,97	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	4.362.356,39	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	386.701,29	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	386.701,29	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	1.378.674,16	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	799.381,41	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/07/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	217.885,12	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/07/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	793.823,49	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.019.936,12	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	925.632,61	-	-	AA-(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	20/09/19	20/08/26	VAMOS	686.241,70	brAA+	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	23/07/21	18/06/21	15/12/30	MG050	599.630,88	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/07/21	07/11/19	15/10/24	BKBR	1.060.367,76	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/07/21	23/12/20	15/12/26	RD COLIN	2.119.797,68	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	04/08/21	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	371.333,88	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	06/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	643.496,91	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	11/08/21	11/08/21	15/08/31	CSAN	1.040.980,98	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	11/08/21	19/11/19	15/06/27	AUTOPIST	1.013.720,74	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	17/08/21	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	2.877.978,95	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	18/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	1.193.603,62	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	18/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	926.226,18	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	27/08/21	27/08/21	20/08/31	S LUZ A	1.029.687,85	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	679.830,68	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	60.880,36	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	304.401,80	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	12/05/21	15/04/26	ELETROB	2.064.599,64	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/09/21	22/10/19	21/10/26	AUTOBAN	467.152,43	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/09/21	20/09/21	15/09/29	MOV_PART	1.092.717,22	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.016.323,52	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.016.323,52	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	1.155.750,96	brAA+	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	830.570,96	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	857.214,10	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	284.965,77	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	284.965,77	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	811.164,50	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	811.164,50	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	1.042.353,07	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	404.914,08	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	404.914,08	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	23/09/21	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	4.209.363,21	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	23/09/21	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	4.473.287,15	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	30/09/21	30/09/21	15/09/31	SIMPAR	894.815,69	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	04/10/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	631.983,05	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/10/21	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	2.432.424,60	-	-	AA-(bra)
FIM EMB I A	20/10/21	20/10/21	20/10/25	DAYCOVAL	3.003.035,01	brAA+	AA.br	AA(bra)
FIM EMB I A	20/10/21	20/10/21	20/10/24	DAYCOVAL	1.655.521,89	brAA+	AA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/10/21	22/10/21	15/12/35	CART	-	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	22/10/21	22/10/21	15/12/35	CART	905.132,68	brAA+	-	-
FIM EMB I A	27/10/21	27/10/21	15/10/29	CONT GLO	1.965.949,22	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/10/21	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	910.046,67	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	04/11/21	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	3.359.687,47	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/11/21	10/11/21	15/10/28	LIGHT	369.375,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	12/11/21	12/11/21	15/10/31	VAMOS	2.186.508,46	brAA+	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/11/21	27/07/21	15/06/39	ANEMJUS	9.586,05	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/11/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	2.309.212,95	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/11/21	27/07/21	15/06/39	ANEMJUS	1.865.444,50	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	03/12/21	11/06/19	09/12/24	BNBMM	612.592,47	brAAA	AA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/12/21	06/12/21	15/12/35	TESC	2.801.958,28	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/12/21	06/01/21	15/11/25	QUATA	2.655.352,15	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/12/21	20/12/21	15/11/35	ORIZON	2.246.923,26	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/01/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	376.810,37	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/01/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	1.119.148,64	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	-	brAA+	-	-

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2024



## RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

30/08/2024

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	10/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	-	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	102.781,99	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	717.053,17	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	775.828,01	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/03/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	856.033,88	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	19/04/22	19/04/22	16/04/29	VERT-10	199.373,77	-	-	AASt(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	26/04/22	26/04/22	15/04/50	LIGHT	988.000,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	623.732,88	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	12/05/22	12/05/22	15/04/27	BRKA	1.548.739,91	-	A+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	12/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.348.892,22	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	26/05/22	26/05/22	10/05/27	GUAR	2.587.995,27	-	-	A
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	2.597.747,89	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	529.804,09	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.037.425,10	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	03/03/22	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	3.205.940,44	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/03/22	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	1.192.965,09	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/03/22	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	532.386,06	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/03/22	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	3.342.978,95	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/03/22	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	2.675.815,72	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/06/22	06/12/21	15/12/35	TESC	872.013,56	-	-	A-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	423.843,27	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	06/12/21	15/12/35	TESC	546.957,61	-	-	A-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	218.561,84	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	13/06/22	30/09/21	15/09/31	SIMPAR	1.926.208,50	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	13/06/22	08/07/21	15/06/31	VAMOS	923.405,75	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	13/06/22	08/07/21	15/06/31	VAMOS	75.336,13	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	13/06/22	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	769.987,17	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	13/06/22	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	870.698,92	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/06/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	1.375.357,86	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	3.372.452,85	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	12/11/21	15/10/31	VAMOS	2.114.353,69	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	12/11/21	15/10/31	VAMOS	1.585.218,64	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	28/07/22	28/07/22	18/07/25	1V11	1.665.694,98	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	29/07/22	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	1.768.379,91	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/08/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	1.291,51	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	448.027,61	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	07/04/21	15/03/29	CAGECE	1.607.586,00	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	07/04/21	15/03/29	CAGECE	2.678.516,71	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	02/09/22	02/09/22	02/09/29	AEGEA SA	1.808.868,53	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	27/09/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	55.535,09	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	28/09/22	28/09/22	28/09/27	B.BRASIL	4.889.876,40	-	AAA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/10/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	38.745,41	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	03/11/22	06/04/21	15/03/29	ANET	1.808.494,80	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/11/22	08/11/22	15/06/42	BRK AMBI	5.761.946,64	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	11/11/22	11/11/22	15/10/40	RAHOLD	2.847.539,19	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	11/11/22	11/11/22	15/10/40	RAHOLD	7.409.152,65	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	3.902.556,28	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	1.756.739,83	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	1.438.404,43	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.491.498,82	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.815.586,18	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.486.852,41	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	01/12/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	1.355.466,87	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	2.240.432,57	brAA+	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	2.376.745,94	brAA+	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	1.733.626,45	brAA+	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/12/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	2.925.578,19	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	15/12/21	15/11/36	ITAPOA T	840.936,41	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	02/05/22	15/04/38	RDVE	403.009,97	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	2.547.012,35	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	26/01/23	26/01/23	20/01/26	CELG	1.540.294,52	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/03/23	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	316.736,13	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	1.180.122,92	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	15/12/21	15/11/36	ITAPOA T	4.074.802,64	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	27/07/22	15/04/36	BRV_VDR	4.449.797,84	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	17/04/23	17/04/23	17/03/30	VERO	3.099.461,92	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	20/04/23	12/05/22	15/04/27	BRKA	1.175.953,29	-	A+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	20/04/23	12/05/22	15/04/27	BRKA	32.461,76	-	A+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/04/23	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	2.322.229,18	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	1.991.497,75	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	2.339.529,18	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	18/06/21	15/12/30	MG050	3.082.509,24	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	08/11/22	15/06/42	BRK AMBI	1.446.424,88	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	08/07/21	15/06/31	VAMOS	1.061.163,25	brAA+	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	806.279,88	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	22/10/21	15/12/35	CART	1.551.656,03	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	2.479.668,45	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	02/10/20	15/09/34	BRKA	308.986,52	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	02/10/20	15/09/34	BRKA	2.949.311,14	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	18/03/21	15/02/31	CORSAN	1.634.498,78	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	22/10/21	15/12/35	CART	670.033,29	brAA+	-	-

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2024



## RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

30/08/2024

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	05/05/23	10/02/21	15/12/31	METRORIO	5.048.188,52	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/05/23	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	229.002,57	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/05/23	08/11/22	15/06/42	BRK AMBI	2.530.305,92	-	AA-br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/05/23	22/10/21	15/12/35	CART	2.209.934,35	brAA+	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.059.283,91	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	16/05/23	23/12/20	15/12/27	SABESP	2.322.297,84	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	21/07/21	15/07/31	CACHOEIR	1.727.672,29	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	29/10/21	15/10/26	COELBA	1.902.106,42	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	04/05/22	15/04/27	LOCALIZA	2.945.287,35	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/05/23	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	59.678,66	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/06/23	25/06/21	20/06/26	OURO VER	291.739,26	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/06/23	26/07/21	15/06/33	ASA BRAN	1.240.279,13	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	23/06/23	23/06/23	15/05/43	IGUA RJ	1.406.222,54	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	28/06/23	08/07/21	15/06/31	VAMOS	1.064.391,94	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/06/23	28/07/22	18/07/25	1V11	377.965,04	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/07/23	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	1.029.456,11	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/07/23	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	1.029.456,11	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/07/23	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	658.675,57	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/07/23	28/07/22	18/07/25	1V11	1.146.120,40	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/07/23	28/07/22	18/07/25	1V11	280.162,76	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	21/07/23	23/12/20	15/12/26	RD COLIN	1.579.936,68	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	741.837,95	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	741.837,95	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	15/12/21	15/11/36	ITAPOA T	2.636.945,69	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	26/07/21	15/06/33	ASA BRAN	2.568.767,78	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	01/08/23	31/07/23	25/07/28	TIMS A	2.441.945,25	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/23	17/04/23	17/03/30	VERO	1.368.271,55	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/23	06/12/21	15/12/35	TESC	2.047.492,63	-	-	A-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/23	02/05/22	15/04/38	RDVE	3.265.414,10	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/08/23	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.136.944,02	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/08/23	05/06/18	05/06/28	BRADESCO	4.353.735,09	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/08/23	08/08/23	15/01/34	SPERIO4	2.412.804,33	brAA+	-	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	29/08/23	29/08/23	29/08/25	BRADESCO	11.267.514,50	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	30/08/23	30/08/23	01/09/25	VOLKSWAG	6.779.106,56	brAAA	AAA.br	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	08/09/23	08/09/23	08/09/25	B VOTORA	6.764.788,76	brAAA	AA.br	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/09/23	06/01/21	15/11/25	QUATA	2.583,03	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	19/09/23	13/09/23	15/09/25	PANAMERI	5.583.487,18	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/09/23	21/09/23	15/09/28	ELETROB	2.721.477,44	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/09/23	28/09/23	15/09/30	CSMG	2.623.650,26	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/09/23	19/05/21	10/05/30	RODO BR	2.647.474,12	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/09/23	06/09/21	20/08/31	S LUZ A	1.472.570,62	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/09/23	13/09/23	15/09/25	B VOTORA	5.572.679,39	brAAA	AA.br	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/10/23	14/11/22	10/10/31	CORREDOR	2.389.484,73	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/10/23	20/10/23	20/10/28	SANTANDE	4.507.669,57	-	AAA.br	A-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/11/23	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	3.129.064,36	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/11/23	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	1.487.878,95	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/11/23	18/03/21	15/02/31	CORSAN	3.051.218,85	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/11/23	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	3.099.265,32	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/11/23	18/06/21	15/12/30	MG050	924.854,40	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	17/11/23	23/08/22	15/08/32	PETRJ	4.585.449,23	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	23/11/23	29/09/22	15/09/28	VERT5	2.507.334,73	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	23/11/23	10/12/21	17/11/28	DESKTOP	2.651.175,51	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/12/23	12/02/21	15/12/35	MS 306	1.087.343,92	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/12/23	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.051.251,12	-	Aa3.br	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	26/12/23	27/12/22	02/06/26	BRADESCO	10.856.628,49	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	08/01/24	08/01/24	08/01/26	DAYCOVAL	10.784.648,02	brAA+	AA.br	AA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	08/01/24	08/01/24	08/01/26	B.ALFA	10.766.109,54	-	AAA.br	AA+(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	08/01/24	08/01/24	08/01/26	ABC	10.809.457,25	brAAA	AA+.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	17/04/23	17/03/30	VERO	3.005.914,52	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	2.104.823,30	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	2.104.823,30	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	25/03/22	15/03/44	GBS PART	1.923.634,95	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	25/03/22	15/03/44	GBS PART	2.086.635,27	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	964.804,99	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	1.930.715,14	brA	-	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	11/01/24	27/12/22	02/06/26	BRADESCO	11.413.502,71	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	18/01/24	18/01/24	04/01/27	TOYOTA	6.519.992,91	brAAA	-	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	24/01/24	24/01/24	26/01/26	ABC	10.752.910,93	brAAA	AA+.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	24/01/24	24/01/24	25/01/27	BTG PACT	4.596.650,74	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	25/01/24	25/01/24	26/01/26	BTG PACT	6.882.714,87	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/01/24	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	1.124.309,44	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/01/24	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.179.398,22	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	30/01/24	28/04/21	15/04/31	MANAUSEN	2.480.732,67	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	30/01/24	01/06/23	25/05/26	LMTRANS	2.611.011,11	-	AA+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	30/01/24	27/10/21	15/10/29	CONT GLO	2.494.353,67	-	-	AA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	31/01/24	31/01/24	02/02/26	B.ALFA	11.325.839,63	-	AAA.br	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/02/24	08/02/24	15/09/31	PLANALTO	3.109.683,45	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	15/02/24	15/02/24	15/12/43	AGUAS SE	2.231.873,97	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/02/24	12/11/21	30/04/29	HAPVIDA	562.690,76	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/02/24	18/03/21	15/02/26	CORSAN	1.266.414,45	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/02/24	07/11/19	15/10/24	BKBR	1.544.630,20	-	-	AA(bra)





## RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

30/08/2024

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/02/24	19/04/22	16/04/29	VERT-10	773.256,14	-	-	AAAsf(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/02/24	07/04/21	15/03/26	CAGECE	2.584.409,04	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/02/24	24/03/22	11/03/27	ARTERIS	2.609.912,29	brAAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/02/24	16/02/24	15/02/34	NTRASSUD	2.639.012,14	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	285.131,37	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	18/06/21	15/12/30	MG050	289.652,20	brAAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	02/05/22	15/04/38	RDVE	825.395,42	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	789.943,42	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	285.131,37	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	12/02/21	15/12/35	MS 306	319.465,36	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	992.558,79	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	496.279,40	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	10/02/21	15/12/31	METRORIO	486.140,81	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	15/12/21	15/11/36	ITAPOA T	410.628,86	-	AA.br	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	26/02/24	26/02/24	01/03/27	BTG PACT	11.285.184,41	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	05/03/24	05/03/24	24/08/26	B VOTORA	6.914.234,23	brAAA	AA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	12/03/24	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	2.086.788,46	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/03/24	23/06/23	15/05/43	IGUA RJ	1.246.850,65	brAAA+	-	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	05/04/24	05/04/24	06/04/26	PSA	6.814.772,88	-	AAA.br	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	16/05/24	16/05/24	18/05/26	BANSICRE	3.409.430,41	brAAA	AAA.br	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/05/24	10/11/21	30/10/31	DASA	1.659.375,04	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/06/24	18/06/24	10/06/29	OURO VER	626.087,54	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	02/07/24	21/09/23	15/09/31	ELETROB	3.063.598,62	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	03/07/24	26/06/24	15/06/34	FERROBAN	2.376.668,58	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	17/07/24	17/07/24	15/07/34	CSMG	3.017.974,68	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/07/24	13/06/24	15/05/36	CELG	2.834.769,37	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/24	31/07/24	15/07/34	CELESCD	2.347.622,01	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	05/08/24	01/08/24	15/07/27	CEA MODA	1.443.984,20	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/08/24	06/08/24	15/03/43	BARUERI	2.011.356,63	brAA-	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	06/08/24	01/08/24	11/06/30	VIX LOGI	2.186.037,36	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/08/24	05/06/24	15/05/34	JALLES M	2.965.992,01	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	08/08/24	06/08/24	15/03/43	BARUERI	1.289.331,18	brAA-	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/08/24	13/08/24	15/07/31	BRASIL T	2.206.929,73	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/08/24	19/06/24	15/06/31	CHESF	2.955.417,52	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/08/24	09/05/24	15/04/34	ENEVA	1.939.687,48	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	30/08/24	30/08/24	15/08/41	ROD TRIA	2.501.848,28	-	-	A+(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	VERDECARD FIDC SN6	817.062,68	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	FIDC VERDECARD SN8	1.375.637,34	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	RB CAP CREDIT AL SN3	504.226,24	brAA-(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	INSS CONS PDL I FIDC	468.528,83	-	-	AAAsf(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	-	-	-	DRIVER SIX FIDC SN	674.302,42	-	AAA.br	-

Observação: Em agosto 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** **5.079.118.993,30**

Tópico do Enquadramento	Limite	Aplicação Atual	Valor Limite	% Aplicado	Status
% do Segmento RF/PL PLANO	100,00%	4.448.689.581,61	5.079.118.993,30	87,59%	Enquadrado
% do PL em Títulos de Emissão do Tesouro Nacional e/ou do BACEN	100,00%	3.639.360.369,18	5.079.118.993,30	71,65%	Enquadrado
% do PL em Títulos RF1, exceto títulos do Tesouro Nacional	80,00%	809.329.212,43	4.063.295.255,19	15,93%	Enquadrado
% do PL em FIDC	20,00%	Verificar Rel. de Diversificação de FIDC's	1.015.823.813,80	0,00%	Enquadrado
% do PL em uma mesma pessoa jurídica não-financeira	10,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Não Financ.	507.911.906,90	0,00%	Enquadrado
% do PL em Instituições Financeiras	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Financ.	1.269.779.748,33	0,00%	Enquadrado
% de uma mesma Série de Debêntures	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Debêntures	1.269.779.748,33	0,00%	Enquadrado
% do PL em RV	70,00%	521.062.320,42	3.555.383.234,76	10,26%	Enquadrado
% do capital votante de uma empresa	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação RV	1.269.779.748,33	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Imobiliários	20,00%	78.236.963,75	1.015.823.813,80	1,54%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Empréstimos	15,00%	27.572.304,19	761.867.879,27	0,54%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Estruturados	20,00%	0,00	1.015.823.813,80	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos no Exterior	10,00%	0,00	507.911.906,90	0,00%	Enquadrado

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

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2024



## 6.2. Relatório de Túnel de Preços

### RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE AGOSTO DE 2024 À 30 DE AGOSTO DE 2024



FIM EMB I A

DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	FONTE ANBIMA				DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
								TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.			
02/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2024	Compra	7,0998%	7,2089%	5,8006%	8,7396%	-0,1091%	NÃO	
02/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2024	Compra	7,1991%	7,2089%	5,8006%	8,7396%	-0,0098%	NÃO	
05/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/03/2026	Venda	0,0167%	0,0164%	-0,0066%	0,0297%	0,0003%	NÃO	
05/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/03/2026	Venda	0,0167%	0,0164%	-0,0066%	0,0297%	0,0003%	NÃO	
05/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/03/2026	Venda	0,0167%	0,0164%	-0,0066%	0,0297%	0,0003%	NÃO	
05/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/03/2026	Venda	0,0167%	0,0164%	-0,0066%	0,0297%	0,0003%	NÃO	
05/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/03/2027	Venda	0,0762%	0,0756%	0,0483%	0,0819%	0,0006%	NÃO	
05/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/03/2027	Venda	0,0762%	0,0756%	0,0483%	0,0819%	0,0006%	NÃO	
05/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/03/2027	Venda	0,0762%	0,0756%	0,0483%	0,0819%	0,0006%	NÃO	
05/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/03/2027	Venda	0,0762%	0,0756%	0,0483%	0,0819%	0,0006%	NÃO	
05/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/03/2027	Venda	0,0762%	0,0756%	0,0483%	0,0819%	0,0006%	NÃO	
05/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/03/2027	Venda	0,0762%	0,0756%	0,0483%	0,0819%	0,0006%	NÃO	
05/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/03/2027	Venda	0,0762%	0,0756%	0,0483%	0,0819%	0,0006%	NÃO	
05/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/03/2027	Venda	0,0762%	0,0756%	0,0483%	0,0819%	0,0006%	NÃO	
05/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2024	Compra	7,1017%	7,2910%	5,9178%	8,8333%	-0,1893%	NÃO	
05/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2024	Compra	7,1510%	7,2910%	5,9178%	8,8333%	-0,1400%	NÃO	
05/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2024	Compra	7,2003%	7,2910%	5,9178%	8,8333%	-0,0907%	NÃO	
05/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2024	Compra	7,1017%	7,2910%	5,9178%	8,8333%	-0,1893%	NÃO	
05/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2024	Compra	7,1017%	7,2910%	5,9178%	8,8333%	-0,1893%	NÃO	
06/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/03/2027	Venda	0,0756%	0,0752%	0,0470%	0,0812%	0,0004%	NÃO	
06/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/03/2027	Venda	0,0756%	0,0752%	0,0470%	0,0812%	0,0004%	NÃO	
06/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2024	Compra	7,3524%	7,2162%	5,9885%	9,0081%	0,1362%	NÃO	
06/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2024	Compra	7,2998%	7,2162%	5,9885%	9,0081%	0,0836%	NÃO	
06/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2024	Compra	7,2021%	7,2162%	5,9885%	9,0081%	-0,0141%	NÃO	
06/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2024	Compra	7,2509%	7,2162%	5,9885%	9,0081%	0,0347%	NÃO	
12/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,0405%	6,0017%	5,8765%	6,1363%	0,0388%	NÃO	
13/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	6,0095%	5,9716%	5,8553%	6,1150%	0,0379%	NÃO	
13/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	6,0145%	5,9716%	5,8553%	6,1150%	0,0429%	NÃO	
22/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	6,1358%	6,1480%	5,9887%	6,2486%	-0,0122%	NÃO	
23/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1377%	6,1140%	6,0009%	6,2608%	0,0237%	NÃO	
23/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1377%	6,1140%	6,0009%	6,2608%	0,0237%	NÃO	
23/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1377%	6,1140%	6,0009%	6,2608%	0,0237%	NÃO	
23/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1377%	6,1140%	6,0009%	6,2608%	0,0237%	NÃO	
23/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1377%	6,1140%	6,0009%	6,2608%	0,0237%	NÃO	
23/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1377%	6,1140%	6,0009%	6,2608%	0,0237%	NÃO	
23/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1377%	6,1140%	6,0009%	6,2608%	0,0237%	NÃO	
23/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1377%	6,1140%	6,0009%	6,2608%	0,0237%	NÃO	
23/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1377%	6,1140%	6,0009%	6,2608%	0,0237%	NÃO	
23/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1377%	6,1140%	6,0009%	6,2608%	0,0237%	NÃO	
23/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1377%	6,1140%	6,0009%	6,2608%	0,0237%	NÃO	
23/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1377%	6,1140%	6,0009%	6,2608%	0,0237%	NÃO	
23/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1377%	6,1140%	6,0009%	6,2608%	0,0237%	NÃO	
23/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1377%	6,1140%	6,0009%	6,2608%	0,0237%	NÃO	
23/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1377%	6,1140%	6,0009%	6,2608%	0,0237%	NÃO	
23/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1377%	6,1140%	6,0009%	6,2608%	0,0237%	NÃO	
23/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1377%	6,1140%	6,0009%	6,2608%	0,0237%	NÃO	
23/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1377%	6,1140%	6,0009%	6,2608%	0,0237%	NÃO	
23/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1377%	6,1140%	6,0009%	6,2608%	0,0237%	NÃO	
26/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1505%	6,1516%	5,9671%	6,2268%	-0,0011%	NÃO	
26/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1505%	6,1516%	5,9671%	6,2268%	-0,0011%	NÃO	
26/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1305%	6,1516%	5,9671%	6,2268%	-0,0211%	NÃO	
26/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1505%	6,1516%	5,9671%	6,2268%	-0,0011%	NÃO	
26/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1505%	6,1516%	5,9671%	6,2268%	-0,0011%	NÃO	
26/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1305%	6,1516%	5,9671%	6,2268%	-0,0211%	NÃO	
26/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1505%	6,1516%	5,9671%	6,2268%	-0,0011%	NÃO	
26/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1505%	6,1516%	5,9671%	6,2268%	-0,0011%	NÃO	
26/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1505%	6,1516%	5,9671%	6,2268%	-0,0011%	NÃO	
26/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1505%	6,1516%	5,9671%	6,2268%	-0,0011%	NÃO	
26/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1505%	6,1516%	5,9671%	6,2268%	-0,0011%	NÃO	
26/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1505%	6,1516%	5,9671%	6,2268%	-0,0011%	NÃO	
26/08/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1505%	6,1516%	5,9671%	6,2268%	-0,0011%	NÃO	

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2024

## RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE AGOSTO DE 2024 À 30 DE AGOSTO DE 2024



### FIR FEM II A CRED PRIV

DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	FONTE ANBIMA					FORA DO TÚNEL
							TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	
05/08/2024	FIR FEM II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2027	Compra	6,1036%	6,1104%	5,9317%	6,3131%	-0,0068%	NÃO
15/08/2024	FIR FEM II A CRED PRIV	BNP	LIQUIDEZ	NTN-B	15/05/2025	Compra	6,1329%	6,2169%	5,7213%	6,4727%	-0,0840%	NÃO
15/08/2024	FIR FEM II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2026	Compra	6,3914%	6,4333%	6,0787%	6,5097%	-0,0419%	NÃO
15/08/2024	FIR FEM II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2027	Compra	6,2282%	6,2772%	5,9508%	6,3336%	-0,0490%	NÃO
15/08/2024	FIR FEM II A CRED PRIV	BNP	CONCORDI	NTN-B	15/08/2028	Compra	6,2317%	6,2440%	5,9807%	6,3332%	-0,0123%	NÃO
15/08/2024	FIR FEM II A CRED PRIV	BNP	TULL PRE	NTN-B	15/08/2028	Compra	6,2416%	6,2440%	5,9807%	6,3332%	-0,0024%	NÃO
15/08/2024	FIR FEM II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2028	Compra	6,2017%	6,2440%	5,9807%	6,3332%	-0,0423%	NÃO

## RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE AGOSTO DE 2024 À 30 DE AGOSTO DE 2024



### EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA

DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	FONTE ANBIMA					FORA DO TÚNEL
							TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	
26/08/2024	EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA	ITAU UNI	LIQUIDEZ	LFT	01/09/2027	Compra	0,0948%	0,0943%	0,0766%	0,0996%	0,0005%	NÃO
26/08/2024	EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA	ITAU UNI	XP CCTVM	NTN-B	15/05/2025	Compra	6,3109%	6,3523%	6,0357%	6,7559%	-0,0414%	NÃO
26/08/2024	EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA	ITAU UNI	LIQUIDEZ	NTN-B	15/08/2026	Compra	6,5248%	6,5489%	6,3333%	6,7590%	-0,0241%	NÃO
26/08/2024	EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA	ITAU UNI	XP CCTVM	NTN-B	15/05/2027	Compra	6,3188%	6,3400%	6,1702%	6,5358%	-0,0212%	NÃO
26/08/2024	EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA	ITAU UNI	LIQUIDEZ	NTN-B	15/08/2028	Compra	6,2721%	6,2929%	6,1362%	6,4746%	-0,0208%	NÃO
27/08/2024	EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA	ITAU UNI	LIQUIDEZ	LFT	01/09/2027	Venda	0,0943%	0,0886%	0,0752%	0,0989%	0,0057%	NÃO

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2024

## RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE AGOSTO DE 2024 À 30 DE AGOSTO 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
01-08-24	FIA RVA EMB II	Venda	BBAS3	26,52	5.400,00	143.202,50	26,22	26,41	26,72	41.635,00
01-08-24	FIA RVA EMB II	Compra	BBDC4	12,60	46.600,00	587.114,88	12,45	12,59	12,68	58.588,00
01-08-24	FIA RVA EMB II	Venda	CMIG4	10,89	26.000,00	283.062,89	10,80	10,87	10,94	17.225,00
01-08-24	FIA RVA EMB II	Venda	CXSE3	14,63	18.800,00	275.084,53	14,48	14,64	14,76	10.782,00
01-08-24	FIA RVA EMB II	Venda	KLBN11	21,99	12.800,00	281.495,28	21,80	21,96	22,14	16.168,00
01-08-24	FIA RVA EMB II	Venda	MIRFG3	11,50	8.200,00	94.287,23	11,34	11,63	11,85	15.070,00
01-08-24	FIA RVA EMB II	Venda	NTCO3	14,82	18.300,00	271.117,88	14,66	14,74	15,06	9.553,00
01-08-24	FIA RVA EMB II	Compra	S BSP3	89,98	8.000,00	719.874,57	88,58	89,74	90,48	22.195,00
01-08-24	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	61,19	1.200,00	73.423,43	60,22	60,69	61,87	122.593,00
01-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	AZZA3	5,94	1,00	5,94	48,65	49,97	50,76	3.060,00
01-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	26,40	700,00	18.479,94	26,22	26,41	26,72	41.635,00
01-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	BBDC4	12,60	14.800,00	186.460,96	12,45	12,59	12,68	58.588,00
01-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	35,15	1.100,00	38.663,12	34,96	35,15	35,66	12.179,00
01-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	33,09	1.700,00	56.257,06	32,69	33,00	33,32	28.316,00
01-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	40,07	3.700,00	148.269,88	39,66	40,06	40,39	21.476,00
01-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	33,02	3.400,00	112.278,99	32,57	33,03	33,25	15.657,00
01-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,20	17.800,00	74.819,87	4,10	4,20	4,29	28.637,00
01-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	21,23	3.000,00	63.679,19	20,97	21,21	21,52	8.298,00
01-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	21,15	1.200,00	25.380,00	20,97	21,21	21,52	8.298,00
01-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	21,18	1.400,00	29.647,61	20,97	21,21	21,52	8.298,00
01-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	21,16	1.000,00	21.160,00	20,97	21,21	21,52	8.298,00
01-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,05	3.700,00	37.182,04	9,90	10,00	10,20	25.310,00
01-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	14,75	2.500,00	36.875,97	14,66	14,74	15,06	9.553,00
01-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	22,85	700,00	15.995,05	22,30	22,79	22,95	28.229,00
01-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	22,86	5.000,00	114.296,77	22,30	22,79	22,95	28.229,00
01-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	44,07	2.600,00	114.573,37	43,45	43,96	44,76	28.330,00
01-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	S BSP3	89,72	1.000,00	89.721,62	88,58	89,74	90,48	22.195,00
01-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	21,12	1.100,00	23.233,92	20,64	21,01	21,46	11.692,00
01-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	20,98	1.800,00	37.767,29	20,64	21,01	21,46	11.692,00
01-08-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	RBRL11	81,00	4.950,00	400.950,00	80,93	81,21	82,50	1.126,00
01-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	AZZA3	51,90	874,00	45.364,93	48,65	49,97	50,76	3.060,00
02-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	21,96	200,00	4.391,26	21,88	22,10	22,48	12.049,00
02-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	22,02	1.300,00	28.624,61	21,88	22,10	22,48	12.049,00
02-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	51,17	400,00	20.469,52	49,85	50,83	51,45	5.553,00
02-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	26,24	2.300,00	60.351,24	26,06	26,23	26,59	30.205,00
02-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	BBDC4	12,62	14.800,00	186.703,27	12,52	12,62	12,75	53.953,00
02-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	BBDC4	12,61	1.800,00	22.690,27	12,52	12,62	12,75	53.953,00
02-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	34,96	400,00	13.985,30	34,72	34,94	35,37	11.264,00
02-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	33,10	1.500,00	49.656,91	32,65	33,09	33,68	32.893,00
02-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL E3	9,06	1.900,00	17.208,94	9,01	9,10	9,23	3.915,00
02-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL E6	10,13	1.600,00	16.212,00	10,11	10,20	10,38	12.984,00
02-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	38,61	800,00	30.889,01	38,35	38,83	40,40	27.598,00
02-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,59	1.600,00	20.150,41	12,48	12,56	12,71	13.213,00
02-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	33,18	3.600,00	119.458,64	32,95	33,21	33,61	20.675,00
02-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	33,25	1.500,00	49.875,00	32,95	33,21	33,61	20.675,00
02-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	15,27	4.200,00	64.144,51	15,16	15,29	15,52	9.786,00
02-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	15,26	1.400,00	21.367,76	15,16	15,29	15,52	9.786,00
02-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,28	14.400,00	61.671,66	4,18	4,25	4,31	34.939,00
02-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,27	8.800,00	37.611,48	4,18	4,25	4,31	34.939,00
02-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	21,21	3.000,00	63.628,03	21,10	21,28	21,61	8.243,00
02-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	9,86	3.800,00	37.467,16	9,80	9,86	10,01	24.662,00
02-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	14,84	1.000,00	14.841,62	14,74	14,89	15,17	9.173,00
02-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	46,06	500,00	23.028,94	45,82	46,30	48,01	34.193,00
02-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	23,45	600,00	14.071,69	22,77	23,29	23,52	26.434,00
02-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	23,23	3.200,00	74.326,62	22,77	23,29	23,52	26.434,00
02-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	23,21	4.200,00	97.494,25	22,77	23,29	23,52	26.434,00
02-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	44,71	3.700,00	165.424,61	43,55	44,64	45,08	33.163,00
02-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	20,60	1.700,00	35.027,34	20,35	20,79	21,15	10.268,00
02-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	20,58	1.600,00	32.933,78	20,35	20,79	21,15	10.268,00
02-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	53,12	2.800,00	148.737,56	52,89	53,20	54,06	21.659,00
02-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	53,20	1.000,00	53.195,43	52,89	53,20	54,06	21.659,00
02-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	10,73	1.100,00	11.805,00	10,53	10,70	10,93	8.767,00
02-08-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPL E3	9,08	104,00	944,09	9,01	9,10	9,23	3.915,00
02-08-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPL E3	9,10	19,00	172,90	9,01	9,10	9,23	3.915,00
02-08-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPL E6	10,18	961,00	9.779,26	10,11	10,20	10,38	12.984,00
02-08-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPL E6	10,16	1.016,00	10.326,58	10,11	10,20	10,38	12.984,00
05-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	21,71	1.000,00	21.712,23	21,41	21,70	21,89	11.719,00
05-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	48,84	1.300,00	63.486,71	47,50	48,85	49,89	6.791,00
05-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	31,74	400,00	12.696,38	30,90	31,69	32,03	26.446,00
05-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	37,72	3.300,00	124.472,36	37,23	37,71	37,97	24.993,00
05-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,45	1.000,00	12.446,97	12,21	12,40	12,51	17.192,00
05-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	32,65	1.100,00	35.916,03	32,30	32,63	32,88	18.288,00
05-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	15,12	3.000,00	45.366,09	14,97	15,16	15,28	10.956,00
05-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,28	13.200,00	56.537,28	4,14	4,24	4,32	36.153,00
05-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	21,04	1.600,00	33.671,79	20,77	21,12	21,40	8.388,00
05-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	9,82	1.900,00	18.652,57	9,64	9,77	9,86	23.621,00
05-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	14,04	4.700,00	66.001,91	13,97	13,60	14,10	27.833,00
05-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	14,03	1.700,00	23.851,00	13,97	13,60	14,10	27.833,00
05-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	14,45	5.800,00	83.787,54	14,06	14,53	14,74	17.473,00
05-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	45,00	1.800,00	80.995,04	44,49	44,85	45,56	31.268,00
05-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	22,74	1.700,00	38.652,43	22,52	22,75	23,01	26.911,00
05-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	43,31	2.000,00	86.624,82	42,44	43,69	44,29	36.181,00
05-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT9	33,48	1.632,00	54.639,36	42,44	43,69	44,29	36.181,00
05-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	20,39	1.600,00	32.624,24	19,58	20,59	20,80	11.475,00
05-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	52,40	900,00	47.156,44	51,71	52,66	53,16	24.696,00
05-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	RENT9	33,48	75,00	2.511,00	42,44	43,69	44,29	36.181,00
06-08-24	FIA RVA EMB II	Venda	PRI03	43,70	2.400,00	104.886,65	43,25	43,72	44,39	26.636,00

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2024

## RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE AGOSTO DE 2024 À 30 DE AGOSTO 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
06-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	48,80	1.100,00	53.680,00	48,50	49,20	49,99	5.401,00
06-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBDC4	14,12	11.700,00	165.159,57	13,80	14,01	14,18	165.001,00
06-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBDC4	14,10	8.200,00	115.620,00	13,80	14,01	14,18	165.001,00
06-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	37,85	3.500,00	132.471,89	37,45	37,75	38,30	24.982,00
06-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,35	17.800,00	77.448,99	4,25	4,31	4,42	47.396,00
06-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	21,34	1.800,00	38.412,85	21,17	21,37	21,55	11.525,00
06-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	14,22	10.400,00	147.849,64	13,93	14,17	14,45	34.186,00
06-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	23,42	3.300,00	77.298,23	22,74	23,19	23,66	24.603,00
06-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	20,71	1.800,00	37.283,50	20,31	20,64	20,91	7.655,00
06-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	52,21	2.100,00	109.650,68	51,68	52,07	52,94	35.031,00
06-08-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLÉ3	9,13	4.611,00	42.107,54	8,96	9,06	9,19	4.168,00
06-08-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLÉ3	9,12	1.181,00	10.771,74	8,96	9,06	9,19	4.168,00
06-08-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLÉ6	10,17	1.433,00	14.573,61	10,01	10,14	10,18	14.058,00
06-08-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLÉ6	10,16	1.610,00	16.357,60	10,01	10,14	10,18	14.058,00
06-08-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLÉ6	10,15	846,00	8.590,52	10,01	10,14	10,18	14.058,00
06-08-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLÉ6	10,15	1.302,00	13.217,53	10,01	10,14	10,18	14.058,00
07-08-24	FIA RVA EMB II	Compra	LREN3	14,61	5.500,00	80.348,02	14,28	14,51	14,68	40.715,00
07-08-24	FIA RVA EMB II	Compra	NTCO3	15,46	3.300,00	51.015,07	15,16	15,56	15,81	15.558,00
07-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	50,43	400,00	20.171,00	49,90	50,66	51,61	4.473,00
07-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	50,58	500,00	25.290,03	49,90	50,66	51,61	4.473,00
07-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	33,40	1.200,00	40.085,12	32,41	33,19	33,55	28.215,00
07-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	37,75	2.000,00	75.508,00	37,48	37,76	38,00	19.684,00
07-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	37,73	1.800,00	67.909,72	37,48	37,76	38,00	19.684,00
07-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,86	1.900,00	24.433,00	12,76	12,85	12,93	12.976,00
07-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	44,55	1.300,00	57.914,50	44,13	44,55	45,04	8.640,00
07-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	44,48	4.400,00	195.695,09	44,13	44,55	45,04	8.640,00
07-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	44,44	2.900,00	128.877,57	44,13	44,55	45,04	8.640,00
07-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	32,93	3.000,00	98.786,59	32,61	32,99	33,17	17.938,00
07-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	15,16	2.500,00	37.908,57	15,04	15,17	15,31	9.956,00
07-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	15,16	2.300,00	34.857,97	15,04	15,17	15,31	9.956,00
07-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	17,91	700,00	12.537,00	17,83	17,96	18,14	6.795,00
07-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,40	15.500,00	68.138,00	4,29	4,34	4,41	43.968,00
07-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	21,65	1.700,00	36.797,49	21,47	21,76	21,99	10.794,00
07-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	21,80	4.000,00	87.216,04	21,47	21,76	21,99	10.794,00
07-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	10,02	5.200,00	52.081,66	9,91	10,01	10,13	21.246,00
07-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	14,50	7.800,00	113.116,23	14,28	14,51	14,68	40.715,00
07-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	15,53	1.200,00	18.639,44	15,16	15,56	15,81	15.558,00
07-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	15,57	1.300,00	20.243,00	15,16	15,56	15,81	15.558,00
07-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	44,66	900,00	40.195,64	44,16	44,84	45,39	28.395,00
07-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	23,30	3.100,00	72.222,74	23,18	23,34	23,61	14.132,00
07-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	19,85	900,00	17.863,00	19,74	19,93	20,28	3.871,00
07-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	47,53	13.600,00	646.460,02	45,50	47,58	48,82	54.642,00
07-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	47,46	3.700,00	175.597,18	45,50	47,58	48,82	54.642,00
07-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	SBSF3	90,56	2.500,00	226.395,11	89,80	91,09	91,98	17.289,00
07-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	SBSF3	90,25	1.700,00	153.425,00	89,80	91,09	91,98	17.289,00
07-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	21,47	2.200,00	47.231,77	20,60	21,43	21,65	8.601,00
07-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	52,16	2.200,00	114.743,46	51,33	52,24	52,77	22.788,00
07-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	52,02	2.000,00	104.037,37	51,33	52,24	52,77	22.788,00
07-08-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLÉ6	10,13	1.089,00	11.031,57	10,03	10,12	10,25	15.464,00
07-08-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLÉ6	10,13	324,00	3.282,12	10,03	10,12	10,25	15.464,00
07-08-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	TEPP11	88,18	5.600,00	494.358,49	88,00	88,24	89,10	1.557,00
08-08-24	FIA RVA EMB II	Venda	CMIG4	10,73	17.200,00	184.477,45	10,69	10,73	10,84	19.144,00
08-08-24	FIA RVA EMB II	Compra	TOTS3	28,49	16.300,00	464.460,35	27,41	28,25	28,74	21.571,00
08-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	51,00	900,00	45.901,19	50,22	51,10	51,59	4.038,00
08-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	50,85	300,00	15.255,00	50,22	51,10	51,59	4.038,00
08-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	36,30	5.500,00	199.650,00	35,00	35,93	36,36	15.105,00
08-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	45,20	8.000,00	361.593,46	44,42	45,37	45,87	17.966,00
08-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	45,00	2.600,00	117.000,00	44,42	45,37	45,87	17.966,00
08-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	33,41	2.800,00	93.557,08	33,12	33,40	33,59	13.234,00
08-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	18,10	5.300,00	95.930,00	17,85	18,09	18,26	5.797,00
08-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,46	51.600,00	230.235,40	4,39	4,45	4,51	32.856,00
08-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	14,56	3.800,00	55.335,70	14,31	14,57	14,91	37.408,00
08-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	14,50	1.200,00	17.400,00	14,31	14,57	14,91	37.408,00
08-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	15,89	400,00	6.357,45	15,74	15,92	16,10	10.398,00
08-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	48,87	500,00	24.433,03	47,93	48,59	49,19	36.289,00
08-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	48,56	2.200,00	106.823,92	47,93	48,59	49,19	36.289,00
08-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	49,00	900,00	44.100,00	47,93	48,59	49,19	36.289,00
08-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	SBSF3	92,38	2.200,00	203.235,07	91,41	92,42	93,29	21.885,00
08-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	53,37	2.500,00	133.436,42	51,72	53,46	54,08	33.149,00
08-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	45,78	440,00	20.142,70	44,42	45,37	45,87	17.966,00
08-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	45,77	538,00	24.623,00	44,42	45,37	45,87	17.966,00
08-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	45,75	195,00	8.921,69	44,42	45,37	45,87	17.966,00
08-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	22,53	332,00	7.480,07	22,12	22,49	23,05	40.149,00
08-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	22,50	1.931,00	43.446,14	22,12	22,49	23,05	40.149,00
08-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	22,51	2.326,00	52.362,45	22,12	22,49	23,05	40.149,00
08-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	22,45	3.122,00	70.073,29	22,12	22,49	23,05	40.149,00
08-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	22,66	234,00	5.301,83	22,12	22,49	23,05	40.149,00
08-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	22,55	232,00	5.230,94	22,12	22,49	23,05	40.149,00
08-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	22,54	1.711,00	38.566,81	22,12	22,49	23,05	40.149,00
09-08-24	FIA RVA EMB II	Venda	CEAB3	8,52	16.800,00	143.093,98	8,35	8,56	8,84	11.239,00
09-08-24	FIA RVA EMB II	Compra	LREN3	15,25	15.100,00	230.235,56	14,95	15,35	15,66	46.983,00
09-08-24	FIA RVA EMB II	Compra	TOTS3	28,91	2.200,00	63.600,60	28,40	29,24	29,67	19.339,00
09-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	23,01	1.900,00	43.727,63	22,65	22,94	23,29	15.247,00
09-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	52,87	500,00	26.436,46	51,58	53,29	54,52	12.309,00
09-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	53,72	600,00	32.234,77	51,58	53,29	54,52	12.309,00
09-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	26,53	800,00	21.223,87	26,25	26,50	26,63	34.906,00
09-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBDC4	14,60	7.600,00	110.976,25	14,23	14,51	14,69	81.805,00



# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2024

## RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE AGOSTO DE 2024 À 30 DE AGOSTO 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
09-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	36,15	1.000,00	36.147,14	35,73	36,02	36,30	16.559,00
09-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	34,59	3.100,00	107.223,92	34,32	34,56	34,95	22.393,00
09-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLF3	9,26	2.200,00	20.376,38	9,07	9,19	9,31	8.930,00
09-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLF3	9,27	3.300,00	30.602,98	9,07	9,19	9,31	8.930,00
09-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLF6	10,25	4.300,00	44.093,98	10,03	10,18	10,30	21.704,00
09-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLF6	10,21	3.500,00	35.735,00	10,03	10,18	10,30	21.704,00
09-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLF6	10,27	2.900,00	29.789,71	10,03	10,18	10,30	21.704,00
09-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	40,00	400,00	16.000,00	38,78	39,74	40,11	28.652,00
09-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	39,98	700,00	27.987,57	38,78	39,74	40,11	28.652,00
09-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	13,23	1.800,00	23.806,22	13,06	13,17	13,26	13.132,00
09-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	46,63	1.000,00	46.630,17	46,06	46,64	46,94	12.293,00
09-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	46,67	900,00	42.002,80	46,06	46,64	46,94	12.293,00
09-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	34,35	5.700,00	195.805,08	33,59	34,38	34,74	26.167,00
09-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	34,60	800,00	27.681,06	33,59	34,38	34,74	26.167,00
09-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	15,85	300,00	4.755,00	15,50	15,63	16,00	15.216,00
09-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	15,92	1.800,00	28.652,73	15,50	15,63	16,00	15.216,00
09-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,40	44.000,00	193.624,22	4,21	4,41	4,59	89.442,00
09-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,43	2.600,00	11.505,12	4,21	4,41	4,59	89.442,00
09-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	22,73	2.800,00	63.653,16	22,21	22,64	22,88	10.559,00
09-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	10,32	3.600,00	37.138,62	10,10	10,26	10,35	24.516,00
09-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	15,38	6.700,00	103.031,50	14,95	15,35	15,66	46.983,00
09-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	12,88	2.700,00	34.771,40	12,21	12,83	13,25	43.481,00
09-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	16,60	2.900,00	48.141,21	16,00	16,44	16,73	16.135,00
09-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	16,63	1.700,00	28.271,82	16,00	16,44	16,73	16.135,00
09-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRIQ3	48,21	600,00	28.925,54	47,70	48,37	49,15	38.096,00
09-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	23,47	2.300,00	53.983,08	23,22	23,50	24,10	28.731,00
09-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	21,34	1.100,00	23.473,16	20,78	21,33	21,67	10.921,00
09-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	49,25	800,00	39.396,53	48,47	49,02	49,55	22.257,00
09-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	22,97	1.700,00	39.043,07	22,67	22,93	23,19	11.568,00
09-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	54,31	800,00	43.447,41	54,01	54,53	55,69	55.592,00
09-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	54,29	1.400,00	76.004,29	54,01	54,53	55,69	55.592,00
09-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	26,43	7.000,00	185.035,72	25,35	26,30	26,73	35.334,00
09-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	26,36	100,00	2.636,45	25,35	26,30	26,73	35.334,00
09-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	10,21	3.700,00	37.788,47	9,88	10,25	10,60	19.874,00
09-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	10,36	1.700,00	17.620,43	9,88	10,25	10,60	19.874,00
09-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	46,66	9.883,00	461.126,87	46,06	46,64	46,94	12.293,00
09-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	46,40	394,00	18.281,61	46,06	46,64	46,94	12.293,00
09-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	46,72	40,00	1.868,83	46,06	46,64	46,94	12.293,00
09-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	46,70	3.663,00	171.079,00	46,06	46,64	46,94	12.293,00
09-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	46,70	748,00	34.928,19	46,06	46,64	46,94	12.293,00
09-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	46,65	611,00	28.502,21	46,06	46,64	46,94	12.293,00
09-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	46,28	157,00	7.265,98	46,06	46,64	46,94	12.293,00
09-08-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	TEPP11	88,05	1.923,00	169.312,99	87,85	88,12	88,74	1.880,00
12-08-24	FIA RVA EMB II	Venda	CEAB3	8,95	32.700,00	292.648,00	8,57	9,05	9,39	7.331,00
12-08-24	FIA RVA EMB II	Compra	MULT3	26,73	18.200,00	486.557,09	26,24	26,58	26,82	21.080,00
12-08-24	FIA RVA EMB II	Compra	RAIL3	23,54	5.300,00	124.752,00	22,86	23,28	23,93	28.245,00
12-08-24	FIA RVA EMB II	Compra	RDOR3	29,91	2.100,00	62.801,00	29,35	29,72	30,29	16.217,00
12-08-24	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	56,87	6.300,00	358.263,94	56,52	56,76	57,11	53.443,00
12-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	23,10	1.700,00	39.263,46	23,00	23,12	23,38	12.636,00
12-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	53,87	1.100,00	59.257,65	53,02	53,96	54,85	5.045,00
12-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	53,74	500,00	26.868,15	53,02	53,96	54,85	5.045,00
12-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	27,04	700,00	18.926,88	26,55	26,94	27,12	50.323,00
12-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	BBDC4	14,72	1.400,00	20.604,69	14,56	14,69	14,74	45.680,00
12-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	36,63	1.700,00	62.279,38	36,23	36,61	36,77	15.757,00
12-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	35,13	1.600,00	56.208,00	34,72	35,06	35,29	23.166,00
12-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	35,08	4.300,00	150.859,44	34,72	35,06	35,29	23.166,00
12-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLF3	9,26	2.100,00	19.441,51	9,20	9,27	9,33	7.077,00
12-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLF3	9,26	2.300,00	21.292,30	9,20	9,27	9,33	7.077,00
12-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLF6	10,27	8.600,00	88.357,65	10,21	10,28	10,32	14.505,00
12-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLF6	10,28	1.900,00	19.541,28	10,21	10,28	10,32	14.505,00
12-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	39,50	600,00	23.701,49	39,26	39,54	40,35	16.967,00
12-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	13,17	4.100,00	53.990,00	13,04	13,15	13,39	17.053,00
12-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	47,08	1.800,00	84.745,18	46,68	47,02	47,27	14.927,00
12-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	15,82	1.900,00	30.067,27	15,60	15,68	16,03	9.245,00
12-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	18,38	1.000,00	18.384,00	18,27	18,43	18,67	4.925,00
12-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,34	27.400,00	118.845,11	4,28	4,38	4,52	32.244,00
12-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,33	4.800,00	20.783,07	4,28	4,38	4,52	32.244,00
12-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	22,92	3.000,00	68.748,71	22,71	22,87	22,99	10.367,00
12-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	10,39	3.700,00	38.453,42	10,32	10,38	10,42	30.213,00
12-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	15,73	11.200,00	176.211,76	15,30	15,67	15,91	28.337,00
12-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	13,63	3.800,00	51.808,90	12,95	13,35	13,84	33.957,00
12-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	16,65	2.100,00	34.969,34	16,34	16,52	16,94	16.222,00
12-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRIQ3	48,30	1.000,00	48.302,69	47,71	48,46	48,89	23.107,00
12-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	23,07	2.300,00	53.052,86	22,86	23,28	23,93	28.245,00
12-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	21,67	3.900,00	84.500,23	21,45	21,66	21,88	7.917,00
12-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	49,50	900,00	44.545,74	48,98	49,47	49,85	34.441,00
12-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	22,80	1.800,00	41.048,74	22,56	22,75	23,04	8.491,00
12-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	54,34	1.800,00	97.817,05	53,81	54,30	54,93	27.686,00
12-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	54,27	1.300,00	70.554,83	53,81	54,30	54,93	27.686,00
12-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	47,03	568,00	26.710,74	46,68	47,02	47,27	14.927,00
12-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	47,04	574,00	27.000,99	46,68	47,02	47,27	14.927,00
12-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	47,09	711,00	33.481,82	46,68	47,02	47,27	14.927,00
12-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	47,13	1.722,00	81.163,60	46,68	47,02	47,27	14.927,00
12-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	47,12	1.154,00	54.379,16	46,68	47,02	47,27	14.927,00
12-08-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	EVBI11	9,99	42,00	419,69	9,97	10,00	10,03	57,00
12-08-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	TEPP11	88,09	8.355,00	736.001,02	88,00	88,16	88,69	1.856,00
13-08-24	FIA RVA EMB II	Compra	B3SA3	12,59	28.100,00	353.779,00	12,24	12,52	12,64	47.567,00

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2024

## RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE AGOSTO DE 2024 À 30 DE AGOSTO 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
13-08-24	FIA RVA EMB II	Venda	GOAU4	10,14	33.400,00	338.583,36	10,08	10,15	10,24	12.014,00
13-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	AZZA3	54,61	100,00	5.461,00	53,64	54,35	54,90	5.473,00
13-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	AZZA3	54,59	400,00	21.837,75	53,64	54,35	54,90	5.473,00
13-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBDC4	14,91	6.600,00	98.425,36	14,71	14,89	14,97	43.294,00
13-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	36,93	2.700,00	99.703,64	36,76	36,97	37,17	15.886,00
13-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	35,48	5.600,00	198.690,43	35,07	35,52	35,75	34.445,00
13-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	46,18	2.200,00	101.606,12	45,91	46,26	46,53	13.953,00
13-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	35,01	2.800,00	98.020,07	34,72	34,95	35,14	24.341,00
13-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	15,86	2.300,00	36.476,01	15,74	15,85	15,93	10.257,00
13-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	17,74	600,00	10.646,36	17,66	17,94	18,50	8.970,00
13-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	17,86	1.700,00	30.357,73	17,66	17,94	18,50	8.970,00
13-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,58	11.200,00	118.521,46	10,40	10,55	10,65	44.720,00
13-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	15,00	5.200,00	78.000,00	14,23	14,82	15,99	59.400,00
13-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	14,74	29.200,00	430.292,63	14,23	14,82	15,99	59.400,00
13-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	27,03	2.200,00	59.462,94	26,07	26,86	27,18	16.572,00
13-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	27,03	1.500,00	40.548,48	26,07	26,86	27,18	16.572,00
13-08-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	BPML11	85,75	1.196,00	102.559,52	85,14	85,89	88,99	867,00
13-08-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	EVBI11	9,96	3.264,00	32.511,13	9,90	9,96	10,02	66,00
13-08-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	MALL11	107,48	9.304,00	999.993,92	107,10	107,46	107,81	4.696,00
13-08-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	MAXR11	78,50	6.369,00	499.961,53	78,06	78,49	78,95	59,00
13-08-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	NEUW11	80,53	7,00	563,74	79,90	80,53	80,64	2,00
13-08-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	OULG11	29,99	1.781,00	53.409,69	29,49	29,98	30,69	61,00
13-08-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	PATC11	34,90	63,00	2.198,70	34,90	34,98	35,21	46,00
13-08-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	QAGR11	46,38	1.652,00	76.622,14	46,27	46,36	46,56	170,00
13-08-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	SARE11	40,19	3.334,00	133.994,46	40,01	40,22	40,52	664,00
13-08-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	TEPR11	88,00	35.445,00	3.119.330,01	87,99	88,03	89,10	3.048,00
13-08-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	XPRR11	18,35	7.003,00	128.505,58	18,28	18,44	18,98	1.592,00
14-08-24	FIA RVA EMB II	Venda	ITUB4	36,53	3.300,00	120.549,46	35,59	36,44	36,78	72.859,00
14-08-24	FIA RVA EMB II	Compra	JBSS3	36,58	7.200,00	263.356,65	35,77	36,82	37,34	41.743,00
14-08-24	FIA RVA EMB II	Venda	NTCO3	14,94	2.500,00	37.360,81	14,72	15,03	15,44	35.721,00
14-08-24	FIA RVA EMB II	Compra	RENT3	40,00	5.500,00	220.000,00	39,40	40,83	42,98	119.994,00
14-08-24	FIA RVA EMB II	Venda	SBSF3	99,68	1.300,00	129.579,97	97,41	99,32	99,78	20.400,00
14-08-24	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	55,78	3.200,00	178.500,63	55,48	55,80	56,09	70.910,00
14-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	23,72	5.800,00	137.574,30	23,26	23,68	23,93	23.617,00
14-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	AZZA3	54,84	400,00	21.935,80	54,46	55,05	55,64	7.708,00
14-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	AZZA3	54,88	5.400,00	296.373,26	54,46	55,05	55,64	7.708,00
14-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	AZZA3	54,80	1.300,00	71.242,77	54,46	55,05	55,64	7.708,00
14-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBDC4	15,06	5.500,00	82.818,89	14,85	15,01	15,12	53.059,00
14-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBDC4	15,01	1.200,00	18.012,00	14,85	15,01	15,12	53.059,00
14-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	37,46	3.700,00	138.593,49	36,82	37,37	37,65	25.003,00
14-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	40,33	3.900,00	157.279,64	39,57	40,28	40,66	22.798,00
14-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	35,45	2.600,00	92.170,00	34,67	35,52	35,90	29.515,00
14-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	35,65	5.800,00	206.783,08	34,67	35,52	35,90	29.515,00
14-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	23,74	3.300,00	78.357,81	23,12	23,63	23,85	15.113,00
14-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,87	27.400,00	297.853,64	10,62	10,84	10,93	50.490,00
14-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,90	5.400,00	58.841,68	10,62	10,84	10,93	50.490,00
14-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	15,05	7.900,00	118.880,26	14,72	15,03	15,44	35.721,00
14-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	15,05	100,00	1.505,00	14,72	15,03	15,44	35.721,00
14-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	15,05	2.500,00	37.625,00	14,72	15,03	15,44	35.721,00
14-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	14,79	2.200,00	32.538,80	14,72	15,03	15,44	35.721,00
14-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	40,53	38.100,00	1.544.141,98	39,40	40,83	42,98	119.994,00
14-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	39,95	11.800,00	471.374,17	39,40	40,83	42,98	119.994,00
14-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	23,58	5.100,00	120.248,93	23,00	23,45	23,66	11.945,00
14-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CIEL3	5,82	59.073,00	343.804,86	5,80	5,81	5,83	5.277,00
15-08-24	FIA RVA EMB II	Venda	NTCO3	14,02	32.000,00	448.556,75	13,84	14,26	14,91	39.073,00
15-08-24	FIA RVA EMB II	Compra	RDR03	31,57	7.000,00	221.018,00	30,76	31,64	31,99	28.758,00
15-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	WEGE3	52,81	5.300,00	279.898,78	51,88	52,58	53,08	23.389,00
15-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBDC4	15,19	10.500,00	159.461,21	15,01	15,17	15,23	39.194,00
15-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	36,04	3.300,00	118.916,77	35,06	35,96	36,24	31.091,00
15-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	9,40	3.200,00	30.094,38	9,36	9,41	9,54	6.366,00
15-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	10,41	10.500,00	109.323,12	10,36	10,43	10,59	15.911,00
15-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	40,54	3.500,00	141.902,06	40,06	40,51	40,78	19.220,00
15-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	14,27	7.100,00	101.325,19	13,84	14,26	14,91	39.073,00
15-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	24,09	4.800,00	115.619,68	23,85	24,03	24,40	37.636,00
15-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	24,06	5.100,00	122.708,41	23,85	24,03	24,40	37.636,00
15-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	39,77	3.000,00	119.314,47	39,04	40,09	41,11	61.454,00
15-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	40,21	100,00	4.020,56	39,04	40,09	41,11	61.454,00
15-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	53,54	2.600,00	139.208,73	53,28	53,78	54,99	29.863,00
15-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	48,61	583,00	28.342,52	48,00	48,64	48,99	16.478,00
15-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	48,62	566,00	27.520,85	48,00	48,64	48,99	16.478,00
15-08-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	BMLC11	96,00	187,00	17.952,86	95,00	95,68	96,03	25,00
15-08-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	BPML11	86,29	2.937,00	253.425,13	85,50	86,04	87,15	2.918,00
15-08-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	CBOP11	27,99	65,00	1.819,35	27,99	28,03	28,06	11,00
15-08-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	EVBI11	9,98	300.001,00	2.994.010,02	9,97	9,98	10,03	40,00
15-08-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	FIGS11	54,82	7.025,00	385.077,26	54,38	54,71	55,24	360,00
15-08-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	OULG11	30,00	918,00	27.539,96	29,58	29,98	30,12	42,00
15-08-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	PATC11	34,83	1.108,00	38.596,94	34,62	34,83	35,05	83,00
15-08-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	RBRP11	56,45	474,00	26.756,68	56,19	56,38	56,71	2.691,00
15-08-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	SARE11	40,13	3.274,00	131.385,62	40,13	40,32	40,69	2.312,00
15-08-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	TRFX11	105,83	9.449,00	999.953,69	105,66	105,85	106,10	7.351,00
15-08-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	XPRR11	18,46	2.194,00	40.499,99	18,40	18,41	18,50	352,00
16-08-24	FIA RVA EMB II	Venda	BBDC4	14,97	29.100,00	435.627,00	14,85	14,99	15,29	56.536,00
16-08-24	FIA RVA EMB II	Compra	RENT3	42,48	6.600,00	280.365,60	39,58	41,34	42,60	68.976,00
16-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	36,47	4.100,00	149.541,33	35,93	36,44	36,96	39.518,00
16-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	36,75	800,00	29.400,00	35,93	36,44	36,96	39.518,00
16-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	40,58	2.400,00	97.392,36	40,31	40,61	41,24	22.451,00
16-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	13,51	5.100,00	68.884,94	13,45	13,53	13,71	27.289,00

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2024

## RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE AGOSTO DE 2024 À 30 DE AGOSTO 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
16-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	13,54	2.200,00	29.789,47	13,45	13,53	13,71	27.289,00
16-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	17,54	5.200,00	91.208,00	17,41	17,59	17,97	5.833,00
16-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,29	32.300,00	138.457,98	4,23	4,35	4,50	42.642,00
16-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	11,04	16.300,00	179.917,39	10,87	10,99	11,14	35.948,00
16-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	13,78	2.300,00	31.686,34	13,43	13,72	14,18	31.295,00
16-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	13,77	29.200,00	402.187,16	13,43	13,72	14,18	31.295,00
16-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	42,20	1.500,00	63.152,02	39,58	41,34	42,60	68.976,00
16-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	42,29	9.800,00	414.430,57	39,58	41,34	42,60	68.976,00
16-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	41,81	100,00	4.180,88	39,58	41,34	42,60	68.976,00
16-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	22,74	900,00	20.469,39	22,64	22,92	24,06	10.087,00
16-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	22,75	2.200,00	50.047,52	22,64	22,92	24,06	10.087,00
16-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	27,00	500,00	13.500,00	26,07	26,59	27,26	16.536,00
16-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	26,33	2.500,00	65.831,65	26,07	26,59	27,26	16.536,00
16-08-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	MALL11	108,24	2.035,00	220.268,40	107,80	108,27	108,60	3.613,00
19-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	23,47	800,00	18.773,43	23,11	23,38	23,60	18.189,00
19-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	29,04	3.400,00	98.721,70	28,31	28,96	29,17	44.803,00
19-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBDC4	15,71	16.400,00	257.677,74	15,10	15,62	15,88	69.011,00
19-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	36,47	500,00	18.233,28	35,72	36,27	36,58	41.126,00
19-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL66	10,55	1.300,00	13.713,19	10,40	10,51	10,60	23.315,00
19-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	41,49	4.300,00	178.395,20	40,29	41,16	41,68	32.809,00
19-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	13,75	15.400,00	211.805,02	13,42	13,72	13,88	25.757,00
19-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	50,19	400,00	20.074,00	48,66	49,75	50,45	27.619,00
19-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	49,72	2.500,00	124.298,76	48,66	49,75	50,45	27.619,00
19-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	35,45	1.100,00	38.996,10	34,71	35,40	35,74	34.332,00
19-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	15,94	900,00	14.346,90	15,77	15,89	15,99	12.803,00
19-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	17,40	6.700,00	116.580,89	17,28	17,40	17,59	4.772,00
19-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	17,40	2.500,00	43.492,48	17,28	17,40	17,59	4.772,00
19-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	17,45	700,00	12.213,03	17,28	17,40	17,59	4.772,00
19-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	17,35	1.200,00	20.820,00	17,28	17,40	17,59	4.772,00
19-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	23,35	1.400,00	32.690,25	23,13	23,30	23,45	12.573,00
19-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	11,03	19.700,00	217.387,97	10,93	11,01	11,08	49.347,00
19-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	13,95	2.800,00	39.060,00	13,79	14,03	14,24	27.145,00
19-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	14,02	1.800,00	25.232,61	13,79	14,03	14,24	27.145,00
19-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	13,95	9.900,00	138.074,88	13,79	14,03	14,24	27.145,00
19-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	13,96	4.000,00	55.823,15	13,79	14,03	14,24	27.145,00
19-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	23,57	1.200,00	28.289,74	23,19	23,50	23,67	33.029,00
19-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	44,25	500,00	22.125,00	42,66	43,61	44,25	57.470,00
19-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	23,45	700,00	16.413,00	22,64	23,38	23,62	14.303,00
19-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	54,97	800,00	43.976,30	54,41	55,04	55,30	19.827,00
19-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	26,27	2.100,00	55.173,14	25,88	26,30	26,59	12.415,00
19-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	10,54	1.800,00	18.970,00	9,73	10,33	10,69	12.715,00
19-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	10,38	3.800,00	39.441,70	9,73	10,33	10,69	12.715,00
19-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	50,04	1.398,00	69.953,23	48,66	49,75	50,45	27.619,00
19-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	50,21	377,00	18.930,22	48,66	49,75	50,45	27.619,00
19-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	49,35	2.398,00	118.349,44	48,66	49,75	50,45	27.619,00
20-08-24	FIA RVA EMB II	Compra	B3SA3	12,88	13.400,00	172.543,48	12,76	12,91	13,02	47.389,00
20-08-24	FIA RVA EMB II	Compra	DIRR3	29,36	2.300,00	67.521,59	29,12	29,29	29,59	4.487,00
20-08-24	FIA RVA EMB II	Venda	LREN3	16,49	6.400,00	105.513,92	16,27	16,59	17,03	29.517,00
20-08-24	FIA RVA EMB II	Compra	RDOR3	32,22	4.900,00	157.863,57	31,77	32,64	33,12	31.747,00
20-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	SBSP3	98,35	1.000,00	98.353,91	97,29	98,87	99,65	23.880,00
20-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	23,34	1.000,00	23.342,44	23,13	23,31	23,46	13.829,00
20-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	51,98	400,00	20.792,52	51,02	51,91	52,52	4.890,00
20-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	29,24	500,00	14.621,82	29,05	29,21	29,30	38.549,00
20-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	36,16	400,00	14.463,40	36,02	36,19	36,44	19.985,00
20-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	36,52	400,00	14.606,70	36,22	36,45	36,70	27.979,00
20-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL66	9,53	2.500,00	23.836,33	9,45	9,52	9,60	7.039,00
20-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL66	10,59	1.200,00	12.707,36	10,51	10,57	10,62	17.790,00
20-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	41,52	700,00	29.066,11	41,11	41,39	41,63	18.672,00
20-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	35,97	1.400,00	50.352,39	35,51	35,98	36,36	33.145,00
20-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	35,80	800,00	28.641,94	35,51	35,98	36,36	33.145,00
20-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	35,84	700,00	25.089,11	35,51	35,98	36,36	33.145,00
20-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	36,13	1.200,00	43.356,00	35,51	35,98	36,36	33.145,00
20-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	15,85	1.100,00	17.430,23	15,66	15,80	15,96	13.086,00
20-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	17,45	2.100,00	36.645,00	17,33	17,57	17,77	5.556,00
20-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	17,50	1.300,00	22.750,00	17,33	17,57	17,77	5.556,00
20-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	17,68	700,00	12.378,80	17,33	17,57	17,77	5.556,00
20-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,56	10.700,00	48.813,39	4,38	4,50	4,59	29.812,00
20-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	23,48	1.600,00	37.570,19	23,29	23,44	23,59	10.562,00
20-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	11,09	2.900,00	32.150,77	10,97	11,05	11,11	22.959,00
20-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	14,13	1.200,00	16.956,19	13,99	14,10	14,31	14.754,00
20-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRIQ3	48,03	600,00	28.820,16	47,32	47,76	48,20	19.938,00
20-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	23,70	1.300,00	30.807,03	23,39	23,65	23,78	28.061,00
20-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	21,72	800,00	17.374,05	21,45	21,66	21,93	6.538,00
20-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	43,04	700,00	30.130,32	42,81	43,29	44,08	34.808,00
20-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	23,41	1.000,00	23.407,92	23,23	23,43	23,72	10.653,00
20-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	55,93	800,00	44.741,54	54,88	55,68	56,13	21.629,00
20-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	26,56	600,00	15.933,57	26,21	26,58	26,88	11.715,00
20-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	26,80	300,00	8.040,00	26,21	26,58	26,88	11.715,00
20-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	10,30	5.100,00	52.508,85	10,20	10,34	10,66	9.613,00
21-08-24	FIA RVA EMB II	Venda	PETR3	40,81	9.000,00	367.261,60	40,67	41,00	41,57	20.372,00
21-08-24	FIA RVA EMB II	Compra	PETR4	38,32	5.000,00	191.587,35	37,94	38,28	38,79	56.898,00
21-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	35,67	2.900,00	103.457,06	35,41	35,67	36,14	25.965,00
21-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	35,62	1.400,00	49.867,68	35,41	35,67	36,14	25.965,00
21-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	35,66	2.900,00	103.418,59	35,41	35,67	36,14	25.965,00
21-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	15,88	3.800,00	60.345,13	15,74	15,86	16,07	11.718,00
21-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	17,55	500,00	8.777,31	17,32	17,51	17,71	6.599,00
21-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	17,47	4.700,00	82.101,49	17,32	17,50	17,71	6.599,00

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2024

## RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE AGOSTO DE 2024 À 30 DE AGOSTO 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
21-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	23,14	1.800,00	41.647,66	22,99	23,19	23,64	17.018,00
21-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	13,72	6.500,00	89.148,93	13,47	13,69	14,03	22.986,00
21-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	13,55	7.700,00	104.324,44	13,47	13,69	14,03	22.986,00
21-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	13,67	3.700,00	50.569,48	13,47	13,69	14,03	22.986,00
21-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	56,69	1.800,00	102.034,43	56,02	56,54	56,92	18.708,00
21-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	26,90	4.400,00	118.363,90	26,55	26,87	27,26	14.947,00
21-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	10,15	3.200,00	32.465,80	10,03	10,18	10,42	9.099,00
21-08-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	OULG11	29,84	6.085,00	181.576,40	29,84	29,84	30,99	640,00
22-08-24	FIA RVA EMB II	Venda	EQLT1	2,63	4.561,00	11.999,85	2,50	2,68	3,30	470,00
22-08-24	FIA RVA EMB II	Venda	EQLT1	2,61	157,00	409,77	2,50	2,68	3,30	470,00
22-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL3	9,54	6.100,00	58.181,39	9,48	9,54	9,67	9.790,00
22-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	41,08	1.400,00	57.518,50	40,81	41,03	41,31	20.223,00
22-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	17,33	1.900,00	32.928,83	17,22	17,35	17,69	4.517,00
22-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	26,59	3.000,00	79.759,15	26,32	26,66	26,99	11.902,00
22-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	9,88	7.000,00	69.184,28	9,68	9,84	10,15	8.198,00
23-08-24	FIA RVA EMB II	Venda	EQLT1	2,55	1,00	2,55	2,51	3,02	3,32	2.053,00
23-08-24	FIA RVA EMB II	Venda	EQLT1	2,60	498,00	1.294,80	2,51	3,02	3,32	2.053,00
23-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	23,93	3.400,00	81.355,75	23,00	23,77	24,00	18.720,00
23-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	23,84	1.700,00	40.528,00	23,00	23,77	24,00	18.720,00
23-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	23,93	1.100,00	26.326,59	23,00	23,77	24,00	18.720,00
23-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	AZZA3	52,47	300,00	15.740,72	50,27	52,20	52,95	5.579,00
23-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	36,58	400,00	14.632,59	36,05	36,45	36,73	16.291,00
23-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPL3	9,64	1.400,00	13.497,87	9,49	9,63	9,70	8.619,00
23-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPL6	10,75	1.300,00	13.980,52	10,61	10,72	10,79	12.120,00
23-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	42,03	1.900,00	79.857,00	40,85	41,77	42,20	24.272,00
23-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	41,80	800,00	33.437,88	40,85	41,77	42,20	24.272,00
23-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	13,76	1.700,00	23.388,67	13,39	13,69	13,85	15.615,00
23-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	13,81	4.400,00	60.764,00	13,39	13,69	13,85	15.615,00
23-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	35,48	800,00	28.382,09	34,68	35,25	35,58	22.873,00
23-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	16,17	1.500,00	24.254,54	15,93	16,13	16,29	13.466,00
23-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	17,55	700,00	12.287,80	17,19	17,37	17,69	6.674,00
23-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	17,25	5.200,00	89.699,85	17,19	17,37	17,69	6.674,00
23-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,48	9.800,00	43.907,32	4,35	4,46	4,52	31.258,00
23-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGT11	23,40	1.700,00	39.788,45	22,74	23,32	23,53	9.014,00
23-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGT11	23,43	1.700,00	39.831,24	22,74	23,32	23,53	9.014,00
23-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,99	1.900,00	20.882,24	10,92	11,00	11,08	27.648,00
23-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	13,78	1.400,00	19.287,36	13,34	13,68	13,88	18.502,00
23-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	47,29	400,00	18.914,62	46,91	47,17	47,60	17.565,00
23-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	23,69	1.400,00	33.169,17	23,23	23,60	23,77	18.835,00
23-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	42,44	100,00	4.243,88	41,54	42,31	42,85	35.377,00
23-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	42,45	1.900,00	80.660,84	41,54	42,31	42,85	35.377,00
23-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	22,97	2.000,00	45.939,83	22,51	23,15	23,51	13.881,00
23-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	56,20	900,00	50.583,19	55,65	56,14	56,53	19.021,00
23-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	27,17	5.200,00	141.278,97	26,65	27,18	27,45	11.297,00
26-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	23,91	1.300,00	31.089,39	23,74	23,90	24,04	8.077,00
26-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	51,85	600,00	31.110,00	51,54	52,19	52,95	4.107,00
26-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	51,99	400,00	20.794,51	51,54	52,19	52,95	4.107,00
26-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	36,76	1.400,00	51.469,64	36,48	36,82	37,27	15.286,00
26-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	41,88	4.800,00	201.013,29	41,51	41,86	42,13	16.781,00
26-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,48	18.100,00	81.168,03	4,44	4,48	4,52	17.493,00
26-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	23,20	2.600,00	60.307,21	23,06	23,23	23,45	6.842,00
26-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	14,00	2.900,00	40.589,26	13,63	14,00	14,21	12.496,00
26-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	13,90	1.400,00	19.454,31	13,63	14,00	14,21	12.496,00
26-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	42,30	1.500,00	63.444,53	42,00	42,35	42,85	18.080,00
26-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	23,33	500,00	11.665,63	23,11	23,22	23,52	5.414,00
26-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	23,30	1.200,00	27.960,00	23,11	23,22	23,52	5.414,00
26-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	55,31	2.600,00	143.805,45	55,06	55,46	56,38	22.937,00
26-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	26,83	1.500,00	40.245,11	26,65	26,92	27,65	10.038,00
27-08-24	FIA RVA EMB II	Compra	VALE3	59,74	11.000,00	657.102,19	59,09	59,73	60,14	67.553,00
27-08-24	FIA RVA EMB II	Venda	VBRR3	25,57	7.900,00	201.992,10	25,27	25,56	25,74	10.980,00
27-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	23,72	3.300,00	78.270,54	23,56	23,71	23,94	15.219,00
27-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	41,86	4.800,00	200.925,53	41,40	41,72	42,32	15.630,00
27-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,47	13.700,00	61.251,86	4,40	4,46	4,50	23.115,00
27-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	23,04	900,00	20.733,75	22,91	23,16	23,43	11.055,00
27-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	23,24	2.400,00	55.771,87	22,91	23,16	23,43	11.055,00
27-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	23,02	2.900,00	66.748,35	22,91	23,16	23,43	11.055,00
27-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	13,89	7.300,00	101.411,25	13,77	13,91	14,08	14.365,00
27-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	42,84	1.400,00	59.978,46	42,02	42,78	43,07	19.800,00
27-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	42,91	900,00	38.616,93	42,02	42,78	43,07	19.800,00
27-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	42,89	400,00	17.156,00	42,02	42,78	43,07	19.800,00
27-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	23,12	1.200,00	27.738,12	22,92	23,16	23,34	8.604,00
27-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	23,07	1.400,00	32.298,00	22,92	23,16	23,34	8.604,00
27-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	55,46	1.100,00	61.003,44	54,80	55,45	55,80	17.151,00
27-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	26,88	3.000,00	80.640,75	26,59	26,96	27,82	14.463,00
28-08-24	FIA RVA EMB II	Venda	ABEV3	12,87	4.300,00	55.332,38	12,81	12,90	13,07	25.749,00
28-08-24	FIA RVA EMB II	Venda	BDBC4	15,49	9.300,00	144.059,82	15,17	15,53	15,77	35.520,00
28-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	PETRA	39,42	7.400,00	291.728,70	38,78	39,44	39,86	65.221,00
28-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	23,63	2.200,00	51.995,21	23,51	23,64	23,77	13.765,00
28-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	23,64	2.600,00	61.454,60	23,51	23,64	23,77	13.765,00
28-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	41,83	4.800,00	200.782,03	41,08	41,95	42,30	21.685,00
28-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	15,97	400,00	6.389,99	15,89	16,02	16,11	11.357,00
28-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	15,97	2.100,00	33.545,75	15,89	16,02	16,11	11.357,00
28-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,44	6.300,00	27.999,75	4,42	4,44	4,49	19.126,00
28-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	22,84	2.300,00	52.541,07	22,67	22,83	23,06	13.263,00
28-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	22,87	4.400,00	100.638,65	22,67	22,83	23,06	13.263,00
28-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,41	1.000,00	22.410,00	22,31	22,42	22,78	26.573,00
28-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,41	1.800,00	40.331,55	22,31	22,42	22,78	26.573,00



# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2024

## RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE AGOSTO DE 2024 À 30 DE AGOSTO 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
28-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	42,55	6.700,00	285.087,65	42,20	42,54	42,89	22.303,00
28-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	23,01	2.200,00	50.616,30	22,83	23,01	23,26	9.306,00
28-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	26,80	1.400,00	37.516,06	26,57	26,87	27,27	13.412,00
28-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	27,00	400,00	10.799,50	26,57	26,87	27,27	13.412,00
29-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	23,10	700,00	16.171,67	23,02	23,15	23,75	15.076,00
29-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	AZZA3	50,67	3.700,00	187.462,93	50,10	50,65	51,95	14.263,00
29-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	AZZA3	51,00	500,00	25.500,00	50,10	50,65	51,95	14.263,00
29-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	AZZA3	50,59	500,00	25.292,82	50,10	50,65	51,95	14.263,00
29-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	28,38	1.000,00	28.380,97	28,02	28,30	28,56	30.089,00
29-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBDC4	15,63	1.000,00	15.627,18	15,51	15,61	15,68	27.377,00
29-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	36,35	700,00	25.441,85	35,81	36,27	36,55	24.297,00
29-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	35,70	900,00	32.130,43	35,47	35,69	36,24	19.684,00
29-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPLE3	9,36	2.800,00	26.221,51	9,26	9,39	9,52	13.099,00
29-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLE6	10,34	4.500,00	46.539,29	10,27	10,38	10,53	23.787,00
29-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	41,30	1.100,00	45.426,67	41,12	41,32	42,09	23.119,00
29-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	13,27	1.400,00	18.574,41	13,19	13,32	13,59	32.921,00
29-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	46,92	1.300,00	60.994,80	46,46	46,99	47,98	20.079,00
29-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	15,90	2.300,00	36.568,90	15,84	15,94	16,21	12.303,00
29-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	15,94	1.300,00	20.722,00	15,84	15,94	16,21	12.303,00
29-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	15,94	5.100,00	81.315,54	15,84	15,94	16,21	12.303,00
29-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	17,76	800,00	14.204,63	17,62	17,74	18,18	8.828,00
29-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	17,75	1.100,00	19.525,00	17,62	17,74	18,18	8.828,00
29-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,32	11.500,00	49.726,98	4,29	4,34	4,47	29.502,00
29-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,36	13.200,00	57.599,46	4,29	4,34	4,47	29.502,00
29-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	22,31	3.700,00	82.538,37	22,20	22,37	22,99	11.730,00
29-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	11,07	3.700,00	40.959,41	10,98	11,06	11,16	28.975,00
29-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	14,01	2.600,00	36.420,85	13,88	14,01	14,10	17.403,00
29-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	46,83	700,00	32.783,29	46,41	46,84	47,44	19.826,00
29-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,05	2.600,00	57.325,71	21,90	22,06	22,64	29.472,00
29-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	20,52	1.200,00	24.629,69	20,38	20,54	20,94	6.901,00
29-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	42,00	3.300,00	138.603,33	41,75	41,98	42,85	27.228,00
29-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	22,57	1.100,00	24.831,49	22,35	22,51	23,29	10.463,00
29-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	55,44	1.800,00	99.797,54	55,20	55,66	56,40	21.549,00
29-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	10,02	1.800,00	18.037,21	9,93	10,04	10,21	9.218,00
29-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	CPLE3	9,45	269,00	2.542,05	9,26	9,39	9,52	13.099,00
29-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	CPLE3	9,44	807,00	7.620,57	9,26	9,39	9,52	13.099,00
29-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	CPLE3	9,43	1.091,00	10.284,48	9,26	9,39	9,52	13.099,00
29-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	CPLE3	9,45	1.082,00	10.224,90	9,26	9,39	9,52	13.099,00
29-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	CPLE6	10,42	1.917,00	19.973,14	10,27	10,38	10,53	23.787,00
29-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	CPLE6	10,33	1.663,00	17.173,75	10,27	10,38	10,53	23.787,00
29-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	CPLE6	10,46	554,00	5.793,73	10,27	10,38	10,53	23.787,00
29-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	CPLE6	10,32	55,00	567,60	10,27	10,38	10,53	23.787,00
29-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	CPLE6	10,45	843,00	8.810,63	10,27	10,38	10,53	23.787,00
29-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	47,34	136,00	6.437,96	46,46	46,99	47,98	20.079,00
29-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	47,33	114,00	5.395,32	46,46	46,99	47,98	20.079,00
29-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	47,34	286,00	13.538,62	46,46	46,99	47,98	20.079,00
29-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	46,93	305,00	14.313,65	46,46	46,99	47,98	20.079,00
29-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	47,06	858,00	40.375,85	46,46	46,99	47,98	20.079,00
29-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	23,08	648,00	14.958,93	22,91	23,11	23,64	22.219,00
29-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	23,14	815,00	18.855,92	22,91	23,11	23,64	22.219,00
29-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	23,13	815,00	18.848,35	22,91	23,11	23,64	22.219,00
29-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	23,03	5.600,00	128.989,45	22,91	23,11	23,64	22.219,00
30-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	22,78	2.000,00	45.552,24	22,59	22,82	23,14	17.281,00
30-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	AZZA3	49,43	400,00	19.772,46	48,79	49,29	50,54	17.245,00
30-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	28,05	600,00	16.827,43	27,98	28,12	28,27	33.803,00
30-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBDC4	15,53	800,00	12.425,65	15,49	15,61	15,67	30.536,00
30-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	36,61	400,00	14.645,57	36,34	36,66	36,76	16.470,00
30-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	35,54	700,00	24.880,25	35,18	35,53	35,76	25.161,00
30-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLE3	9,38	4.300,00	40.334,00	9,32	9,39	9,48	9.982,00
30-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPLE6	10,43	2.200,00	22.937,28	10,33	10,44	10,56	22.272,00
30-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	41,51	1.100,00	45.657,70	40,72	41,60	41,75	32.816,00
30-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	13,29	1.500,00	19.935,68	13,07	13,14	13,42	19.743,00
30-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	47,40	300,00	14.220,12	46,63	47,24	47,71	13.779,00
30-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	34,04	1.300,00	44.255,33	33,83	34,10	34,20	24.081,00
30-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	15,95	6.200,00	98.890,00	15,67	15,90	15,95	13.533,00
30-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	15,76	1.600,00	25.215,93	15,67	15,90	15,95	13.533,00
30-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,28	4.800,00	20.545,14	4,18	4,25	4,32	41.711,00
30-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	22,09	700,00	15.463,64	21,84	22,09	22,37	11.457,00
30-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	22,14	5.100,00	112.898,31	21,84	22,09	22,37	11.457,00
30-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,85	2.800,00	30.378,30	10,83	10,92	10,96	39.794,00
30-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	13,75	3.400,00	46.741,35	13,55	13,63	13,94	19.971,00
30-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	13,59	3.300,00	44.856,42	13,55	13,63	13,94	19.971,00
30-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	46,55	500,00	23.273,54	46,04	46,61	46,98	22.494,00
30-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	21,78	1.500,00	32.672,94	21,69	21,82	21,91	23.865,00
30-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	20,17	600,00	12.102,36	20,02	20,20	20,51	9.490,00
30-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	41,06	4.200,00	172.431,00	40,84	41,28	41,43	26.697,00
30-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	21,90	2.000,00	43.800,00	21,81	22,04	22,33	9.697,00
30-08-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	22,06	200,00	4.412,41	21,81	22,04	22,33	9.697,00
30-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	26,37	1.400,00	36.920,88	25,75	26,28	26,67	19.298,00
30-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	26,61	800,00	21.284,27	25,75	26,28	26,67	19.298,00
30-08-24	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	9,96	1.200,00	11.947,20	9,84	10,04	10,28	16.646,00
30-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	47,23	1.670,00	78.869,10	46,63	47,24	47,71	13.779,00
30-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQLT3	33,99	3.581,00	121.704,60	33,83	34,10	34,20	24.081,00
30-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQLT3	34,03	1.828,00	62.198,06	33,83	34,10	34,20	24.081,00
30-08-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQLT3	34,00	995,00	33.825,49	33,83	34,10	34,20	24.081,00
30-08-24	FIA RVA EMB IV	Venda	GGPS3	18,03	22.101,00	398.511,59	17,43	18,00	18,15	11.227,00
30-08-24	FIA RVA EMB IV	Venda	SBSF3	94,49	1.194,00	112.815,39	93,69	94,49	94,95	22.505,00

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – AGOSTO 2024

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE AGOSTO DE 2024 À 30 DE AGOSTO 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
30-08-24	FIA RVA EMB IV	Venda	SBSP3	93,99	4.017,00	377.575,93	93,69	94,49	94,95	22.505,00
30-08-24	FIA RVA EMB IV	Venda	SBSP3	94,16	5.404,00	508.866,78	93,69	94,49	94,95	22.505,00
30-08-24	FIA RVA EMB IV	Venda	SBSP3	94,36	1.047,00	98.799,74	93,69	94,49	94,95	22.505,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ABEV3	12,86	1.350,00	17.361,60	12,75	12,84	12,87	24.381,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ALOS3	22,81	1.780,00	40.600,96	22,59	22,82	23,14	17.281,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ASAI3	9,57	400,00	3.828,00	9,27	9,56	9,75	37.615,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	AURE3	11,39	10.422,00	118.706,58	11,35	11,41	11,54	9.874,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	AZUL4	5,39	340,00	1.832,60	5,36	5,53	5,93	27.450,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	AZZA3	49,00	220,00	10.780,55	48,79	49,29	50,54	17.245,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	B3SA3	12,68	6.660,00	84.448,92	12,37	12,62	12,70	52.744,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BBAS3	28,12	880,00	24.746,12	27,98	28,12	28,27	33.803,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BBDC3	14,14	730,00	10.319,01	13,98	14,11	14,15	8.602,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BBDC4	15,64	1.930,00	30.184,25	15,49	15,61	15,67	30.536,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BBSE3	36,73	2.060,00	75.663,80	36,34	36,66	36,76	16.470,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BEEF3	7,49	180,00	1.347,48	7,41	7,48	7,56	6.628,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BPAC11	35,56	6.960,00	247.497,39	35,18	35,53	35,76	25.161,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BRAP4	19,47	80,00	1.557,46	19,19	19,46	19,59	11.196,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BRFS3	26,23	1.370,00	35.935,10	25,14	26,02	26,23	13.681,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	BRKM5	18,01	110,00	1.981,41	17,58	17,95	18,04	7.640,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CCRO3	13,25	500,00	6.623,02	13,02	13,21	13,25	11.480,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CMIG4	11,63	1.120,00	13.025,58	11,48	11,61	11,68	24.402,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CMIN3	5,68	350,00	1.987,80	5,60	5,71	5,83	14.876,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	COGN3	1,37	2.510,00	3.439,06	1,36	1,39	1,43	11.450,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CPFE3	34,09	60,00	2.045,40	32,60	33,67	34,09	8.781,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CPL6	10,43	530,00	5.527,12	10,33	10,44	10,56	22.272,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CRFB3	8,97	280,00	2.511,40	8,90	9,00	9,17	11.448,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CSAN3	13,36	560,00	7.480,08	13,26	13,34	13,44	20.617,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CSNA3	11,86	7.070,00	83.850,44	11,70	11,85	11,93	10.974,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CXSE3	16,35	18.546,00	303.227,73	15,70	16,31	16,48	20.554,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	CYRE3	21,82	140,00	3.055,46	21,49	21,76	22,05	17.040,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	DXCO3	8,21	16.456,00	135.089,48	7,79	8,14	8,21	10.887,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	EGIE3	45,18	80,00	3.614,10	43,64	45,02	45,30	10.767,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ELET3	41,75	9.460,00	394.955,00	40,72	41,60	41,75	32.816,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ELET6	46,13	80,00	3.690,24	45,51	46,11	46,37	8.456,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	EMBR3	46,83	230,00	10.770,90	45,91	46,81	47,44	40.471,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ENEV3	13,13	490,00	6.433,92	13,07	13,14	13,42	19.743,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ENGI11	47,29	110,00	5.201,50	46,63	47,24	47,71	13.779,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	EQTL3	34,20	4.410,00	150.820,96	33,83	34,10	34,20	24.081,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	EZTC3	14,09	240,00	3.381,63	13,73	13,99	14,13	5.560,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	FLRY3	15,95	11.910,00	189.963,87	15,67	15,90	15,95	13.533,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	GGBR4	18,30	590,00	10.796,04	18,17	18,28	18,42	18.877,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	GOAU4	10,49	150,00	1.573,44	10,36	10,45	10,51	9.393,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	HAPV3	4,23	15.488,00	65.589,95	4,18	4,25	4,32	41.711,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	HAPV3	4,24	3.772,00	15.993,28	4,18	4,25	4,32	41.711,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	HYPE3	28,53	140,00	3.994,27	28,30	28,59	29,14	17.299,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	IGTI11	22,09	400,00	8.835,12	21,84	22,09	22,37	11.457,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	IRBR3	48,36	30,00	1.450,84	47,53	48,21	48,89	7.638,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ITSA4	10,96	4.770,00	52.279,40	10,83	10,92	10,96	39.794,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	ITUB4	36,70	16.770,00	615.456,80	36,41	36,66	36,97	40.416,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	JBSS3	35,00	60,00	2.100,00	34,57	34,94	35,30	16.763,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	KLBN11	21,59	870,00	18.783,30	21,24	21,50	21,59	13.460,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	LREN3	17,01	240,00	4.082,46	16,68	17,02	17,35	39.257,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	LWSA3	4,55	750,00	3.411,98	4,54	4,59	4,68	10.529,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	MIRG3	14,56	1.700,00	24.749,84	14,33	14,50	14,63	12.865,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	MULT3	25,64	2.570,00	65.894,78	25,29	25,54	25,67	16.605,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	NTCO3	13,55	135,00	1.820,25	13,55	13,63	13,94	19.971,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PETR3	42,94	15.290,00	656.552,88	42,43	42,93	43,35	31.078,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	PETRA	39,37	8.690,00	342.124,46	38,88	39,33	39,65	61.273,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	PETZ3	4,86	610,00	2.964,84	4,86	4,97	5,23	18.160,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	PRI03	46,84	530,00	24.823,95	46,04	46,61	46,98	22.494,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	RADL3	27,55	420,00	11.570,14	27,28	27,52	27,67	17.767,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	RAIL3	21,85	510,00	11.141,29	21,69	21,82	21,91	23.865,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	RAIZ4	3,21	1.350,00	4.333,29	3,15	3,18	3,22	11.720,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	RDOR3	31,93	330,00	10.536,48	31,60	31,94	32,48	21.077,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	RECV3	20,39	60,00	1.223,66	20,02	20,20	20,51	9.490,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RENT3	41,37	5.870,00	242.841,76	40,84	41,28	41,43	26.697,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RRRP3	26,37	12.020,00	316.970,46	26,27	26,43	27,06	15.219,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SANB11	31,40	620,00	19.468,72	31,07	31,36	31,53	7.270,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SBSP3	94,73	7.970,00	754.991,64	93,69	94,49	94,95	22.505,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	SLCE3	17,66	60,00	1.059,44	17,61	17,68	17,76	5.669,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	SMT03	27,69	40,00	1.107,45	27,53	27,95	28,42	8.690,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	STBP3	13,00	31.934,00	415.147,52	12,51	13,03	13,31	21.119,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	SUZB3	55,00	1.990,00	109.450,34	54,73	55,03	55,91	25.601,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	TAEF11	35,46	70,00	2.481,94	34,90	35,43	36,10	6.637,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	TIMS3	17,88	280,00	5.006,24	17,60	17,82	17,91	16.581,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	TOTS3	29,97	1.240,00	37.162,08	29,83	29,98	30,25	14.503,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	TRPL4	24,74	130,00	3.215,66	24,41	24,71	24,84	6.438,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	UGPA3	23,36	190,00	4.438,33	22,69	23,33	23,48	15.999,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	VALE3	59,58	9.770,00	582.096,60	59,08	59,50	59,73	33.417,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	VAMO3	7,60	890,00	6.763,55	7,53	7,63	7,75	10.037,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	VBBR3	25,72	5.240,00	134.770,28	25,10	25,68	25,78	19.613,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	VIVA3	26,39	40,00	1.055,60	25,75	26,28	26,67	19.298,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	VIVT3	51,83	190,00	9.846,98	51,31	51,82	52,12	13.637,00
30-08-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	WEGE3	54,15	11.890,00	643.840,14	52,96	54,01	54,15	18.230,00



## 7. RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS

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

Mensalmente são disponibilizados no portal da Entidade, [www.embraerprev.com.br](http://www.embraerprev.com.br), os seguintes relatórios:

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

## 8. GLOSSÁRIO

### **Administrador**

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

### **Carteira**

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

### **Dados Gerais**

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

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

### **Duration**

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

Vide também glossário de Valor Presente.

### **ETL (Expected Tail Loss)**

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

### **Fundo de Investimento**

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

## **Índice de Referência (*Benchmark*)**

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

## **LDI (*Liability Driven Investments*)**

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

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

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

## **Patrimônio de Cobertura**

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

## **Patrimônio Líquido (PL)**

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

## **Rating**

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

## **Stress Testing**

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

### ***Tracking Error***

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

### **Túnel de Preços**

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

### **Valor Presente**

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

### ***Value at Risk (VaR)***

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