



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO

Janeiro/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 – JANEIRO 2024



Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: **EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS** Data: 31/01/2024
 CNPJ: **10679245000140**

Dados Gerais							
PL:	4.716.643.496,66	VAR / PL:	2,6366%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	1.708,91
VAR:	124.356.902,58	ETL / PL:	3,3063%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1.176,08
ETL:	155.948.572,84	VAR / CDI:	0,0292%	Benchmark:			

Cenários de STRESS									
Cenário Alta - 09999 (+):	175.249.112,45	Cenário Baixa - 10000 (+):	306.002.877,54	CENARIO BRADESCO 1 (+):	398.461.644,92	CENARIO BRADESCO 2 (+):	24.564.600,11		
Cenário Alta - 09999 (-):	(251.560.381,59)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(233.321.101,98)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(113.015.750,79)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(355.314.951,54)		
Cenário Alta - 09999:	(76.311.269,14)	Cenário Baixa - 10000:	72.681.775,57	CENARIO BRADESCO 1:	285.445.894,13	CENARIO BRADESCO 2:	(330.750.351,43)		

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
SNGO18	1.548.234,34	45,59	40,73	0,00%	986.954,76	-986.996,30	492.291,89	-496.239,71
SOM3	3.289.849,20	600.917,88	406.496,49	0,33%	2.895.185,13	-2.316.148,10	1.697.736,56	-1.711.633,45
SUZB3	11.580.740,52	1.044.841,48	792.092,37	0,64%	102.747,87	-102.747,87	60.251,35	-60.744,54
TAEE11	410.991,49	23.359,86	19.357,75	0,02%	-103.150,42	-15.807,09	18.709,52	-25.258,37
TBSP11	2.629.781,37	750,51	698,62	0,00%	-3.516,00	2.883,95	4.028,15	-5.749,81
TCII1	10.483.662,10	410.492,33	396.437,81	0,32%	-1.380.861,51	-12.740,16	518.708,53	-642.742,55
TEPP11	5.843.074,22	292.000,86	-64.986,91	-0,05%	2.921.537,11	-2.921.537,11	856.594,68	-863.606,37
TERMO_RF_PRE	-269.079,17	1.090,36	-993,07	0,00%	6.620,58	-5.244,12	-7.621,91	11.201,61
TIMS3	1.367.813,88	144.617,36	112.114,97	0,09%	437.700,44	-314.597,19	200.521,52	-202.162,89
TOTS3	1.853.900,90	337.602,48	238.932,89	0,19%	370.612,16	-370.612,16	271.658,71	-273.982,39
TRPL4	516.707,36	55.692,36	37.891,85	0,03%	103.341,47	-129.176,84	75.749,30	-76.369,35
TRXF11	9.412.302,90	383.704,16	-26.166,76	-0,02%	4.706.151,45	-4.706.151,45	1.379.843,61	-1.391.138,37
UGPA3	14.766.068,09	1.296.766,15	646.749,18	0,52%	3.691.516,52	-2.953.213,22	2.164.705,29	-2.182.424,57
UNEG11	14.198.507,83	648.593,34	628.050,26	0,51%	-2.108.027,37	6.364,91	817.647,12	-1.016.544,28
USIM5	241.311,02	40.709,65	34.240,19	0,03%	94.111,30	-53.088,42	35.376,20	-35.665,77
UTPS21	6.690.783,17	280.183,71	264.295,33	0,21%	-894.311,96	-53.441,60	307.051,46	-388.836,31
VALE3	30.405.944,80	4.810.246,45	4.350.721,07	3,50%	7.601.486,20	-7.601.486,20	4.457.511,51	-4.493.998,64
VAMO22	1.112.510,10	73,38	67,05	0,00%	-424,88	344,25	509,73	-745,85
VAMO3	175.491,60	38.617,41	37.047,50	0,03%	61.422,06	-70.196,64	26.727,07	-25.937,66
VAMO33	11.771.601,70	442.155,59	388.688,03	0,31%	-1.349.758,21	-167.254,64	389.569,04	-605.786,24
VAMO34	7.492.175,72	277.101,31	246.750,25	0,20%	-862.709,74	-107.172,66	290.664,66	-324.819,75
VBBR3	7.733.593,75	449.485,73	129.465,46	0,10%	1.933.396,44	-1.933.396,44	1.133.744,84	-1.143.025,16
WCOS11	636.034,81	538,85	509,89	0,00%	-2.184,81	1.833,41	2.486,16	-3.423,85
VECS11	3.486.127,91	67,24	59,25	0,00%	-571,15	470,73	759,83	-1.128,16
VERDECS2	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
VERO12	8.511.840,17	225.424,04	196.238,91	0,16%	-773.569,00	-131.297,32	189.943,96	-249.553,66
VIMT13	7.374.012,45	283.708,61	266.396,77	0,21%	-920.308,70	-66.882,91	305.397,89	-387.652,89
VIVT3	1.107.681,12	141.358,58	97.464,41	0,08%	166.150,01	-166.152,17	162.386,05	-163.715,27
VIXL14	3.302.694,07	151,05	136,90	0,00%	-976,88	795,59	1.239,17	-1.826,06
VRD12	10.106.903,78	357.203,50	330.349,41	0,27%	-1.178.745,55	-132.406,09	356.724,00	-457.800,03
VVEO15	1.027.909,94	221,47	204,89	0,00%	-1.075,23	873,72	1.219,06	-1.754,72
VVEO16	1.078.668,44	277,98	258,01	0,00%	-1.300,95	1.062,63	1.479,80	-2.120,57
VVRT11	2.594.953,45	422,71	391,43	0,00%	-2.106,41	1.719,59	2.446,44	-3.525,71
WDOG24	-4.301,05	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
WIDW24	-1.831,07	31.494,66	-21.358,02	-0,02%	99.292,88	-100.859,76	129.451,01	-130.150,33
WEGE3	4.214.645,82	531.238,90	502.453,34	0,40%	1.053.661,46	-1.053.661,46	617.867,08	-622.924,65
WING24	6.520,00	225.874,99	217.951,10	0,18%	462.068,66	-461.872,24	373.235,65	-375.975,25
XPIN11	2.494.879,00	79.016,98	-49.526,10	-0,04%	1.247.439,50	-1.247.439,50	365.749,26	-368.743,12
XPPR11	2.169.645,20	418.220,40	242.320,95	0,19%	1.084.822,60	-1.084.822,60	138.069,99	-320.673,56
YDUQ3	3.062.049,60	535.602,49	500.435,86	0,40%	1.194.199,34	-765.512,40	448.896,47	-452.570,93
Total Var:	4.965.168.803,74	156.230.480,61	124.356.902,58	100,00%	-76.311.269,14	72.681.775,56	285.445.894,13	-330.750.351,43

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: **EMBRAERPREV RENDA FIXA** Data: 31/01/2024
 CNPJ: **10679245000140**

Dados Gerais							
PL:	3.817.620.305,00	VAR / PL:	2,3692%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	2.053,95
VAR:	90.409.828,79	ETL / PL:	2,9698%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1.413,46
ETL:	113.377.570,26	VAR / CDI:	0,0262%	Benchmark:			

Cenários de STRESS								
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (+):	235.277.281,05	CENARIO BRADESCO 1 (+):	196.309.911,34	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-	
Cenário Alta - 09999 (-):	(224.011.601,23)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(5.659.691,68)	CENARIO BRADESCO 1 (-):		CENARIO BRADESCO 2 (-):	(224.847.344,68)	
Cenário Alta - 09999:	(224.011.601,23)	Cenário Baixa - 10000:	229.617.589,37	CENARIO BRADESCO 1:	196.309.911,34	CENARIO BRADESCO 2:	(224.847.344,68)	

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
GAXA	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
FI RF EMB II	3.063.687.340,74	73.885.310,07	73.669.106,89	81,48%	-160.155.099,42	227.218.418,35	173.398.162,53	-196.657.216,79
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	137.085.099,26	1.676.447,16	1.366.550,21	1,51%	-7.588.752,06	-1.475.296,15	1.526.027,35	-2.019.112,52
FIM EMB II A	217.177.018,96	721.791,60	644.628,38	0,71%	-2.421.900,65	2.534.188,45	1.872.875,53	-2.569.821,73
FIM EMB VII A CRED PRIV	270.365.464,39	3.319.602,29	3.240.540,85	3,58%	-11.716.387,46	5.524.874,25	6.487.060,96	-7.013.668,05
FIM EMB VII A CRED PRIV	374.924.901,14	12.480.617,47	11.489.000,66	12,71%	-42.149.461,65	-4.184.395,53	13.025.784,97	-15.593.325,59
Total Var:	4.063.220.824,49	92.063.668,60	90.409.828,79	99,99%	-224.011.601,23	229.617.589,37	196.309.911,34	-224.847.344,68

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2024



Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/01/2024

FUNDO: EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL									
CNPJ: 10679245000140									
Dados Gerais									
PL:	521.457.388,80	VAR / PL:	7,8865%	Limite Fundo:	0,00%	Duration DC:	2,22		
VAR:	41.126.196,03	ETL / PL:	9,8903%	Status:	ENQUADRADO	Duration DU:	1,84		
ETL:	51.573.909,00	VAR / CDI:	0,0673%	Benchmark:					
Cenários de STRESS									
Cenário Alta - 09999 (+):	126.978.540,90	Cenário Baixa - 10000 (+):	-	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	66.916.950,81	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	-		
Cenário Alta - 09999 (-):	-	Cenário Baixa - 10000 (-):	(124.635.484,76)	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	-	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(67.468.477,94)		
Cenário Alta - 09999:	126.978.540,90	Cenário Baixa - 10000:	(124.635.484,76)	CENÁRIO BRADESCO 1:	66.916.950,81	CENÁRIO BRADESCO 2:	(67.468.477,94)		
Parâmetros do Cálculo									
Modelo:	Var paramétrico	Modelo Volatilidade:	EWMA						
Int. Confiança:	95	Lambda:	0,94						
Horizonte:	21								
Produto	MtM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2	
CAIXA	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
FIA RVA EMB II	110.132.665,02	9.380.229,62	9.354.781,65	22,75%	28.674.218,64	-29.088.047,47	15.741.705,07	-15.870.443,72	
FIA RVA EMB III	114.717.066,30	8.843.647,37	8.706.006,01	21,17%	32.493.075,04	-30.997.628,03	14.187.635,14	-14.307.597,04	
FIA RVA EMB IV	107.907.138,00	6.738.732,74	6.626.600,10	16,11%	29.476.430,43	-27.697.130,83	14.782.917,67	-14.904.402,95	
FIC FIA EMB VIII ETF	71.639.383,42	6.367.858,31	6.341.714,82	15,42%	6.444.494,40	-6.444.494,32	5.248.701,06	-5.291.672,96	
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	117.069.105,22	10.134.099,04	10.097.093,65	24,55%	29.890.322,40	-30.408.184,12	16.955.991,87	-17.094.361,88	
Total Var.	521.456.327,97	41.464.367,08	41.126.196,03	100,00%	126.978.540,90	-124.635.484,77	66.916.950,81	-67.468.477,94	



Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/01/2024

FUNDO: FI RF EMB II									
CNPJ: 11005764000196									
Dados Gerais									
PL:	2.913.475.416,98	VAR / PL:	2,5360%	Limite Fundo:	0,00%	Duration DC:	2,322,79		
VAR:	73.885.308,53	ETL / PL:	3,1802%	Status:	ENQUADRADO	Duration DU:	1,598,30		
ETL:	92.655.157,70	VAR / CDI:	0,0281%	Benchmark:					
Cenários de STRESS									
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (+):	228.065.183,76	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	173.398.158,92	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	-		
Cenário Alta - 09999 (-):	(160.155.096,09)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(846.770,15)	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	-	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(196.657.212,70)		
Cenário Alta - 09999:	(160.155.096,09)	Cenário Baixa - 10000:	227.218.413,62	CENÁRIO BRADESCO 1:	173.398.158,92	CENÁRIO BRADESCO 2:	(196.657.212,70)		
Parâmetros do Cálculo									
Modelo:	Var paramétrico	Modelo Volatilidade:	EWMA						
Int. Confiança:	95	Lambda:	0,94						
Horizonte:	21								
Produto	MtM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2	
CSMGC3	8.205.463,32	68.742,59	40.007,32	0,05%	0,00	0,00	0,00	0,00	
ELET42	14.883.988,98	400.824,21	324.540,32	0,44%	0,00	0,00	0,00	0,00	
ENTV12	13.893.260,45	422.612,77	347.078,53	0,47%	-26.062,64	26.580,14	102.930,80	-156.664,81	
GASP17	51.169.472,44	336.642,87	-142.603,14	-0,19%	0,00	0,00	0,00	0,00	
IGSN15	2.697.647,85	90.703,65	79.623,66	0,11%	-312.549,64	-104.617,08	32.855,90	-44.356,05	
NEOE16	7.634.821,49	214.444,69	173.029,69	0,23%	0,00	0,00	0,00	0,00	
NTNB20240815 - 760199_VENCIMENTO	126.695.457,81	294.267,62	-133.902,34	-0,18%	-1.366.575,00	-230.873,83	332.699,02	-438.255,45	
NTNB20260815 - 760199_VENCIMENTO	43.805.599,50	401.077,89	357.805,00	0,48%	-1.399.069,05	-209.520,59	363.502,25	-475.602,20	
NTNB20300815 - 760199_VENCIMENTO	27.325.982,65	610.416,89	606.000,31	0,82%	-1.429.677,27	1.684.268,65	1.061.371,03	-1.401.442,53	
NTNB20350515 - 760199_VENCIMENTO	242.645.740,29	7.724.312,01	7.684.564,33	10,40%	-304.079,60	-38.490,93	88.926,97	-114.380,27	
NTNB20400815 - 760199_VENCIMENTO	30.775.432,39	1.131.158,06	1.130.554,49	1,53%	-713.268,28	-115.730,06	177.085,93	-233.059,64	
NTNB20450515 - 760199_VENCIMENTO	232.465.131,28	9.646.114,23	9.635.971,76	13,04%	-984.684,96	968.888,35	637.459,81	-859.823,69	
NTNB20500815 - 760199_VENCIMENTO	760.440.442,58	34.469.307,30	34.450.746,87	46,63%	-1.113.197,50	1.193.880,69	808.239,52	-1.072.127,83	
NTNB20550515 - 760199_VENCIMENTO	233.728.520,64	11.834.876,94	11.825.326,28	16,00%	-1.429.763,48	1.573.846,93	1.201.603,01	-1.539.737,11	
PETRA5	9.427.889,14	117.835,21	55.909,62	0,08%	-17.719.051,36	21.816.143,07	17.209.204,51	-21.195.069,00	
SBSPC2	10.122.017,82	36.813,50	18.478,88	0,03%	-2.781.516,82	3.599.121,36	2.833.964,66	-3.359.831,45	
BBTOPIND	337.959.953,80	7.532.783,64	7.419.453,01	10,04%	-21.662.106,31	35.888.944,34	25.540.007,69	-29.335.135,57	
CAIXA	5.000,00	0,00	0,00	0,00%	-81.110.234,48	120.457.428,19	91.674.836,84	-102.248.083,79	
COMPROMISSADA_PRE	919.909.570,83	14.450,73	12.723,95	0,02%	-27.370.018,03	40.892.112,03	31.283.901,59	-34.116.676,20	
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-104.106,30	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-299.422,30	-62.177,28	28.229,86	-38.174,47	
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-233.800,37	-85.380,38	21.339,83	-28.792,62	
Total Var.	3.063.687.276,96	75.347.384,80	73.885.308,53	100,00%	-160.155.096,09	227.218.413,62	173.398.158,92	-196.657.212,70	

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2024



Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/01/2024

FUNDO: FIR FEM V CREDITO PRIVADO
CNPJ: 20726178000121

Dados Gerais							
PL:	130.424.463,45	VAR / PL:	1,2854%	Limite Fundo:	0,00%	Dutation DC:	747,63
VAR:	1.676.447,16	ETL / PL:	1,6119%	Status:	ENQUADRADO	Dutation DU:	514,96
ETL:	2.102.332,37	VAR / CDI:	0,0142%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (+):	348.475,74	CENARIO BRADESCO 1 (+):	1.526.027,35	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
Cenário Alta - 09999 (-):	(7.568.752,06)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(1.823.771,89)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(2.019.112,52)
Cenário Alta - 09999:	(7.568.752,06)	Cenário Baixa - 10000:	(1.475.296,15)	CENARIO BRADESCO 1:	1.526.027,35	CENARIO BRADESCO 2:	(2.019.112,52)

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
17H0164854	7.629.733,31	83.018,73	81.242,15	4,85%	-439.701,31	-127.623,98	68.031,40	-90.925,94
AEGP23	15.233.520,92	141.217,73	133.514,23	7,96%	-583.303,94	-214.657,95	54.197,26	-73.195,17
CCRDD1	3.209.231,53	38.672,04	32.789,82	1,96%	0,00	0,00	0,00	0,00
CMDT33	1.456.292,89	5.311,52	4.339,97	0,26%	-90.612,25	-17.445,55	14.661,28	-19.787,75
ENJG21	1.677.267,05	17.781,54	17.388,82	1,04%	-33.741,48	-12.310,10	3.083,05	-4.159,79
ENM21	1.071.504,06	11.527,07	11.236,57	0,67%	-6,24	6,36	24,62	-37,48
ENTV12	18.263.848,64	555.559,71	547.358,22	32,65%	0,00	0,00	0,00	0,00
ERDV17_VENCIMENTO	13.331.969,10	103.894,47	103.486,63	6,17%	0,00	0,00	0,00	0,00
ERDV36	2.139.828,66	26.091,16	22.079,83	1,32%	-95.356,44	-28.266,67	14.113,82	-18.887,81
GASP17	10.586.787,40	69.650,25	-44.816,01	-2,67%	-62.751,07	-18.669,89	9.320,55	-12.470,74
GRRB24_VENCIMENTO	16.622.456,68	466.104,30	460.294,33	27,46%	-1.826.072,00	-275.432,28	477.854,00	-625.218,72
LFSN1600GM	15.108.954,15	108.369,88	83.424,83	4,98%	-475.952,80	-175.736,42	39.699,66	-53.640,85
LFSN1800DC5	5.017.218,81	47.136,75	38.247,35	2,28%	-61.515,42	-11.844,74	9.996,60	-13.491,67
OMGE31	13.549.094,65	122.739,46	113.956,47	6,80%	-295.795,30	348.469,38	219.594,01	-289.953,63
SBSPC2	7.757.115,54	28.212,42	23.047,80	1,37%	-1.541.102,82	-246.093,56	383.287,89	-504.674,04
TAE33	4.236.730,42	58.740,12	48.853,44	2,91%	-600.113,43	-172.941,10	72.781,62	-98.211,64
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	-308.835,30	-123.671,26	26.757,48	-36.084,97
COMPROMISSADA_PRE	220.071,94	3,46	2,51	0,00%	-871.566,47	-317.854,47	97.560,60	-131.048,43
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-47.526,53	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-179.175,39	-65.416,83	16.354,00	-22.065,53
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-103.150,42	-15.807,09	18.709,52	-25.258,37
Total Var:	137.065.099,23	1.889.020,59	1.676.447,16	100,01%	-7.568.752,06	-1.475.296,15	1.526.027,35	-2.019.112,52

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2024



bradesco

Data: 31/01/2024

Relatório de Risco de Mercado

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

Dados Gerais							
PL:	258.303.652,79	VAR / PL:	1,2851%	Limite Fundo:	0,00%	Duration DC:	806,71
VAR:	3.319.502,04	ETL / PL:	1,6116%	Status:	ENQUADRADO	Duration DU:	555,57
ETL:	4.162.789,47	VAR / CDI:	0,0142%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	339.498,71	Cenário Baixa - 10000 (+):	6.361.440,69	CENARIO BRADESCO 1 (+):	6.808.654,74	CENARIO BRADESCO 2 (+):	330.035,51
Cenário Alta - 09999 (-):	(12.055.885,27)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(836.766,87)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(321.594,28)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(7.343.903,02)
Cenário Alta - 09999:	(11.716.386,56)	Cenário Baixa - 10000:	5.524.673,82	CENARIO BRADESCO 1:	6.487.060,46	CENARIO BRADESCO 2:	(7.013.867,50)

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
RSAN44	915.981,94	21.624,14	18.441,33	0,56%	-79.860,30	-14.823,79	18.930,05	-24.812,55
SMFT16	2.553.213,34	1.516,30	1.397,12	0,04%	-6.632,68	5.473,43	7.496,12	-10.566,92
SNGO18	1.548.234,34	45,59	40,58	0,00%	-343,84	284,03	461,56	-683,94
TBSP11	2.629.781,37	750,51	689,18	0,02%	-3.516,00	2.883,95	4.028,15	-5.749,81
UNEG11	4.776.000,97	218.169,57	205.624,16	6,19%	-709.084,42	2.140,99	275.034,78	-341.938,50
VAMO33	2.886.670,90	108.426,85	91.549,28	2,76%	-330.992,15	-41.014,73	95.531,40	-124.030,57
VCCS11	636.034,81	538,55	498,81	0,02%	-2.184,81	1.833,41	2.488,16	-3.423,85
VECS11	3.486.127,91	67,24	59,15	0,00%	-571,15	470,73	759,83	-1.128,16
VERDECS2	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
VXL14	3.302.894,07	151,05	136,29	0,00%	-976,88	795,59	1.238,17	-1.826,06
VVEO15	1.027.909,94	221,47	202,84	0,01%	-1.075,23	873,72	1.219,06	-1.754,72
VVEO16	1.078.668,44	277,98	254,90	0,01%	-1.300,95	1.062,63	1.479,80	-2.120,57
VVRT11	2.594.953,45	422,71	387,21	0,01%	-2.106,41	1.719,59	2.446,44	-3.525,71
Total Var:	270.366.443,53	4.298.529,18	3.319.502,04	99,97%	-11.716.386,56	5.524.673,82	6.487.060,46	-7.013.867,50

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2024



Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/01/2024

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

		Dados Gerais			
PL:	301.661.400,86	VAR / PL:	4,1248%	Limite Fundo:	0,00%
VAR:	12.442.882,15	ETL / PL:	5,1726%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	15.603.876,21	VAR / CDI:	0,0456%	Benchmark:	Dutacion DC: 1.992,11 Dutacion DU: 1.371,05

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (+):	148.849,73	CENARIO BRADESCO 1 (+):	13.007.245,24
Cenário Alta - 09999 (-):	(42.089.469,89)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(4.327.289,56)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-
Cenário Alta - 09999:	(42.089.469,89)	Cenário Baixa - 10000:	(4.178.439,84)	CENARIO BRADESCO 1:	13.007.245,24
				CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	(16.563.716,68)
				CENARIO BRADESCO 2:	(16.563.716,68)

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
ANEM11	11.110.414,97	431.282,51	429.845,84	3,45%	-1.439.556,19	-52.942,90	513.990,29	-643.762,99
ANET11	2.135.612,08	33.972,79	33.280,91	0,27%	-140.845,03	-33.164,53	27.389,89	-36.297,44
ASAB11	6.415.380,06	194.923,58	194.309,24	1,56%	-652.719,06	-93.891,53	180.497,85	-233.603,17
BRKP28	10.975.356,44	477.966,44	476.600,92	3,83%	-1.533.759,62	-145.319,67	501.114,38	-638.712,13
BTOW15	5.618.494,54	261.366,98	260.416,13	2,09%	-778.679,77	-73.960,93	245.178,06	-316.406,70
CAEC21	9.315.521,49	215.334,40	212.498,74	1,71%	-805.945,51	-155.737,01	182.220,87	-240.736,25
CABA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CART13	10.259.493,38	369.863,78	369.479,36	2,97%	-1.215.872,75	-130.732,76	371.876,57	-476.597,23
CBAN32	16.548.481,20	635.965,81	635.204,75	5,10%	-2.023.848,44	-220.935,76	617.899,87	-784.376,12
CBAN72	4.864.961,86	193.329,79	193.169,77	1,55%	-612.851,37	-63.766,98	190.403,06	-244.365,13
CJEN13	7.278.033,60	253.167,98	253.119,75	2,03%	-845.804,16	-88.451,90	259.955,68	-332.467,55
CNRD11	9.999.693,95	389.435,29	388.742,73	3,12%	-1.280.407,08	-106.802,57	417.421,78	-531.126,97
COMPROMISSADA_PRE	1.891.226,37	29,71	24,69	0,00%	-53,58	54,65	211,61	-322,09
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-164.598,64	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CONX12	9.802.261,94	227.414,14	224.601,53	1,81%	-843.611,22	-163.566,12	192.334,17	-253.578,85
CREDZM24	210.806,29	10.713,34	-2.819,76	-0,02%	0,00	0,00	0,00	0,00
CRMG15	9.154.645,74	236.438,01	234.204,55	1,88%	-832.163,14	-146.837,84	203.802,31	-266.555,81
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ERDV17	10.141.184,50	82.824,79	70.361,15	0,57%	-362.041,43	-133.676,84	30.198,21	-40.802,81
ERDV38	6.129.476,28	50.029,30	46.008,14	0,37%	-367.065,28	-133.785,32	39.981,72	-53.756,46
GBSP11	10.314.298,80	470.889,70	459.617,70	3,69%	-1.584.308,80	78.027,57	663.534,43	-806.983,12
GRRB24	8.663.169,61	242.920,81	238.236,23	1,91%	-803.180,62	-128.257,23	199.759,16	-263.022,30
HARG11	11.188.279,52	414.550,96	413.335,01	3,32%	-1.370.486,95	-83.367,83	465.950,46	-588.637,31
HVRD15	11.639.617,23	475.196,25	475.004,28	3,82%	-1.527.148,91	-129.956,71	492.333,88	-629.044,24
IPIL11	8.092.207,43	245.704,36	245.571,54	1,97%	-839.618,18	-103.596,43	243.263,89	-312.508,74
IRBR12	11.767.900,97	134.102,16	124.295,34	1,00%	-830.231,14	-263.563,68	120.803,74	-161.714,67
ITPO14	8.885.070,05	386.718,92	385.848,45	3,10%	-1.241.782,90	-68.298,62	429.753,38	-543.642,06
LAMEA6	9.620.923,15	339.368,42	337.314,22	2,71%	-1.049.942,10	-127.287,40	304.584,20	-394.967,49
LCAMD1	11.769.699,39	441.196,35	438.319,17	3,52%	-1.361.794,52	-165.861,79	397.616,92	-515.327,80
LORTA7	6.680.944,50	256.406,16	254.752,78	2,05%	-785.981,71	-92.495,40	231.307,38	-299.814,87
MOVI37	9.077.710,27	332.616,11	330.321,23	2,65%	-1.032.477,50	-128.484,59	299.071,75	-387.762,02
MTRJ19	8.517.696,21	232.203,93	230.414,57	1,85%	-800.182,65	-131.499,78	203.898,08	-266.089,02
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PASN12	4.224.550,20	89.503,60	88.184,90	0,71%	-335.560,39	-67.821,19	74.346,01	-97.874,10
PEJA11	5.198.331,96	171.674,35	170.821,13	1,37%	-558.600,75	-76.401,58	156.285,23	-202.889,54
QUAT12	3.491.656,56	31.990,53	27.396,39	0,22%	-217.440,27	-81.089,07	23.838,08	-32.082,82
RAHD11	13.703.098,33	521.415,29	518.192,17	4,16%	-1.752.714,66	-52.385,02	633.985,63	-790.929,36
RDVE11	7.962.046,44	271.168,75	270.945,32	2,18%	-920.508,42	-74.646,17	297.265,74	-376.656,68
RMSA12	11.910.673,65	589.835,36	577.556,79	4,64%	-1.953.108,32	66.543,59	802.054,79	-983.717,28
RSAN44	11.031.221,35	260.420,68	258.071,72	2,07%	-961.762,00	-178.523,78	227.975,69	-298.818,95
TGH11	10.463.662,10	410.492,33	406.967,00	3,27%	-1.380.861,51	-12.740,16	618.708,53	-642.742,55
UNEG11	9.422.506,86	430.423,76	425.000,39	3,42%	-1.398.942,94	4.223,92	542.612,35	-674.605,78
UTPS21	6.690.783,17	280.183,71	279.662,90	2,25%	-894.311,96	-53.441,60	307.051,46	-388.836,31
VAMO33	8.884.930,80	333.728,74	330.597,90	2,66%	-1.018.766,06	-126.239,91	294.037,64	-381.755,68
VAMO34	7.492.175,72	277.101,31	275.464,07	2,21%	-862.709,74	-107.172,66	250.664,66	-324.819,75
VERDECS2	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
VERO12	8.511.840,17	225.424,04	222.318,64	1,79%	-773.569,00	-131.297,32	189.943,96	-249.553,66
VIMT13	7.374.012,45	283.708,61	283.447,89	2,28%	-920.308,70	-66.882,91	305.397,89	-387.652,89
VRDN12	10.106.903,78	357.203,50	357.097,00	2,87%	-1.178.745,55	-132.406,09	356.724,00	-457.800,03
Total Var:	374.391.266,76	12.569.807,29	12.442.882,15	99,98%	-42.089.469,89	-4.178.439,84	13.007.245,24	-16.563.716,68

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2024



bradesco

Data: 31/01/2024

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIRF EMB II A CRED PRIV
CNPJ: 20725957000102

Dados Gerais		Limites	
PL:	213.756.370,96	VAR / PL:	0,3189%
VAR:	681.643,52	ETL / PL:	0,3999%
ETL:	854.808,47	VAR / CDI:	0,0035%
		Status:	ENQUADRADO
		Benchmark:	0,00% Dutation DC: Dutation DU:
			740,42 510,89

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	763.530,89	Cenário Baixa - 10000 (+):	3.727.655,52	CENARIO BRADESCO 1 (+):	4.044.785,65	CENARIO BRADESCO 2 (+):	1.155.615,08
Cenário Alta - 09999 (-):	(3.050.718,59)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(1.334.425,78)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(2.276.084,74)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(3.582.396,08)
Cenário Alta - 09999:	(2.287.187,70)	Cenário Baixa - 10000:	2.393.229,74	CENARIO BRADESCO 1:	1.768.700,91	CENARIO BRADESCO 2:	(2.426.881,00)

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
CAIXA	8.999,86	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CDB323RSIT1	6.413.647,26	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	6.680.322,57	104,94	76,19	0,01%	-189,27	193,02	747,48	-1.137,69
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-41.326,91	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPGT16	143.393,54	5,40	-3,33	0,00%	89,12	-78,68	-148,35	226,09
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DIF26	1.360,03	38.344,51	34.325,42	5,04%	-172.893,45	138.899,84	186.664,27	-268.377,87
DIF27	-6.878,97	107.893,02	-91.930,92	-13,49%	425.676,27	-351.225,15	-462.052,90	644.316,01
DIF29	-3.062,20	36.356,72	-30.328,26	-4,48%	130.356,21	-113.335,71	-153.180,81	200.044,65
DIF33	-3.984,51	57.571,08	-46.130,06	-6,77%	189.681,35	-178.448,79	-252.384,40	288.621,36
DHN25	2.401,85	76.947,99	69.949,31	10,26%	-406.491,42	324.002,87	456.087,58	-665.697,81
ERDV18	1.371.708,92	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
IDIN24P400700	-11.105,36	14.875,71	-8.798,46	-1,29%	11.105,36	-686.093,33	-1.400.696,38	11.105,36
IDIN24P400800	24.956,99	26.040,96	15.402,32	2,26%	-24.956,99	706.295,70	1.421.077,09	-24.956,99
LF002200USM	10.245.832,11	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002200USN	10.742.133,53	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306J15	10.652.403,68	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306SWQ	10.663.241,51	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306U55	6.400.879,93	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024000XE	10.245.602,13	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024000XG	10.227.213,12	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024000XN	10.204.760,22	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024002C7	6.585.607,28	111.098,87	94.662,49	13,89%	-438.324,51	361.661,20	475.782,00	-663.460,74
LF0024002SX	4.368.363,86	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024002TZ	10.191.978,53	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF00240033U	6.527.589,74	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20260301 - 210100	187.054,54	61,49	-26,27	0,00%	-977,86	1.757,30	37,89	-57,67
LFT20260901 - 210100	1.696.413,61	621,86	-197,19	-0,03%	-9.873,08	20.969,13	718,76	-1.093,70
LTN20250401 - 100000	538.049,26	2.384,30	2.229,59	0,33%	-13.337,22	10.382,92	15.214,11	-22.360,90
NTNB20240815 - 760199_NEGOCIACAO	13.361.974,22	31.035,02	-4.376,56	-0,64%	-103.850,09	102.180,93	67.229,89	-90.681,56
NTNB20250815 - 760199_NEGOCIACAO	22.202.599,83	87.381,90	72.715,85	10,67%	-377.649,72	386.569,38	224.826,30	-301.432,02
NTNB20260815 - 760199_NEGOCIACAO	24.653.785,77	225.726,64	225.194,46	33,04%	-626.507,56	671.916,06	454.877,20	-603.393,54
NTNB20270815 - 760199_NEGOCIACAO	5.384.260,45	65.222,60	64.819,62	9,51%	-168.669,19	184.391,89	128.883,39	-169.829,11
NTNB20280815 - 760199_NEGOCIACAO	14.447.325,30	241.157,34	233.932,69	34,32%	-573.124,05	619.617,71	461.328,41	-601.153,79
NTNB20500815 - 760199_NEGOCIACAO	1.238.618,13	56.892,34	51.113,43	7,50%	-133.874,19	198.817,58	151.311,30	-168.762,67
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
TERMO_RF_PRE	-269.079,17	1.090,36	-986,79	-0,14%	6.620,58	-5.244,12	-7.621,91	11.201,61
Total Var:	205.097.020,68	1.180.815,05	681.643,52	100,02%	-2.287.187,70	2.393.229,74	1.768.700,91	-2.426.881,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2024

Relatório de Risco de Mercado



Data: 31/01/2024

FUNDO: FIM EMB III A IMOBILIÁRIO
CNPJ: 32711990000162

Dados Gerais							
PL:	70.691.401,19	VAR / PL:	4,5291%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	1,00
VAR:	3.201.713,04	ETL / PL:	5,6797%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1,00
ETL:	4.015.077,31	VAR / CDI:	0,0501%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	38.334.986,70	Cenário Baixa - 10000 (+):	6,71	CENARIO BRADESCO 1 (+):	9.103.367,54	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
Cenário Alta - 09999 (-):	(6,58)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(38.334.986,70)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(9.177.896,86)
Cenário Alta - 09999:	38.334.980,12	Cenário Baixa - 10000:	(38.334.979,99)	CENARIO BRADESCO 1:	9.103.367,54	CENARIO BRADESCO 2:	(9.177.896,86)

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
AIEC11	1.822.002,70	163.617,83	146.663,43	4,58%	911.001,35	-911.001,35	267.105,60	-269.292,00
BMLC11	3.816.615,52	93.717,50	-28.966,82	-0,91%	3.816.615,52	-3.816.615,52	559.515,84	-564.095,77
BPML11	2.739.409,65	180.094,75	-140.199,26	-4,38%	2.739.409,65	-2.739.409,65	401.597,46	-404.884,75
CAXA	999,43	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CECOC11	712.786,50	58.971,81	44.180,71	1,38%	356.393,25	-356.393,25	104.494,50	-105.349,65
CNES11	376.761,00	43.455,35	10.442,99	0,33%	188.380,50	-188.380,50	55.233,16	-55.685,28
COMPROMISSADA_PRE	232.341,23	3,65	-0,02	0,00%	-6,58	6,71	26,00	-39,57
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-560.312,09	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
FVPQ11	1.116.604,65	72.575,10	15.879,10	0,50%	558.302,33	-558.302,33	163.694,24	-165.034,17
HBRH11	4.031.066,00	165.673,75	-112.541,23	-3,52%	4.031.066,00	-4.031.066,00	590.954,28	-595.791,56
MALL11	4.426.180,00	95.269,75	78.736,84	2,46%	2.213.090,00	-2.213.090,00	648.877,99	-654.189,40
MAXR11	1.805.159,02	72.622,27	45.368,68	1,42%	902.579,51	-902.579,51	264.636,31	-266.802,50
NEWL11	7.287.417,28	508.898,93	385.655,07	12,05%	3.643.708,64	-3.643.708,64	1.068.335,37	-1.077.080,27
NEWU11	1.734.600,00	142.271,92	-62.647,30	-1,96%	1.734.600,00	-1.734.600,00	254.292,36	-256.373,88
OULG11	197.345,25	20.793,87	18.514,11	0,58%	98.672,63	-98.672,63	28.930,81	-29.167,63
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PATC11	4.383.600,54	1.475.385,43	1.243.964,05	38,85%	2.191.800,27	-2.191.800,27	642.635,84	-647.896,16
PVBH11	2.501.421,07	92.238,84	86.840,19	2,71%	0,00	0,00	0,00	0,00
QAGR11	5.475.195,20	209.228,68	169.516,21	5,29%	2.737.597,60	-2.737.597,60	802.663,62	-809.233,85
RBRL11	2.251.818,80	104.591,65	88.953,23	2,78%	2.251.818,80	-2.251.818,80	330.116,64	-332.616,82
RCRB11	6.420.488,00	435.938,58	301.549,20	9,42%	0,00	0,00	0,00	0,00
TEPP11	5.843.074,22	292.000,96	257.450,05	8,04%	2.921.537,11	-2.921.537,11	856.594,68	-863.606,37
TRXF11	9.412.302,90	383.704,16	348.302,55	10,88%	4.706.151,45	-4.706.151,45	1.379.843,61	-1.391.138,37
XPIN11	2.494.879,00	79.016,98	9.106,67	0,28%	1.247.439,50	-1.247.439,50	365.749,26	-368.743,12
XPPR11	2.169.645,20	418.220,40	294.964,69	9,21%	1.084.822,60	-1.084.822,60	318.069,99	-320.673,56
Total Var:	70.691.401,07	5.108.292,04	3.201.713,04	99,99%	38.334.980,12	-38.334.979,99	9.103.367,54	-9.177.896,87

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2024



Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/01/2024

FUNDO: FIA RVA EMB II
CNPJ: 13294268000125

Dados Gerais					
PL:	110.132.666,21	VAR / PL:	8,5172%	Limite Fundo:	0,00%
VAR:	9.380.229,61	ETL / PL:	10,6809%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	11.763.186,37	VAR / CDt:	0,0942%	Benchmark:	
				Dutacion DC:	1,00
				Dutacion DU:	1,00

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	28.674.317,10	Cenário Baixa - 10000 (+):	100,43	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	15.741.705,07
Cenário Alta - 09999 (-):	(98,47)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(29.088.147,89)	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	-
Cenário Alta - 09999:	28.674.218,63	Cenário Baixa - 10000:	(29.088.047,46)	CENÁRIO BRADESCO 1:	15.741.705,07
				CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	-
				CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(15.870.443,72)
				CENÁRIO BRADESCO 2:	(15.870.443,72)

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

Produto	MtM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
ABEV3	2.820.113,40	236.402,03	224.379,93	2,39%	394.815,88	-846.055,58	413.428,62	-416.812,76
AZUL4	789.260,00	219.888,24	169.428,49	1,81%	473.556,00	-276.241,00	116.705,52	-116.652,63
B3SA3	2.746.352,61	409.499,77	396.342,32	4,23%	686.338,15	-686.339,13	402.468,69	-405.763,12
BBAS3	3.296.680,00	157.273,69	104.901,34	1,12%	624.170,00	-624.170,00	483.293,29	-487.249,30
BBDC4	4.204.056,00	678.193,12	658.619,54	7,02%	1.051.014,50	-1.051.014,50	616.314,90	-621.359,77
BBSE3	551.425,00	32.407,56	-817,60	-0,01%	110.295,00	-110.295,00	80.839,91	-81.500,62
BPAC11	3.670.438,00	340.135,37	305.426,24	3,26%	1.101.131,40	-1.284.653,30	538.086,21	-542.490,74
BRFS3	541.329,75	117.034,75	46.511,34	0,50%	135.332,44	-135.332,44	79.359,94	-80.008,54
BRIT3	316.210,00	51.491,53	42.797,53	0,46%	148.618,70	-148.618,70	46.356,39	-46.735,84
BRSR6	368.750,00	36.203,75	-12.098,79	-0,13%	92.187,50	-92.187,50	54.058,75	-54.501,25
CAIXA	9.999,89	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CBAV3	511.344,00	145.990,03	125.108,57	1,33%	204.537,60	-204.537,60	74.963,03	-75.576,64
CIEL3	842.912,00	91.265,76	69.810,75	0,74%	252.873,60	-210.728,00	123.570,90	-124.582,39
CMG4	1.188.864,00	174.185,26	-50.213,72	-0,54%	297.216,00	-356.659,20	174.287,46	-175.714,10
COMPROMISSADA_PRE	3.475.751,01	54,60	46,59	0,00%	-98,47	100,43	388,91	-591,94
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	1.810.376,98	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPFE3	1.062.418,00	107.350,39	104.456,81	1,11%	212.480,67	-212.483,60	155.750,48	-157.025,38
CPLE6	1.131.521,00	96.086,91	93.325,87	0,99%	248.934,62	-248.934,62	165.880,98	-167.238,80
CRFB3	576.714,00	127.421,22	119.829,63	1,28%	144.178,50	-144.178,50	84.546,27	-85.238,33
CSAN3	1.545.642,00	180.238,24	146.248,12	1,59%	398.410,50	-398.410,50	226.591,12	-228.445,69
CURY3	595.700,00	35.674,04	14.508,42	0,15%	178.710,00	-178.710,00	87.329,62	-88.044,48
CXSE3	1.059.750,00	77.434,28	-44.103,66	-0,47%	211.950,00	-211.950,00	155.359,35	-156.631,05
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DIRR3	856.347,00	86.999,17	71.017,08	0,76%	256.904,10	-256.908,03	125.540,47	-126.568,09
ECOR3	555.991,00	99.647,71	87.935,51	0,94%	138.997,75	-138.997,75	81.508,28	-82.175,47
ELET3	2.208.718,82	213.105,24	188.021,93	2,00%	662.615,65	-662.615,65	323.798,18	-326.448,64
ELET6	1.274.352,00	111.577,85	100.077,77	1,07%	382.305,60	-382.305,60	186.820,00	-188.349,23
ENEV3	514.228,00	62.429,79	58.393,89	0,62%	190.264,36	-262.256,28	75.385,83	-76.002,90
ENGH11	551.649,00	50.391,91	42.245,65	0,45%	93.780,33	-121.362,78	80.871,74	-81.533,72
EQTL3	2.919.432,00	163.013,81	136.547,67	1,46%	583.886,40	-583.886,40	427.988,73	-431.492,05
GGPS3	636.696,00	60.584,88	39.239,61	0,42%	286.513,20	-286.513,20	93.339,63	-94.103,67
GMAT3	226.352,00	26.370,67	12.703,40	0,14%	40.743,36	-36.219,61	33.183,20	-33.454,83
GOAU4	850.278,00	93.618,12	85.768,04	0,91%	255.083,40	-212.569,50	124.650,76	-125.671,09
HAPV3	628.513,44	88.895,79	77.326,70	0,82%	213.694,57	-213.710,17	92.140,07	-92.894,29
ITSA4	2.218.440,00	221.274,34	217.333,85	2,32%	421.481,42	-421.503,60	325.223,30	-327.885,43
ITUB4	8.953.430,86	928.554,26	914.069,10	9,74%	1.790.686,17	-1.701.151,86	1.312.572,96	-1.323.317,08
JBSS3	2.045.439,00	298.054,77	266.665,27	2,84%	715.903,65	-715.903,65	299.861,36	-302.315,88
LJQ3	357.700,00	111.341,44	107.889,91	1,15%	160.965,00	-160.965,00	52.438,82	-52.868,06
LREN3	877.132,50	176.385,06	165.451,54	1,76%	175.426,50	-175.426,50	128.587,63	-129.640,18
MRF3	931.590,00	186.090,30	138.952,59	1,48%	372.636,00	-279.477,00	136.571,09	-137.689,00
MULT3	663.068,00	55.435,17	51.038,62	0,54%	198.920,40	-165.767,00	97.205,77	-98.001,45
ONCO3	1.062.803,00	187.973,70	135.109,52	1,44%	371.981,05	-371.981,05	155.806,92	-157.082,28
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PETR3	3.722.728,00	249.445,71	-104.528,01	-1,11%	930.682,00	-1.116.818,40	545.751,93	-550.219,20
PETR4	9.682.071,55	602.464,24	-168.272,72	-1,79%	2.420.517,89	-2.904.621,47	1.419.391,69	-1.431.010,18
PRIO3	2.363.434,00	156.841,53	36.367,14	0,39%	1.418.060,40	-1.418.060,40	346.479,42	-349.315,55
RADL3	1.940.408,80	267.644,70	253.387,05	2,70%	388.081,76	-388.081,76	284.463,93	-286.792,42
RAIL3	1.143.776,00	55.340,34	12.242,94	0,13%	514.699,20	-377.451,04	167.677,56	-169.050,09
RDOR3	537.570,00	63.212,28	56.396,05	0,60%	161.271,00	-161.271,00	78.807,76	-79.452,85
RECV3	271.990,00	30.390,58	-14.265,25	-0,15%	163.194,00	-163.194,00	39.873,73	-40.200,12
RENT3	3.333.792,00	531.274,21	517.361,72	5,52%	1.100.151,36	-868.785,92	488.733,91	-492.734,46
RRR3	199.874,00	34.977,79	-26.116,52	-0,28%	119.924,40	-119.924,40	29.301,53	-29.541,38
SBFG3	616.907,00	137.005,77	73.490,94	0,78%	234.424,66	-246.762,80	90.438,57	-91.178,86
SBSF3	1.916.298,00	108.955,29	70.409,65	0,75%	479.074,50	-479.074,50	280.929,29	-283.228,84
SUZB3	960.132,00	86.625,35	58.414,31	0,62%	240.033,00	-192.026,40	140.755,35	-141.907,51
TIMS3	653.718,00	69.116,84	57.885,70	0,62%	209.189,76	-150.355,14	95.835,06	-96.619,52
TOTS3	1.027.016,16	187.108,38	154.255,07	1,64%	205.403,23	-205.403,23	150.560,57	-151.792,99
VALE3	15.909.709,20	2.516.929,59	2.417.527,47	25,77%	3.977.427,30	-3.977.427,30	2.332.363,37	-2.351.455,02
VBBR3	2.037.750,00	118.436,47	52.123,79	0,56%	509.437,50	-509.437,50	298.734,15	-301.179,45
WEGE3	1.772.232,00	223.382,61	201.739,78	2,15%	443.058,00	-443.058,00	259.809,21	-261.935,89
WING24	6.520,00	225.874,99	225.632,87	2,41%	462.069,66	-461.872,24	373.235,65	-375.975,25
YDUQ3	589.968,00	103.195,04	95.882,31	1,02%	230.087,52	-147.492,00	86.489,31	-87.197,27
Total Var:	110.132.664,97	12.304.166,22	9.380.229,61	99,99%	28.674.218,63	-29.088.047,46	15.741.705,07	-15.870.443,72

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2024



bradesco

Data: 31/01/2024

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIA RVA EMB III
CNPJ: 38452593000108

Dados Gerais					
PL:	114.717.216,81	VAR / PL:	7,7091%	Limite Fundo:	0,00%
VAR:	8.843.647,37	ETL / PL:	9,6675%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	11.090.290,58	VAR / CDI:	0,0853%	Benchmark:	
				Dutacion DC:	1,00
				Dutacion DU:	1,00

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	33.486.114,86	Cenário Baixa - 10000 (+):	1.008.710,83	CENARIO BRADESCO 1 (+):	15.482.145,25	CENARIO BRADESCO 2 (+):	1.301.503,31
Cenário Alta - 09999 (-):	(993.039,84)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(32.006.338,84)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(1.294.510,12)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(15.609.100,34)
Cenário Alta - 09999:	32.493.075,02	Cenário Baixa - 10000:	(30.997.628,01)	CENARIO BRADESCO 1:	14.187.635,13	CENARIO BRADESCO 2:	(14.307.597,03)

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

Produto	MtM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
ALOS3	4.155.185,70	502.033,20	460.562,86	5,21%	0,00	0,00	0,00	0,00
ALPA4	499.356,00	102.941,96	90.272,62	1,02%	124.839,00	-124.839,00	73.205,59	-73.804,82
BBAS3	2.202.848,35	105.090,60	65.315,83	0,74%	550.712,09	-550.712,09	322.937,57	-325.580,99
BBSE3	3.527.750,00	207.327,89	16.461,24	0,19%	705.550,00	-705.550,00	517.168,15	-521.401,45
EPAC11	2.494.335,42	230.220,58	211.174,30	2,39%	745.300,63	-869.517,40	364.203,57	-367.164,78
CAXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CIEL3	1.014.377,00	109.831,03	87.441,91	0,99%	304.313,10	-253.594,25	148.707,67	-149.924,92
COMPROMISSADA_PRE	3.920.016,63	61,58	50,63	0,00%	-111,06	113,27	438,62	-667,60
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	1.017.067,27	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPLE3	590.880,81	55.473,11	53.198,51	0,60%	129.993,78	-129.993,78	86.623,13	-87.332,18
CPLE6	1.454.749,04	123.534,90	120.612,21	1,36%	320.044,79	-320.044,79	213.266,21	-215.011,91
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DOLH24	14.885,36	306.198,13	215.056,36	2,43%	-965.347,43	980.580,96	-1.258.551,51	1.265.350,44
ELET3	8.598.177,28	829.583,48	711.590,96	8,05%	2.579.453,18	-2.579.453,18	1.260.492,79	-1.270.810,60
ENAT3	1.036.816,00	256.721,75	2.086,49	0,02%	362.885,60	-362.885,60	151.997,23	-153.241,41
ENEV3	6.056.087,40	735.238,55	680.131,30	7,69%	2.240.752,34	-3.088.604,57	887.822,41	-895.089,72
ENJU3	184.728,00	19.700,66	1.944,58	0,02%	83.116,86	-49.876,56	27.081,13	-27.302,80
EQTL3	9.706.154,79	541.967,50	453.286,24	5,13%	1.941.230,96	-1.941.230,96	1.422.922,29	-1.434.569,68
FLRY3	1.373.188,00	232.828,87	206.899,68	2,36%	274.629,16	-274.637,60	201.309,96	-202.967,19
HAPO3	2.500.392,28	353.650,89	305.851,03	3,46%	850.133,38	-850.197,82	366.557,51	-369.557,98
IGTI11	7.481.771,16	781.069,43	718.717,73	8,13%	1.496.354,23	-1.496.354,23	1.096.827,65	-1.106.805,78
ITSA4	3.734.000,00	372.441,17	362.487,89	4,10%	709.422,66	-709.460,00	547.404,40	-551.885,20
ITUB4	3.360.048,34	348.468,34	333.984,73	3,78%	672.009,67	-638.409,19	492.583,09	-496.615,15
LREN3	1.712.165,85	344.304,29	321.196,36	3,63%	342.433,17	-342.433,17	251.003,51	-253.058,11
LWSA3	99.038,94	10.765,91	7.169,07	0,08%	39.613,76	-39.617,39	14.519,11	-14.637,96
MGLU3	3.036.432,00	654.832,88	428.940,31	4,85%	1.578.944,64	-1.366.394,40	445.140,93	-448.784,65
NTCO3	3.031.504,00	436.379,49	285.228,47	3,23%	757.876,00	-757.876,00	444.418,49	-448.056,29
ONCO3	554.002,00	97.984,11	78.133,51	0,88%	193.900,70	-193.900,70	81.216,69	-81.881,50
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PETRA	473.265,00	29.448,78	-6.521,94	-0,07%	118.316,25	-141.979,50	69.380,65	-69.948,57
PRI03	5.148.596,00	341.669,66	78.027,05	0,88%	3.089.157,60	-3.089.157,60	754.784,17	-760.962,49
RAIL3	8.195.385,64	396.524,67	127.874,18	1,45%	3.687.923,54	-2.704.512,80	1.201.443,54	-1.211.278,00
RECV3	3.906.029,95	436.006,28	-156.831,56	-1,77%	2.343.617,97	-2.343.617,97	572.623,99	-577.311,23
RENT1	3.393,00	2.423,02	1.428,18	0,02%	0,00	0,00	0,00	0,00
RENT3	5.925.111,72	944.227,79	912.963,47	10,32%	1.955.286,87	-1.540.829,05	868.621,38	-878.731,51
SBSPP	1.208.923,80	68.735,99	52.394,05	0,59%	302.230,95	-302.230,95	177.228,23	-178.678,94
SCAR3	183.296,00	27.757,47	2.814,01	0,03%	109.977,60	-109.977,60	26.871,19	-27.091,15
SMFT3	2.226.150,00	296.279,73	276.520,98	3,13%	890.450,82	-890.460,00	326.353,69	-329.024,97
SOMA3	3.089.592,00	564.339,26	415.624,75	4,70%	926.877,60	-926.916,61	452.934,19	-456.641,70
SUZB3	8.822.219,34	795.961,25	561.145,50	6,35%	2.205.554,84	-1.764.443,87	1.293.337,36	-1.303.924,02
WDOH24	425,30	8.748,62	6.144,47	0,07%	-27.581,36	28.016,60	-36.958,62	36.152,87
YDUQ3	2.187.720,88	382.668,12	352.449,41	3,99%	853.211,14	-546.930,22	320.719,88	-323.345,15
Total Var:	114.717.066,24	12.053.440,84	8.843.647,37	100,03%	32.493.075,02	-30.997.628,01	14.187.635,13	-14.307.597,04

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2024



Relatório de Risco de Mercado

Data: 31/01/2024

FUNDO: FIA RVA EMB IV
CNPJ: 38452613000132

Dados Gerais					
PL:	107.907.140,92	VAR / PL:	6,2449%	Limite Fundo:	0,00%
VAR:	6.738.732,73	ETL / PL:	7,8314%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	8.450.642,71	VAR / CDt:	0,0691%	Benchmark:	
				Dutacion DC:	1,00
				Dutacion DU:	1,00

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	29.476.666,52	Cenário Baixa - 10000 (+):	240,78	CENARIO BRADESCO 1 (+):	14.782.917,67
Cenário Alta - 09999 (-):	(236,09)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(27.697.371,60)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-
Cenário Alta - 09999:	29.476.430,42	Cenário Baixa - 10000:	(27.697.130,82)	CENARIO BRADESCO 1:	14.782.917,67
				CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	(14.904.402,94)
				CENARIO BRADESCO 2:	(14.904.402,94)

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

Produto	MtM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
AURE3	1.496.325,40	85.850,12	66.348,91	0,98%	374.081,35	-463.872,23	219.361,30	-221.156,89
CAIXA	1.000,17	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	8.333.210,21	130,91	106,62	0,00%	-236,09	240,78	932,42	-1.419,18
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-1.261.139,23	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPLES	2.358.984,42	221.466,32	212.054,87	3,19%	518.976,57	-518.976,57	345.827,12	-348.657,90
CPLES6	5.298.921,96	449.975,77	430.352,65	6,39%	1.165.762,83	-1.165.762,83	776.821,96	-783.180,67
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ENGH1	9.953.974,80	909.273,45	821.561,47	12,19%	1.692.175,72	-2.189.874,46	1.459.252,71	-1.471.197,48
ENGH4	16,74	1,38	1,15	0,00%	13,39	-13,39	2,45	-2,47
EQTL3	9.594.089,70	535.710,06	484.086,62	7,18%	1.918.817,94	-1.918.817,94	1.406.493,55	-1.418.006,46
GGPS3	7.039.333,92	669.828,61	411.280,44	6,10%	3.167.700,26	-3.167.700,26	1.031.966,35	-1.040.413,55
GMAT3	7.728.297,12	900.369,05	442.922,08	6,57%	1.391.093,48	-1.236.639,87	1.132.968,36	-1.142.242,31
HAPV3	5.713.703,52	808.135,72	752.257,02	11,16%	1.942.659,20	-1.942.806,46	837.628,94	-844.485,38
ITUB4	12.110.866,02	1.256.009,73	1.188.889,67	17,64%	2.422.173,20	-2.301.064,54	1.775.452,96	-1.789.986,00
MATD3	1.013.184,38	210.684,12	184.182,38	2,73%	303.955,31	-303.970,62	148.532,83	-149.748,65
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PRI03	7.668.860,10	508.918,70	113.013,58	1,68%	4.601.316,06	-4.601.316,06	1.124.254,89	-1.133.457,52
RAIL3	9.998.608,46	483.771,61	180.690,12	2,68%	4.499.373,81	-3.299.584,15	1.465.796,00	-1.477.794,33
RENT1	1.971,00	1.407,54	735,21	0,01%	0,00	0,00	0,00	0,00
RENT3	3.304.188,36	526.556,57	500.326,37	7,42%	1.090.362,16	-859.089,97	484.394,01	-488.359,04
UGPA3	13.206.039,66	1.159.763,55	815.648,25	12,10%	3.301.509,92	-2.641.207,93	1.936.005,41	-1.951.852,66
VBBR3	4.346.701,25	252.635,48	134.275,33	1,99%	1.086.675,31	-1.086.675,31	637.226,40	-642.442,45
Total Var:	107.907.137,96	8.880.488,69	6.738.732,73	99,97%	29.476.430,42	-27.697.130,82	14.782.917,67	-14.904.402,94



bradesco

Data: 31/01/2024

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO:		FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI						
CNPJ:		41901871000163						
Dados Gerais								
PL:	117.061.010,47	VAR / PL:	8,6571%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	6,44	
VAR:	10.134.099,04	ETL / PL:	10,8564%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	4,74	
ETL:	12.708.569,05	VAR / CDI:	0,0958%	Benchmark:				
Cenários de STRESS								
Cenário Alta - 09999 (+):	29.894.960,75	Cenário Baixa - 10000 (+):	7.407,93	CENARIO BRADESCO 1 (+):	16.955.991,87	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-	
Cenário Alta - 09999 (-):	(4.638,35)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(30.415.592,05)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(17.094.361,88)	
Cenário Alta - 09999:	29.890.322,40	Cenário Baixa - 10000:	(30.408.184,12)	CENARIO BRADESCO 1:	16.955.991,87	CENARIO BRADESCO 2:	(17.094.361,88)	
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
SUZB3	1.798.389,18	162.254,88	106.293,23	1,05%	449.597,30	-359.677,84	263.643,85	-265.801,92
TAE11	410.991,49	23.359,86	19.737,51	0,19%	102.747,87	-102.747,87	60.251,35	-60.744,54
TIMS3	714.095,88	75.500,52	64.063,55	0,63%	228.510,68	-164.242,05	104.696,46	-105.543,37
TOTS3	826.044,64	150.494,10	126.513,46	1,25%	165.208,93	-165.208,93	121.096,14	-122.089,40
TRPL4	516.707,36	55.592,36	32.611,74	0,32%	103.341,47	-123.176,84	75.749,30	-76.369,35
UGPA3	1.560.026,43	137.002,60	92.334,48	0,91%	390.006,61	-312.005,29	228.699,88	-230.571,91
USIM5	241.311,02	40.709,65	35.428,34	0,35%	94.111,30	-53.088,42	35.376,20	-35.665,77
VALE3	14.496.235,60	2.293.316,86	2.215.260,18	21,86%	3.624.058,90	-3.624.058,90	2.125.148,14	-2.142.543,62
VAM03	175.491,60	38.617,41	36.791,34	0,36%	61.422,06	-70.196,64	25.727,07	-25.937,66
VBBR3	1.349.142,50	78.413,78	35.518,82	0,35%	337.285,63	-337.285,63	197.784,29	-199.403,26
VIVT3	1.107.681,12	141.358,58	114.211,32	1,13%	166.150,01	-166.152,17	162.386,05	-163.715,27
WEGE3	2.442.413,82	307.856,29	275.851,29	2,72%	610.603,46	-610.603,46	358.057,87	-360.988,76
YDUQ3	284.360,72	49.739,34	46.057,39	0,45%	110.900,68	-71.090,18	41.687,28	-42.028,51
Total Var:	117.060.105,22	13.351.294,25	10.134.099,04	99,96%	29.890.322,40	-30.408.184,12	16.955.991,87	-17.094.361,88

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 – JANEIRO 2024



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/01/2024

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	642.462,63	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	237.574,19	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	142.544,52	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	20/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	474.849,13	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	25/08/17	25/08/17	15/08/24	PETR	9.341.296,63	AAA	Aaa.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	18/12/17	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	3.117.512,28	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	21/12/17	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	909.978,00	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/01/18	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	3.232.946,26	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB II	19/02/18	19/02/18	15/02/25	SABESP	9.977.507,75	brAAA	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/02/18	19/02/18	15/02/25	SABESP	6.192.133,51	brAAA	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	13/03/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	12.556.888,94	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB II	23/05/18	23/05/18	15/05/28	COMGAS	26.195.356,51	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	618.177,56	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	618.177,56	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	618.177,56	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	616.952,93	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	618.177,56	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	04/07/18	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	12.730.356,78	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/07/18	26/07/18	15/07/25	AEGEA SA	14.658.660,12	brA	Aa1.br	AA(bra)
FI RF EMB II	26/07/18	26/07/18	15/07/25	CSMG	7.953.121,60	-	Aa3.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/02/13	15/02/25	CEMIG	1.418.766,45	brA+	A1.br	AA-(bra)
FIM EMB I A	12/02/19	09/01/19	15/01/25	ITALUBB	2.489.379,39	-	AAA.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	576.282,04	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	3.648.862,74	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	2.077.940,05	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	6.282.305,44	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	727.606,23	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	5.886.995,90	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	8.731.274,82	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	899.585,89	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	630.308,48	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	30/09/20	28/09/20	22/09/25	HAPVIDA	177.204,49	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB II A CRED PRV	08/01/21	22/05/19	15/04/24	ECORODOV	1.369.341,78	-	-	AA(bra)
FI RF EMB II A CRED PRV	05/02/21	07/08/19	15/07/24	COPEL GT	143.055,13	-	-	AA+(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	6.101.861,54	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	6.114.203,25	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	4.345.959,90	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/07/19	15/06/29	NEOENERG	630.447,11	brAA+	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/07/19	15/06/29	NEOENERG	6.266.958,92	brAA+	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	1.799.643,17	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	3.449.252,30	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	3.690.355,53	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	31/07/20	15/07/34	IGUA SAN	2.585.230,36	brAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	23/05/18	15/05/28	COMGAS	22.813.088,74	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	240.222,28	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	422.791,22	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	480.444,57	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	240.222,28	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	294.032,08	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	247.547,21	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	718.222,09	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	26/10/16	27/01/25	BRDESCO	14.587.626,02	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	12/12/17	15/11/24	CCR	3.159.162,11	brAAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	14/12/17	15/11/24	ECORODOV	2.105.547,20	brAA	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	19/02/18	15/02/25	SABESP	1.454.222,04	brAAA	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	23/05/18	15/05/28	COMGAS	10.139.017,33	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	28/06/18	15/06/27	JAGUARA	1.581.781,05	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	28/06/18	15/06/27	ENERGMIR	1.008.552,88	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	31/07/18	01/08/25	BRDESCO	4.706.030,04	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	28/05/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	182.415,12	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	28/05/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	334.970,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	28/05/21	22/12/20	15/12/26	IRB	2.664.714,77	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	28/05/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	164.000,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	28/05/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	888.769,78	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	28/05/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	76.875,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	28/05/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	1.375.748,15	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	28/05/21	07/04/21	15/03/31	LOCALIZA	5.459.772,45	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	28/05/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	1.649.569,87	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	09/06/21	06/01/21	15/11/25	QUATA	574.589,21	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	19.968,94	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	215.936,06	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	539.161,45	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	337.613,11	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	337.613,11	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	304.959,98	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	619.837,37	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	610.539,81	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	877.016,90	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	218.998,98	-	-	AA

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2024



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/01/2024

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	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	134.790,36	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	337.332,49	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	1.012.144,66	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	14/06/21	19/06/19	19/06/24	BNBBM	603.957,31	brAAA	AAb	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	14/06/21	12/06/19	12/06/24	BNBBM	915.490,21	brAAA	AAb	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	15/06/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	83.230,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	16/06/21	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	401.925,49	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	17/06/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	832.667,09	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	17/06/21	18/03/21	15/02/26	CORSAN	802.037,66	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	18/06/21	18/06/21	15/12/30	MG050	518.528,85	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	25/06/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	50.225,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	25/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	747.126,27	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	25/06/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	260.350,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	25/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	85.355,75	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	25/06/21	25/06/21	20/06/26	OURO VER	1.434.831,65	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	30/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	3.161.324,11	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	01/07/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	2.765.104,82	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/07/21	01/03/21	18/02/25	RENNER	1.168.434,46	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/07/21	01/03/21	18/02/25	RENNER	247.107,38	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	07/07/21	07/04/21	15/03/29	CAGECE	1.268.515,68	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	08/07/21	08/07/21	15/06/31	VAMOS	265.342,14	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	08/07/21	07/04/21	15/03/29	CAGECE	2.891.008,74	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	08/07/21	08/07/21	15/06/31	VAMOS	5.264.725,03	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	12/07/21	12/07/21	12/07/26	BRADESCO	4.332.088,95	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	2.093.021,03	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	227.179,57	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	1.016.610,21	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	299.710,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	528.637,31	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	264.450,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	387.860,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	193.930,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	1.911.441,89	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	298.802,68	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	4.186.042,06	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	385.745,62	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	385.745,62	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	1.375.266,98	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	828.713,93	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	16/07/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	3.069.303,40	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	19/07/21	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	574.327,14	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	19/07/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	331.690,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	21/07/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	2.073.796,16	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	21/07/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	759.904,81	-	-	AAA(bra)
FIM EMB IA	21/07/21	11/06/18	15/05/25	INTERVIA	1.293.934,37	-	Aa2.br	-
FIM EMB IA	21/07/21	17/03/21	05/03/24	ENERG TR	1.333.676,35	-	-	AAA(bra)
FIM EMB IA	21/07/21	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.057.361,68	-	-	AAA(bra)
FIM EMB IA	21/07/21	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	947.195,05	-	-	AA-(bra)
FIM EMB IA	21/07/21	20/09/19	20/08/26	VAMOS	1.087.320,92	brAA+	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	23/07/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.555.586,54	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/07/21	07/11/19	15/10/24	BKBR	1.044.347,33	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/07/21	23/12/20	15/12/26	RD COLIN	2.086.601,11	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	04/08/21	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	371.661,95	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	06/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	645.523,62	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	11/08/21	11/08/21	15/08/31	CSAN	1.087.818,35	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	11/08/21	19/11/19	15/06/27	AUTOPIST	1.114.064,73	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	17/08/21	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	2.821.085,23	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	18/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	1.197.362,90	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	18/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	929.143,34	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	27/08/21	27/08/21	20/08/31	S LUIZ A	1.066.515,16	-	-	AAA(bra)
FIM EMB IA	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	662.259,60	-	-	AA(bra)
FIM EMB IA	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	59.306,83	-	-	AA(bra)
FIM EMB IA	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	296.534,15	-	-	AA(bra)
FIM EMB IA	16/09/21	17/06/19	15/06/24	PROLAGOS	1.115.590,13	-	-	AA(bra)
FIM EMB IA	16/09/21	12/05/21	15/04/26	ELETROB	2.051.973,70	brAAA	-	-
FIM EMB IA	16/09/21	22/10/19	21/10/26	AUTOBAN	552.694,18	-	-	brAAA
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/09/21	20/09/21	15/09/29	MOV_PART	1.095.951,38	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	20/09/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.037.057,69	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	20/09/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.037.057,69	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	20/09/21	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	1.132.377,96	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	855.796,73	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	855.796,73	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	284.494,59	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	284.494,59	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	804.961,50	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	804.961,50	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	1.034.382,15	-	-	AA(bra)

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2024



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/01/2024

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	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	401.817,68	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	401.817,68	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	23/09/21	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	4.299.271,64	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	23/09/21	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	4.357.001,92	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	24/09/21	05/04/21	15/03/24	CCPR	41.921,02	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	27/09/21	28/12/20	15/01/26	LOCALIZA	1.822.975,90	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	27/09/21	29/03/21	01/04/24	CNH	2.505.591,33	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	30/09/21	30/09/21	15/09/31	SIMPAP	887.605,94	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	04/10/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	633.973,50	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/10/21	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	2.527.814,27	-	-	AA-(bra)
FIM EMB I A	20/10/21	20/10/21	20/10/25	DAYCOVAL	2.803.465,28	brAA+	AA.br	AA(bra)
FIM EMB I A	20/10/21	20/10/21	20/10/24	DAYCOVAL	1.554.024,61	brAA+	AA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/10/21	22/10/21	15/12/35	CART	2.346.509,92	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	22/10/21	22/10/21	15/12/35	CART	881.372,02	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	25/10/21	22/04/21	15/03/26	VIX LOGI	176.435,05	-	-	A+(bra)
FIM EMB I A	27/10/21	27/10/21	15/10/29	CONT GLO	2.034.141,07	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/10/21	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	1.290.975,20	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	04/11/21	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	3.362.655,72	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/11/21	10/11/21	15/10/28	LIGHT	360.393,65	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	12/11/21	12/11/21	15/10/31	VAMOS	2.193.043,13	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/11/21	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	12.073,28	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/11/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	2.291.554,31	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/11/21	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	2.349.460,41	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	03/12/21	11/06/19	11/06/24	BNBBM	604.606,86	brAAA	AA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/12/21	06/12/21	15/12/35	TESC	2.733.542,46	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/12/21	06/01/21	15/11/25	QUATA	2.573.759,07	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	20/12/21	20/12/21	15/11/35	ORIZON	2.172.298,44	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/01/22	22/04/21	15/03/26	VIX LOGI	1.015.293,89	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	13/01/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.162.991,38	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/01/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	364.699,23	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/01/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	2.163.571,97	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	366.284,48	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	354.838,09	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	3.018.281,33	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	847.032,85	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	755.461,73	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/03/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	1.078.143,96	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	19/04/22	19/04/22	16/04/29	VERT-10	595.149,11	-	-	AAAsf(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	26/04/22	26/04/22	15/04/24	LIGHT	1.014.388,01	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	102.889,74	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.188.292,14	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	12/05/22	12/05/22	15/04/27	BRKA	1.901.425,11	-	A+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	12/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.424.432,52	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	19/05/22	19/05/22	13/05/28	CEA MODA	517.802,45	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	26/05/22	26/05/22	10/05/27	GUAR	2.453.112,21	-	-	A
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	2.570.149,91	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	552.798,78	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.095.522,70	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	03/03/22	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	3.331.864,21	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/03/22	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	2.593.762,33	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/03/22	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	1.069.012,67	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/03/22	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	3.321.386,53	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/03/22	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	2.658.532,53	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/06/22	06/12/21	15/12/35	TESC	850.721,48	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	442.239,02	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	06/12/21	15/12/35	TESC	533.602,47	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	275.270,80	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	13/06/22	30/09/21	15/09/31	SIMPAP	1.910.688,57	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	13/06/22	08/07/21	15/06/31	VAMOS	903.426,82	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	13/06/22	08/07/21	15/06/31	VAMOS	73.706,15	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	13/06/22	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	787.923,87	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	13/06/22	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	890.981,69	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/06/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	1.331.152,19	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	27/06/22	27/06/22	07/07/24	LAGE	2.478.097,10	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	3.264.058,12	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	12/11/21	15/10/31	VAMOS	2.120.672,71	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	12/11/21	15/10/31	VAMOS	1.589.956,27	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	25/07/22	25/07/22	22/07/27	CM HOSPI	980.266,95	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	26/07/22	10/01/22	10/01/28	AMBIPAR	2.431.965,33	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	27/07/22	25/03/22	15/03/44	GBS PART	1.450.003,47	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	28/07/22	28/07/22	18/07/25	1V11	1.650.606,15	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	29/07/22	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	1.837.728,48	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/08/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	1.251,83	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	453.416,48	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	07/04/21	15/03/29	CAGECE	1.567.945,73	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	07/04/21	15/03/29	CAGECE	2.612.469,15	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/08/22	30/08/22	15/08/29	TRBR	5.922.497,35	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	02/09/22	02/09/22	02/09/29	AEGEA SA	1.787.943,23	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	27/09/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	53.828,62	-	-	A(bra)

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2024



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/01/2024

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	28/09/22	28/09/22	28/09/27	B.BRASIL	4.505.447,08	-	AAA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/10/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	37.554,85	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	03/11/22	06/04/21	15/03/29	ANET	1.899.613,15	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	08/11/22	08/11/22	27/10/27	CM HOSPI	1.015.448,55	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/11/22	08/11/22	15/06/42	BRK AMBI	5.461.653,16	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/11/22	02/05/22	15/04/38	RDVE	1.798.295,46	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/11/22	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	1.587.306,23	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	11/11/22	11/11/22	15/10/40	RAHOLD	2.940.749,78	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	11/11/22	11/11/22	15/10/40	RAHOLD	10.905.423,74	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	3.949.496,15	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	1.777.869,87	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	1.455.705,53	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.452.326,33	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.767.901,91	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.447.801,95	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	01/12/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	1.707.161,88	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	2.195.123,81	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	2.328.680,48	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	1.698.566,94	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/12/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	3.052.554,86	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	15/12/21	15/11/36	ITAPOA T	1.263.151,31	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	02/05/22	15/04/38	RDVE	2.081.077,11	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	3.207.870,66	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	26/01/23	26/01/23	20/01/26	CELG	3.114.731,48	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/03/23	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	315.383,44	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	1.226.402,47	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	15/12/21	15/11/36	ITAPOA T	3.835.139,75	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	27/07/22	15/04/36	BRV_VDR	8.902.872,21	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	20/03/23	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	928.537,72	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	14/04/23	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	657.819,63	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	17/04/23	17/04/23	17/03/30	VERO	3.009.479,87	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	20/04/23	12/05/22	15/04/27	BRKA	1.129.191,11	-	A+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	20/04/23	12/05/22	15/04/27	BRKA	31.170,90	-	A+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/04/23	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	2.297.558,25	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	1.906.404,54	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	2.278.712,00	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	18/06/21	15/12/30	MG050	3.145.395,98	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	08/11/22	15/06/42	BRK AMBI	1.358.661,09	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	08/07/21	15/06/31	VAMOS	1.764.735,83	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	797.714,11	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	22/10/21	15/12/35	CART	1.510.923,46	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	2.453.324,91	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	02/10/20	15/09/34	BRKA	300.871,34	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	02/10/20	15/09/34	BRKA	2.871.850,89	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	18/03/21	15/02/31	CORSAN	1.631.796,19	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	22/10/21	15/12/35	CART	652.444,22	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	10/02/21	15/12/31	METRRORIO	5.064.087,88	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/05/23	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	226.569,69	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/05/23	08/11/22	15/06/42	BRK AMBI	2.376.776,18	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/05/23	22/10/21	15/12/35	CART	2.151.921,30	brAA+	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.098.153,29	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	16/05/23	23/12/20	15/12/27	SABESP	2.297.022,31	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	21/07/21	15/07/31	CACHOEIR	1.779.089,59	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	29/10/21	15/10/26	COELBA	1.875.600,56	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	04/05/22	15/04/27	LOCALIZA	2.919.109,81	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	16/05/23	23/12/21	21/12/28	SMARTIFI	3.137.899,01	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	26/05/23	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	59.731,38	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	02/06/23	25/06/21	20/06/26	OURO VER	287.776,97	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/06/23	25/03/22	15/03/44	GBS PART	2.967.742,65	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/06/23	26/07/21	15/06/33	ASA BRAN	2.754.489,56	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	23/06/23	23/06/23	15/05/43	IGUA RJ	1.353.019,22	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	28/06/23	08/07/21	15/06/31	VAMOS	1.041.362,61	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	28/06/23	28/07/22	18/07/25	1V11	374.541,21	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/07/23	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	1.499.921,43	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/07/23	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	996.876,48	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/07/23	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	996.876,48	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/07/23	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	1.499.921,43	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	13/07/23	28/07/22	18/07/25	1V11	1.135.738,17	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	13/07/23	28/07/22	18/07/25	1V11	277.624,89	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	21/07/23	23/12/20	15/12/26	RD COLIN	1.554.702,30	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	1.489.584,77	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	1.489.584,77	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	15/12/21	15/11/36	ITAPOA T	2.481.851,55	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	26/07/21	15/06/33	ASA BRAN	2.711.230,25	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	01/08/23	31/07/23	25/07/28	TIMS A	2.539.824,14	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/23	17/04/23	17/03/30	VERO	1.328.548,57	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/23	06/12/21	15/12/35	TESC	1.997.498,71	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/23	02/05/22	15/04/38	RDVE	3.094.684,08	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/08/23	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.178.663,07	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/08/23	05/06/18	05/06/28	BRADESCO	4.181.045,52	brAAA	AAA.br	AAA(bra)

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2024



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/01/2024

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/08/23	08/08/23	15/01/34	SPERIO4	2.408.653,17	brAA+	-	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	29/08/23	29/08/23	29/08/25	BRADESCO	10.544.640,17	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	30/08/23	30/08/23	01/09/25	VOLKSWAG	6.309.814,19	brAAA	AAA.br	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	06/09/23	06/09/23	08/09/25	BTG PACT	10.520.057,65	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	08/09/23	08/09/23	08/09/25	B VOTORA	6.306.944,42	brAAA	AA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	14/09/23	06/01/21	15/11/25	QUATA	2.503,66	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	19/09/23	21/08/23	21/08/25	ABC	5.250.376,47	brAAA	AA+.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	19/09/23	13/09/23	15/09/25	PANAMERI	5.206.928,60	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/09/23	21/09/23	15/09/28	ELETROB	2.674.150,82	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/09/23	28/09/23	15/09/30	CSMG	2.589.332,52	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/09/23	23/12/21	21/12/25	SMARTIFI	2.433.408,90	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/09/23	19/05/21	10/05/30	RODO BR	2.591.541,18	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/09/23	06/09/21	20/08/31	S LUIZA	1.525.010,36	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/09/23	13/09/23	15/09/25	B VOTORA	5.194.751,74	brAAA	AA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/10/23	14/11/22	10/10/31	CORREDOR	2.370.572,91	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/10/23	20/10/23	20/10/28	SANTANDE	4.100.470,13	-	AAA.br	A-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/11/23	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	3.047.722,84	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/11/23	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	2.987.609,11	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/11/23	18/03/21	15/02/31	CORSAN	3.046.173,76	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/11/23	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	2.999.651,18	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/11/23	18/06/21	15/12/30	MG050	943.722,50	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	17/11/23	23/08/22	15/08/32	PETRJ	4.611.268,18	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	23/11/23	29/09/22	15/09/28	VERT5	2.509.691,04	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	23/11/23	10/12/21	17/11/28	DESKTOP	2.594.932,83	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/12/23	12/02/21	15/12/35	MS 306	986.333,12	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/12/23	30/08/22	15/08/29	TRBR	2.046.411,85	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/12/23	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.023.641,22	-	Aa3.br	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	26/12/23	27/12/22	02/06/26	BRADESCO	10.124.940,36	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	08/01/24	08/01/24	08/01/26	DAYCOVAL	10.079.697,00	brAA+	AA.br	AA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	08/01/24	08/01/24	08/01/26	B.ALFA	10.078.954,66	-	AAA.br	AA+(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	08/01/24	08/01/24	08/01/26	ABC	10.079.321,78	brAAA	AA+.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	17/04/23	17/03/30	VERO	2.918.648,29	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	2.023.353,01	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	2.023.353,01	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	25/03/22	15/03/44	GBS PART	2.098.659,02	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	25/03/22	15/03/44	GBS PART	2.072.253,57	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	965.657,38	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	1.932.420,90	brA	-	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	11/01/24	27/12/22	02/06/26	BRADESCO	10.644.283,75	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	18/01/24	18/01/24	04/01/27	TOYOTA	6.438.528,97	brAAA	-	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	24/01/24	24/01/24	26/01/26	ABC	10.023.467,49	brAAA	AA+.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	24/01/24	24/01/24	25/01/27	BTG PACT	4.260.259,54	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	25/01/24	25/01/24	26/01/26	BTG PACT	6.412.111,21	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/01/24	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	1.150.500,02	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/01/24	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.222.675,08	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/01/24	22/04/21	15/03/26	VIX LOGI	2.036.926,77	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	30/01/24	28/04/21	15/04/31	MANAUSEN	2.572.523,89	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	30/01/24	01/06/23	25/05/26	LM TRANS	2.580.127,44	-	AA+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	30/01/24	27/10/21	15/10/29	CONT GLO	2.580.874,01	-	-	AA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	31/01/24	31/01/24	02/02/26	B.ALFA	10.599.999,50	-	AAA.br	AA+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	-	FIDC VERDECARD SN3	352.841,10	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	-	FIDC CREDZ SN6	2.393.340,85	brAA (sf)	-	A+sf(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	FIDC VERDECARD SN5	116.785,74	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	VERDECARD FIDC SN6	1.090.042,57	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	FIDC VERDECARD SN8	1.376.397,96	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	RB CAP CREDIT AL SN3	651.976,36	brAA-(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	BR ELETRO FIDC S1	1.953.986,70	-	-	Aasf(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	INSS CONS PDL I FIDC	1.727.295,72	-	-	AAAsf(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	-	-	-	DRIVER SIX FIDC SN	1.311.542,76	-	AAA.br	-

Observação: Em janeiro de 2024, nenhum dos ativos da carteira de crédito da EMBRAER PREV sofreu rebaixamento de sua classificação de risco e ficou abaixo da classificação mínima de crédito estabelecida pela Política de Investimento do Plano Embraer Prev.

4. RISCO OPERACIONAL

Para acompanhamento do risco operacional, são monitorados o fluxo de informações, processos e movimentações nas carteiras e/ou fundos exclusivos da Entidade, sempre que ocorram, para atestar que os controles implementados estejam sendo eficientes.

5. RISCO DE LIQUIDEZ

Para acompanhamento do risco de liquidez, a EMBRAER PREV realiza, anualmente, estudo de *LDI (Liability Driven Investments)*, elaborado pelo atuário do Plano Embraer Prev, em conjunto com o consultor de investimentos da Entidade, que avalia o comprometimento do Patrimônio de Cobertura, no que diz respeito à sua liquidez, quando confrontado com o respectivo fluxo de receitas e despesas previdenciais, conforme exigido pela Resolução CGPC Nº 04/2002. Semestralmente, com base no resultado da campanha de alteração de perfis de investimento, o atuário do Plano realiza ainda, estudo de fluxo de liquidez para atestar que a estratégia da carteira de investimento vigente esteja aderente ao estudo de *LDI* anual.

6. RISCO LEGAL

Para acompanhamento do risco legal, a Entidade controlará diariamente seus investimentos, através dos relatórios elaborados pelo administrador dos fundos e/ou carteiras da EMBRAER PREV, para que estes estejam enquadrados às determinações legais e aos limites estabelecidos na Política de Investimento dos Planos sob sua administração. Os seguintes relatórios elaborados pelo administrador são utilizados pela EMBRAER PREV para o controle do risco legal:

6.1. Relatório de Enquadramentos Legais



Relatório Resumo de Enquadramento

Patrimônio Líquido da Fundação **4.804.895.408,56**

Tópico do Enquadramento	Limite	Aplicação Atual	Valor Limite	% Aplicado	Status
% do Segmento RF/PL PLANO	100,00%	4.200.712.100,16	4.804.895.408,56	87,43%	Enquadrado
% do PL em Títulos de Emissão do Tesouro Nacional e/ou do BACEN	100,00%	3.348.430.680,70	4.804.895.408,56	69,69%	Enquadrado
% do PL em Títulos RF1, exceto títulos do Tesouro Nacional	80,00%	852.281.419,46	3.843.916.384,13	17,74%	Enquadrado
% do PL em FIDC	20,00%		960.979.096,03	0,00%	Enquadrado
% do PL em uma mesma pessoa jurídica não-financeira	10,00%	Verificar Rel. de Diversificação	480.489.548,02	0,00%	Enquadrado
% do PL em Instituições Financeiras	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Financ.	1.201.223.852,14	0,00%	Enquadrado
% de uma mesma Série de Debêntures	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Debêntures	1.201.223.852,14	0,00%	Enquadrado
% do PL em RV	70,00%	497.946.078,67	3.363.426.728,71	10,36%	Enquadrado
% do capital votante de uma empresa	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação RV	1.201.223.852,14	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Imobiliários	20,00%	79.142.331,52	960.979.096,03	1,65%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Empréstimos	15,00%	24.968.494,86	720.734.339,92	0,52%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Estruturados	20,00%	0,00	960.979.096,03	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos no Exterior	10,00%	0,00	480.489.548,02	0,00%	Enquadrado

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

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2024

6.2. Relatório de Túnel de Preços

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE JANEIRO DE 2024 À 31 DE JANEIRO 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.		
05/01/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-F	01/01/2035	Compra	10,5790%	10,6492%	0,0000%	0,0000%	-0,0702%	NÃO
17/01/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/09/2026	Compra	0,0626%	0,0641%	0,0558%	0,0914%	-0,0015%	NÃO
17/01/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/09/2026	Compra	0,0626%	0,0641%	0,0558%	0,0914%	-0,0015%	NÃO
17/01/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/09/2026	Compra	0,0626%	0,0641%	0,0558%	0,0914%	-0,0015%	NÃO
17/01/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/09/2026	Compra	0,0626%	0,0641%	0,0558%	0,0914%	-0,0015%	NÃO
17/01/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/09/2026	Compra	0,0626%	0,0641%	0,0558%	0,0914%	-0,0015%	NÃO
17/01/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/09/2026	Compra	0,0626%	0,0641%	0,0558%	0,0914%	-0,0015%	NÃO
19/01/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/09/2026	Compra	0,0785%	0,0623%	0,0523%	0,0914%	0,0162%	NÃO
19/01/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/09/2026	Compra	0,0606%	0,0623%	0,0523%	0,0914%	-0,0017%	NÃO
19/01/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,7090%	5,7025%	5,5348%	5,8675%	0,0065%	NÃO
22/01/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/09/2026	Compra	0,0617%	0,0612%	0,0519%	0,0905%	0,0005%	NÃO
22/01/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/09/2026	Compra	0,0617%	0,0612%	0,0519%	0,0905%	0,0005%	NÃO
22/01/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/09/2026	Compra	0,0617%	0,0612%	0,0519%	0,0905%	0,0005%	NÃO
22/01/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/09/2026	Compra	0,0617%	0,0612%	0,0519%	0,0905%	0,0005%	NÃO
22/01/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/09/2026	Compra	0,0617%	0,0612%	0,0519%	0,0905%	0,0005%	NÃO
22/01/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/09/2026	Compra	0,0617%	0,0612%	0,0519%	0,0905%	0,0005%	NÃO
22/01/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/09/2026	Compra	0,0617%	0,0612%	0,0519%	0,0905%	0,0005%	NÃO
22/01/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/09/2026	Compra	0,0617%	0,0612%	0,0519%	0,0905%	0,0005%	NÃO
22/01/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/09/2026	Compra	0,0617%	0,0612%	0,0519%	0,0905%	0,0005%	NÃO
22/01/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,6995%	5,7203%	5,5271%	5,8599%	-0,0208%	NÃO
24/01/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,6995%	5,7040%	5,5316%	5,8644%	-0,0045%	NÃO
25/01/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/09/2026	Compra	0,0607%	0,0612%	0,0499%	0,0906%	-0,0005%	NÃO
25/01/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,6895%	5,6909%	5,5286%	5,8614%	-0,0014%	NÃO
29/01/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,6795%	5,7046%	5,5106%	5,8433%	-0,0251%	NÃO
29/01/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,6795%	5,7046%	5,5106%	5,8433%	-0,0251%	NÃO
29/01/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,6795%	5,7046%	5,5106%	5,8433%	-0,0251%	NÃO
29/01/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,6795%	5,7046%	5,5106%	5,8433%	-0,0251%	NÃO
29/01/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,6795%	5,7046%	5,5106%	5,8433%	-0,0251%	NÃO
29/01/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,6795%	5,7046%	5,5106%	5,8433%	-0,0251%	NÃO
29/01/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,6795%	5,7046%	5,5106%	5,8433%	-0,0251%	NÃO
29/01/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,6795%	5,7046%	5,5106%	5,8433%	-0,0251%	NÃO
29/01/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,6795%	5,7046%	5,5106%	5,8433%	-0,0251%	NÃO
29/01/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,6795%	5,7046%	5,5106%	5,8433%	-0,0251%	NÃO
29/01/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,6795%	5,7046%	5,5106%	5,8433%	-0,0251%	NÃO
31/01/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/09/2026	Compra	0,0626%	0,0640%	0,0542%	0,0937%	-0,0014%	NÃO

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE JANEIRO DE 2024 À 31 DE JANEIRO DE 2024



FIRF EMB II A CRED PRIV

DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	FONTE ANBIMA			DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
								TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.		
03/01/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2026	Compra	5,1593%	5,1766%	4,9442%	5,4411%	-0,0173%	NÃO
05/01/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	LTN	01/07/2025	Venda	9,7978%	9,8131%	9,4657%	10,1722%	-0,0153%	NÃO
09/01/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2027	Compra	5,3233%	5,3400%	5,0343%	5,5136%	-0,0167%	NÃO
10/01/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2024	Compra	6,2772%	6,3744%	5,8731%	6,7748%	-0,0972%	NÃO
11/01/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	LTN	01/07/2025	Venda	9,9005%	9,8857%	9,5802%	10,2831%	0,0148%	NÃO
15/01/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2026	Compra	5,1511%	5,1770%	4,9243%	5,4218%	-0,0259%	NÃO
15/01/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2028	Venda	5,2897%	5,3000%	5,0303%	5,5196%	-0,0103%	NÃO
15/01/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2028	Venda	5,2897%	5,3000%	5,0303%	5,5196%	-0,0103%	NÃO
18/01/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	LTN	01/07/2025	Venda	9,8610%	9,8622%	9,5490%	10,2483%	-0,0012%	NÃO
24/01/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	LTN	01/07/2025	Venda	9,8215%	9,8561%	9,5269%	10,2231%	-0,0346%	NÃO
24/01/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	LTN	01/07/2025	Venda	9,8215%	9,8561%	9,5269%	10,2231%	-0,0346%	NÃO
24/01/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	LTN	01/10/2025	Venda	9,8005%	9,8400%	9,4791%	10,2308%	-0,0395%	NÃO
24/01/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	LTN	01/10/2025	Venda	9,8005%	9,8400%	9,4791%	10,2308%	-0,0395%	NÃO
24/01/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	LTN	01/10/2025	Venda	9,8005%	9,8400%	9,4791%	10,2308%	-0,0395%	NÃO
24/01/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2025	Compra	5,3995%	5,4455%	5,0809%	5,6798%	-0,0460%	NÃO
30/01/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	LTN	01/07/2026	Venda	9,8754%	9,8730%	9,4013%	10,2307%	0,0024%	NÃO
30/01/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	LTN	01/07/2026	Venda	9,8754%	9,8730%	9,4013%	10,2307%	0,0024%	NÃO
30/01/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	LTN	01/07/2026	Venda	9,8754%	9,8730%	9,4013%	10,2307%	0,0024%	NÃO
30/01/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	LTN	01/07/2026	Venda	9,8754%	9,8730%	9,4013%	10,2307%	0,0024%	NÃO
30/01/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	LTN	01/07/2026	Venda	9,8754%	9,8730%	9,4013%	10,2307%	0,0024%	NÃO
30/01/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	LTN	01/07/2026	Venda	9,8754%	9,8730%	9,4013%	10,2307%	0,0024%	NÃO
30/01/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	LTN	01/07/2026	Venda	9,8754%	9,8730%	9,4013%	10,2307%	0,0024%	NÃO
30/01/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	LTN	01/07/2026	Venda	9,8754%	9,8730%	9,4013%	10,2307%	0,0024%	NÃO
30/01/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	LTN	01/07/2026	Venda	9,8754%	9,8730%	9,4013%	10,2307%	0,0024%	NÃO

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2024



RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE JANEIRO DE 2024 À 31 DE JANEIRO DE 2024



FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO

DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	FONTE ANBIMA			DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
								TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.		
22/01/2024	FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	ICATU VA	CONCORDI	LFT	01/09/2025	Compra	0,0143%	0,0142%	-0,0025%	0,0365%	0,0001%	NÃO

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2024

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE JANEIRO DE 2024 À 31 DE JANEIRO DE 2024



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBVBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
02-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	25,82	2.900,00	74.885,14	25,56	25,84	26,51	23.461,00
02-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	33,90	300,00	10.171,14	33,59	33,80	33,96	13.854,00
02-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	33,88	600,00	20.328,00	33,59	33,80	33,96	13.854,00
02-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	33,78	1.100,00	37.157,94	33,59	33,80	33,96	13.854,00
02-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	4,59	9.900,00	45.437,95	4,49	4,55	4,73	23.636,00
02-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	13,31	3.900,00	51.924,75	13,20	13,32	13,56	14.169,00
02-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,34	55.100,00	239.284,64	4,29	4,33	4,41	22.245,00
02-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	24,10	100,00	2.410,31	23,58	23,93	24,20	17.745,00
02-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	23,75	2.100,00	49.874,40	23,58	23,93	24,20	17.745,00
02-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	10,23	51.900,00	530.983,65	10,13	10,19	10,32	16.842,00
02-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	10,26	4.400,00	45.154,59	10,13	10,19	10,32	16.842,00
02-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	33,46	6.700,00	224.195,11	33,24	33,48	33,89	36.912,00
02-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	33,58	15.500,00	520.541,09	33,24	33,48	33,89	36.912,00
02-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	33,56	1.300,00	43.632,32	33,24	33,48	33,89	36.912,00
02-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,35	5.400,00	120.676,05	22,16	22,39	22,70	29.191,00
02-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,25	1.100,00	24.475,00	22,16	22,39	22,70	29.191,00
02-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	61,40	2.000,00	122.801,80	60,92	61,75	63,51	24.305,00
02-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	7,25	6.500,00	47.096,30	7,12	7,22	7,44	22.817,00
02-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	55,58	2.500,00	138.957,29	54,72	55,19	56,29	13.969,00
03-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	25,62	2.500,00	64.040,43	25,43	25,69	25,83	18.420,00
03-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	25,75	3.000,00	77.261,18	25,43	25,69	25,83	18.420,00
03-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	12,97	1.000,00	12.965,87	12,71	12,90	13,12	13.880,00
03-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	13,42	1.600,00	21.471,71	13,25	13,40	13,50	14.702,00
03-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	54,79	400,00	21.915,84	54,50	54,76	55,07	18.264,00
03-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	33,84	800,00	27.071,16	33,73	33,83	34,18	15.743,00
03-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	4,71	7.400,00	34.854,00	4,50	4,67	4,74	31.360,00
03-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	4,70	9.300,00	43.710,00	4,50	4,67	4,74	31.360,00
03-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	4,70	11.700,00	55.021,78	4,50	4,67	4,74	31.360,00
03-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	41,94	1.400,00	58.710,99	41,55	41,82	42,15	13.676,00
03-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENAT3	19,42	700,00	13.597,03	18,85	19,33	19,55	9.841,00
03-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	13,29	3.000,00	39.866,60	13,20	13,29	13,42	11.876,00
03-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	35,20	2.000,00	70.397,16	34,98	35,13	35,38	13.297,00
03-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	17,67	800,00	14.136,58	17,58	17,67	17,83	7.988,00
03-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,30	4.300,00	18.472,81	4,22	4,28	4,35	27.811,00
03-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	24,45	3.700,00	90.450,05	23,62	24,22	24,60	15.388,00
03-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,18	1.500,00	15.272,78	10,12	10,16	10,25	22.342,00
03-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	33,43	1.000,00	33.429,66	33,15	33,40	33,77	28.504,00
03-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	16,76	1.000,00	16.761,51	16,61	16,75	16,94	17.961,00
03-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	PETRA	38,87	500,00	19.436,00	37,67	38,56	39,12	63.893,00
03-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	46,87	800,00	37.496,61	45,22	46,20	47,55	22.559,00
03-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	22,46	2.800,00	62.899,49	22,28	22,33	22,63	13.791,00
03-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	21,15	1.600,00	33.834,88	20,57	21,07	21,35	9.512,00
03-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	60,90	400,00	24.360,34	60,34	61,62	61,62	25.432,00
03-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	60,85	2.500,00	152.123,17	60,34	60,89	61,62	25.432,00
03-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	SBS3	73,74	300,00	22.122,94	73,22	73,61	74,07	6.492,00
03-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	7,60	13.100,00	99.529,35	7,04	7,46	7,66	25.978,00
03-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	7,47	2.900,00	21.649,25	7,04	7,46	7,66	25.978,00
03-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	7,62	4.600,00	35.052,00	7,04	7,46	7,66	25.978,00
03-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	55,41	1.400,00	77.567,92	54,76	55,45	55,80	15.166,00
03-01-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	HSLG11	95,25	10.421,00	992.600,25	94,20	95,00	96,91	6.792,00
03-01-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	TRXF11	111,04	9.006,00	1.000.025,84	110,51	111,04	111,49	5.217,00
04-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	25,48	17.100,00	435.760,46	25,03	25,29	25,74	11.856,00
04-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	25,19	1.700,00	42.827,13	25,03	25,29	25,74	11.856,00
04-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	25,19	1.900,00	47.861,00	25,03	25,29	25,74	11.856,00
04-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	34,04	200,00	6.808,53	33,55	34,00	34,25	14.843,00
04-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	34,21	700,00	23.947,00	33,55	34,00	34,25	14.843,00
04-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,14	27.200,00	112.651,41	4,09	4,14	4,28	29.656,00
04-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	24,39	16.600,00	404.874,00	23,94	24,27	24,65	17.572,00
04-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	24,16	100,00	2.416,14	23,94	24,27	24,65	17.572,00
04-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	24,21	1.900,00	45.999,00	23,94	24,27	24,65	17.572,00
04-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	10,04	700,00	7.025,70	9,96	10,04	10,18	20.999,00
04-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	10,03	89.800,00	900.418,45	9,96	10,04	10,18	20.999,00
04-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	32,96	27.100,00	893.089,05	32,70	32,99	33,23	34.448,00
04-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	33,02	200,00	6.604,36	32,70	32,99	33,23	34.448,00
04-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	MGLU3	1,93	46.800,00	90.350,61	1,90	1,95	2,03	56.193,00
04-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	59,65	3.000,00	178.947,21	59,22	59,66	61,13	25.824,00
04-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	7,25	11.000,00	79.712,68	7,15	7,32	7,60	16.182,00
04-01-24	FIA RVA EMB IV	Compra	PRI03	46,57	2.287,00	106.513,57	46,02	46,60	47,20	20.856,00
05-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	25,37	8.400,00	213.121,36	25,06	25,29	25,63	11.711,00
05-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	25,29	500,00	12.645,27	25,06	25,29	25,63	11.711,00
05-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	4,82	10.300,00	49.621,93	4,60	4,85	4,95	34.570,00
05-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	4,87	12.500,00	60.920,45	4,60	4,85	4,95	34.570,00
05-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	13,46	5.000,00	67.311,03	13,15	13,45	13,55	14.791,00
05-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	34,67	2.600,00	90.133,99	34,41	34,65	34,95	14.096,00
05-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	24,33	6.600,00	160.598,55	23,96	24,28	24,48	13.336,00
05-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	24,16	400,00	9.665,75	23,96	24,28	24,48	13.336,00
05-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	10,10	16.100,00	162.610,00	10,00	10,17	10,29	20.597,00
05-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	10,13	49.300,00	499.644,73	10,00	10,17	10,29	20.597,00
05-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	33,25	4.900,00	162.925,00	32,88	33,47	33,70	46.408,00
05-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	33,38	14.900,00	497.309,20	32,88	33,47	33,70	46.408,00
05-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	7,70	8.300,00	63.924,68	7,22	7,62	7,80	17.089,00
05-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	7,69	5.200,00	39.976,17	7,22	7,62	7,80	17.089,00
05-01-24	FIA RVA EMB IV	Venda	EQLT3	34,69	6.800,00	235.893,92	34,41	34,65	34,95	14.096,00
08-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	13,52	10.000,00	135.159,36	13,39	13,51	13,61	7.250,00
08-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	13,53	3.700,00	50.042,50	13,39	13,51	13,61	7.250,00
08-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	4,88	3.800,00	18.550,76	4,83	4,96	5,02	26.104,00
08-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	4,94	33.300,00	164.450,93	4,83	4,96	5,02	26.104,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2024

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE JANEIRO DE 2024 À 31 DE JANEIRO 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
08-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	10,03	5.300,00	53.158,80	9,98	10,04	10,10	15.015,00
08-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	10,04	13.100,00	131.461,20	9,98	10,04	10,10	15.015,00
08-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,39	7.200,00	31.624,28	4,25	4,42	4,49	42.886,00
08-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	MGLU3	2,03	164.600,00	334.951,73	1,95	2,02	2,09	51.702,00
08-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	61,37	900,00	55.237,28	59,99	62,14	63,34	22.692,00
08-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	7,99	20.400,00	162.980,75	7,56	7,97	8,12	17.576,00
08-01-24	FIA RVA EMB IV	Venda	EQLT3	34,65	9.851,00	341.337,15	34,25	34,65	34,91	21.277,00
08-01-24	FIA RVA EMB IV	Venda	EQLT3	34,57	6.895,00	238.369,53	34,25	34,65	34,91	21.277,00
08-01-24	FIA RVA EMB IV	Venda	EQLT3	34,69	6.898,00	239.291,28	34,25	34,65	34,91	21.277,00
08-01-24	FIA RVA EMB IV	Venda	EQLT3	34,85	273,00	9.514,05	34,25	34,65	34,91	21.277,00
09-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	13,41	1.000,00	13.410,00	13,38	13,42	13,48	7.621,00
09-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	13,42	5.100,00	68.457,51	13,38	13,42	13,48	7.621,00
09-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	13,41	2.000,00	26.815,05	13,38	13,42	13,48	7.621,00
09-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	10,06	2.900,00	29.180,15	9,98	10,15	10,23	28.618,00
09-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	10,18	7.800,00	79.435,13	9,98	10,15	10,23	28.618,00
09-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	16,94	1.000,00	16.943,26	16,80	16,93	17,15	26.961,00
09-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	16,83	1.400,00	23.565,17	16,80	16,93	17,15	26.961,00
09-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	MGLU3	2,12	62.000,00	131.408,90	2,04	2,13	2,20	39.094,00
09-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	MGLU3	2,16	66.800,00	144.306,55	2,04	2,13	2,20	39.094,00
09-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	16,33	7.000,00	114.284,31	16,18	16,35	16,60	17.641,00
09-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	16,32	3.300,00	53.839,86	16,18	16,35	16,60	17.641,00
09-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	8,02	3.500,00	28.058,94	7,86	7,98	8,10	21.708,00
09-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	8,03	12.400,00	99.608,78	7,86	7,98	8,10	21.708,00
09-01-24	FIA RVA EMB IV	Compra	CPL6	10,21	320,00	3.266,67	9,98	10,15	10,23	28.618,00
09-01-24	FIA RVA EMB IV	Compra	CPL6	10,19	16.273,00	165.851,16	9,98	10,15	10,23	28.618,00
09-01-24	FIA RVA EMB IV	Compra	CPL6	10,08	43.456,00	437.895,30	9,98	10,15	10,23	28.618,00
10-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	25,55	1.700,00	43.432,45	25,33	25,55	25,83	12.551,00
10-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	13,42	7.400,00	99.310,32	13,33	13,41	13,52	6.660,00
10-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	54,50	500,00	27.250,00	54,17	54,44	54,67	15.639,00
10-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	33,23	1.200,00	39.875,76	33,16	33,25	33,55	12.509,00
10-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	37,53	1.000,00	37.530,00	37,33	37,65	38,11	16.247,00
10-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	4,80	4.400,00	21.120,00	4,72	4,79	4,90	29.115,00
10-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	10,08	5.500,00	55.413,29	10,04	10,12	10,29	16.421,00
10-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	10,08	5.600,00	56.448,00	10,04	10,12	10,29	16.421,00
10-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	42,82	2.000,00	85.640,00	41,70	42,52	43,06	21.190,00
10-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,97	16.400,00	212.751,02	12,83	12,98	13,36	15.147,00
10-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,97	1.300,00	16.861,78	12,83	12,98	13,36	15.147,00
10-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	35,26	2.700,00	95.202,00	34,76	35,17	35,43	13.995,00
10-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,50	4.100,00	18.450,00	4,40	4,47	4,55	29.467,00
10-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGT11	24,24	6.000,00	145.424,88	24,20	24,45	24,86	14.451,00
10-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,13	2.800,00	28.364,00	10,11	10,14	10,22	16.249,00
10-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	33,37	1.300,00	43.378,49	33,19	33,34	33,54	22.607,00
10-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	16,41	1.600,00	26.256,00	16,36	16,56	16,99	26.309,00
10-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	MGLU3	2,16	255.300,00	550.731,86	2,10	2,14	2,20	34.930,00
10-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	16,65	2.700,00	44.952,60	16,01	16,49	16,81	13.995,00
10-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	16,31	4.100,00	66.868,23	16,01	16,49	16,81	13.995,00
10-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	16,72	1.300,00	21.733,02	16,01	16,49	16,81	13.995,00
10-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRIO3	44,11	4.500,00	198.500,14	43,92	44,71	46,44	45.757,00
10-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	23,83	3.300,00	78.627,85	23,19	23,66	23,92	24.717,00
10-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	20,30	1.700,00	34.510,00	20,25	20,38	20,80	8.322,00
10-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	62,88	1.000,00	62.880,36	62,17	62,73	63,36	19.471,00
10-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	SBS3	74,60	300,00	22.380,00	73,35	74,32	74,84	8.826,00
10-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	25,23	1.200,00	30.276,00	25,16	25,47	25,99	8.563,00
10-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	8,03	3.700,00	29.711,00	7,87	8,06	8,21	16.438,00
10-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	8,07	6.100,00	49.227,00	7,87	8,06	8,21	16.438,00
10-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	8,11	18.900,00	153.362,14	7,87	8,06	8,21	16.438,00
10-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	53,86	1.500,00	80.790,00	53,73	53,92	54,29	8.567,00
11-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	13,31	7.769,00	103.421,10	13,24	13,31	13,45	10.395,00
11-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	13,27	832,00	11.043,02	13,24	13,31	13,45	10.395,00
11-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	10,18	10.280,00	104.613,48	10,07	10,16	10,26	15.884,00
11-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	10,17	929,00	9.447,93	10,07	10,16	10,26	15.884,00
11-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	42,75	188,00	8.036,87	42,38	43,20	43,80	34.181,00
11-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	43,20	2.965,00	128.073,50	42,38	43,20	43,80	34.181,00
11-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	43,51	3.566,00	155.154,63	42,38	43,20	43,80	34.181,00
11-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,82	3.728,00	47.789,42	12,70	12,80	12,98	19.549,00
11-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,81	18.025,00	230.973,99	12,70	12,80	12,98	19.549,00
11-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	35,05	1.118,00	39.186,34	34,83	35,05	35,69	16.963,00
11-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	35,19	1.174,00	41.311,73	34,83	35,05	35,69	16.963,00
11-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	MGLU3	2,23	37.375,00	83.533,12	2,14	2,21	2,29	26.563,00
11-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	MGLU3	2,20	119.377,00	262.150,76	2,14	2,21	2,29	26.563,00
11-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	SBS3	76,65	2.229,00	170.852,85	74,09	76,28	77,42	24.258,00
11-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	SBS3	76,12	1.741,00	132.532,86	74,09	76,28	77,42	24.258,00
11-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	20,83	1.529,00	31.850,35	20,50	20,79	21,05	11.198,00
11-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	20,88	3.715,00	77.569,20	20,50	20,79	21,05	11.198,00
11-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	20,75	5.558,00	115.340,14	20,50	20,79	21,05	11.198,00
11-01-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	HBRH11	91,17	5.484,00	500.000,96	90,50	91,14	91,19	28,00
11-01-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	RBR111	89,63	956,00	85.687,54	89,00	89,72	90,00	1.456,00
12-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	25,46	1.200,00	30.551,71	25,00	25,43	25,59	16.480,00
12-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	14,17	11.200,00	158.652,21	13,98	14,23	14,58	29.701,00
12-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	13,28	1.200,00	15.940,48	13,24	13,29	13,39	9.621,00
12-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	13,30	7.500,00	99.745,88	13,24	13,29	13,39	9.621,00
12-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	54,84	300,00	16.452,00	54,31	54,89	55,20	15.663,00
12-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	33,29	500,00	16.646,00	33,21	33,34	33,65	10.830,00
12-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	38,40	600,00	23.040,94	36,55	38,05	38,50	22.848,00
12-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	38,40	2.400,00	92.156,50	36,55	38,05	38,50	22.848,00
12-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	10,13	11.700,00	118.478,95	10,05	10,12	10,20	15.402,00
12-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	10,13	3.200,00	32.416,00	10,05	10,12	10,20	15.402,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2024

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE JANEIRO DE 2024 À 31 DE JANEIRO 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
12-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	42,94	800,00	34.348,32	42,68	43,01	43,56	13.385,00
12-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENAT3	18,77	800,00	15.015,00	18,52	18,83	19,20	4.058,00
12-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,80	13.100,00	167.718,99	12,68	12,80	13,01	10.368,00
12-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQT3	34,95	1.200,00	41.945,24	34,63	34,94	35,24	8.834,00
12-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	17,55	1.000,00	17.548,00	17,36	17,53	17,63	3.737,00
12-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGT11	24,63	1.800,00	44.325,26	24,20	24,51	24,82	16.192,00
12-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGT11	24,51	1.200,00	29.407,46	24,20	24,51	24,82	16.192,00
12-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	10,10	15.200,00	153.520,00	10,00	10,12	10,18	16.074,00
12-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	33,35	500,00	16.673,00	32,96	33,33	33,48	30.121,00
12-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	33,32	5.400,00	179.928,00	32,96	33,33	33,48	30.121,00
12-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	16,99	4.000,00	67.943,16	16,40	16,99	17,21	24.840,00
12-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	MGLU3	2,29	68.600,00	157.053,65	2,18	2,28	2,35	29.838,00
12-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRIO3	46,34	3.100,00	143.642,15	45,94	46,39	46,85	22.585,00
12-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	23,50	1.500,00	35.251,07	23,06	23,60	23,85	12.334,00
12-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	21,01	700,00	14.709,00	20,62	21,02	21,29	8.754,00
12-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	61,01	3.300,00	201.342,92	60,11	61,08	62,26	20.581,00
12-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	SBSPP3	77,38	2.400,00	185.711,31	75,63	77,10	77,57	7.555,00
12-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	7,95	1.600,00	12.721,00	7,76	7,95	8,16	11.612,00
12-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	54,13	400,00	21.651,66	53,49	53,92	55,23	12.671,00
12-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	53,71	600,00	32.227,16	53,49	53,92	55,23	12.671,00
12-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	20,92	4.400,00	92.029,70	20,14	20,89	21,19	13.329,00
12-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	21,00	6.400,00	134.398,96	20,14	20,89	21,19	13.329,00
12-01-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	RBRLL1	89,84	1.576,00	141.590,28	89,22	89,86	90,50	1.619,00
15-01-24	FIA RVA EMB II	Venda	LJQQ1	1,60	4.284,00	6.854,40	1,57	1,60	1,69	92,00
15-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT1	16,30	221,00	3.602,09	16,11	16,64	20,00	360,00
15-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	14,74	2.100,00	30.954,00	14,14	14,56	14,79	13.526,00
15-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	14,72	1.200,00	17.661,71	14,14	14,56	14,79	13.526,00
15-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	14,71	600,00	8.824,20	14,14	14,56	14,79	13.526,00
15-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	55,76	2.000,00	111.527,77	55,00	55,72	56,20	25.550,00
15-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	38,32	1.100,00	42.153,32	38,01	38,35	38,63	8.245,00
15-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	38,30	1.900,00	72.770,00	38,01	38,35	38,63	8.245,00
15-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL3	9,18	400,00	3.672,00	9,05	9,13	9,22	3.424,00
15-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL3	9,13	11.400,00	104.121,15	9,05	9,13	9,22	3.424,00
15-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL3	9,18	2.700,00	24.788,27	9,05	9,13	9,22	3.424,00
15-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	10,16	13.100,00	133.151,72	10,08	10,16	10,22	12.361,00
15-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	43,98	400,00	17.593,07	42,92	43,72	44,43	23.309,00
15-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	43,79	7.300,00	319.682,16	42,92	43,72	44,43	23.309,00
15-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,75	9.000,00	114.737,10	12,67	12,77	12,93	10.536,00
15-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQT3	35,69	1.800,00	64.233,69	34,80	35,42	35,86	17.255,00
15-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQT3	35,68	4.600,00	164.128,00	34,80	35,42	35,86	17.255,00
15-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	33,43	3.400,00	113.674,17	33,18	33,41	33,57	20.208,00
15-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	17,05	4.900,00	83.569,22	16,81	17,04	17,27	15.071,00
15-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	17,06	3.000,00	51.178,69	16,81	17,04	17,27	15.071,00
15-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	MGLU3	2,26	3.800,00	8.588,00	2,21	2,26	2,30	14.228,00
15-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	MGLU3	2,27	124.400,00	281.909,55	2,21	2,26	2,30	14.228,00
15-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	SBSPP3	77,32	2.400,00	185.575,34	76,92	77,34	77,80	6.933,00
15-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	7,66	11.500,00	88.039,79	7,54	7,64	7,82	14.715,00
15-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	7,67	7.100,00	54.425,90	7,54	7,64	7,82	14.715,00
15-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	21,27	2.000,00	42.533,56	20,84	21,27	21,49	8.835,00
15-01-24	FIA RVA EMB IV	Compra	VBR3	22,84	12.647,00	288.907,98	22,78	22,87	23,14	9.003,00
16-01-24	FIA RVA EMB II	Venda	ARZ3	60,77	6.400,00	388.926,07	59,74	60,68	61,39	10.992,00
16-01-24	FIA RVA EMB II	Venda	CVCB3	3,26	43.000,00	140.216,17	3,21	3,28	3,41	16.682,00
16-01-24	FIA RVA EMB II	Compra	PETRA	38,32	13.200,00	505.884,31	38,08	38,27	38,79	53.423,00
16-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	13,25	2.100,00	27.834,24	13,16	13,23	13,36	10.350,00
16-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	13,33	3.300,00	43.989,15	13,16	13,23	13,36	10.350,00
16-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	55,96	2.900,00	162.283,73	55,77	56,00	56,47	32.064,00
16-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	37,85	1.800,00	68.124,35	37,67	37,87	38,26	26.489,00
16-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL3	9,08	5.800,00	52.691,24	9,00	9,07	9,14	10.609,00
16-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL3	9,09	1.900,00	17.271,00	9,00	9,07	9,14	10.609,00
16-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	10,10	26.900,00	271.593,48	10,03	10,09	10,18	22.319,00
16-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,61	12.200,00	153.858,31	12,52	12,61	12,76	17.495,00
16-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	16,69	4.700,00	78.426,42	16,55	16,76	17,09	30.389,00
16-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	MGLU3	2,18	208.100,00	453.587,54	2,11	2,17	2,24	55.588,00
16-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	60,48	1.900,00	114.908,12	60,03	60,41	60,80	24.693,00
16-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	SBSPP3	76,70	600,00	46.017,62	76,20	76,53	77,43	12.472,00
16-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	25,32	1.500,00	37.979,90	25,03	25,32	25,45	8.842,00
16-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	25,37	1.000,00	25.374,52	25,03	25,32	25,45	8.842,00
16-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	7,16	6.800,00	48.688,00	7,13	7,27	7,56	23.666,00
16-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	7,23	6.000,00	43.395,81	7,13	7,27	7,56	23.666,00
16-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	20,60	6.700,00	137.997,64	20,40	20,68	21,10	15.332,00
16-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	20,66	4.800,00	99.182,86	20,40	20,68	21,10	15.332,00
16-01-24	FIA RVA EMB IV	Compra	VBR3	22,46	9.713,00	218.163,29	22,10	22,47	22,98	24.126,00
17-01-24	FIA RVA EMB II	Venda	BRF53	12,74	8.600,00	109.599,87	12,56	12,71	13,01	19.386,00
17-01-24	FIA RVA EMB II	Venda	BRF53	12,64	17.100,00	216.100,13	12,56	12,71	13,01	19.386,00
17-01-24	FIA RVA EMB II	Compra	BRSR6	13,62	2.500,00	34.043,92	13,23	13,53	13,69	5.685,00
17-01-24	FIA RVA EMB II	Venda	CBAV3	4,26	86.900,00	369.943,00	4,18	4,24	4,35	7.807,00
17-01-24	FIA RVA EMB II	Compra	CIEL3	4,55	20.700,00	94.106,36	4,46	4,51	4,62	23.304,00
17-01-24	FIA RVA EMB II	Compra	CXSE3	13,48	5.300,00	71.451,55	13,39	13,49	13,57	9.750,00
17-01-24	FIA RVA EMB II	Compra	EQT3	35,36	1.700,00	60.118,93	35,09	35,28	35,63	27.557,00
17-01-24	FIA RVA EMB II	Compra	GGP53	18,32	10.200,00	186.828,25	18,13	18,27	18,48	6.779,00
17-01-24	FIA RVA EMB II	Venda	GOAU4	9,66	2.067,00	19.968,89	9,63	9,69	9,81	22.291,00
17-01-24	FIA RVA EMB II	Venda	GOAU4	9,68	17.333,00	167.801,97	9,63	9,69	9,81	22.291,00
17-01-24	FIA RVA EMB II	Venda	HAPV3	4,32	24.610,00	106.381,12	4,25	4,34	4,50	65.560,00
17-01-24	FIA RVA EMB II	Venda	HAPV3	4,30	11.690,00	50.267,00	4,25	4,34	4,50	65.560,00
17-01-24	FIA RVA EMB II	Venda	HAPV3	4,31	7.500,00	32.319,91	4,25	4,34	4,50	65.560,00
17-01-24	FIA RVA EMB II	Compra	HYPE3	33,79	16.400,00	554.190,38	33,44	33,75	34,45	9.118,00
17-01-24	FIA RVA EMB II	Compra	JBSS3	24,37	14.200,00	346.076,69	24,21	24,36	24,44	13.904,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2024

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE JANEIRO DE 2024 À 31 DE JANEIRO DE 2024



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBVBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
17-01-24	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	69,64	3.400,00	236.766,65	69,00	69,59	70,46	74.223,00
17-01-24	FIA RVA EMB II	Compra	WEGE3	33,47	6.542,00	218.953,39	33,17	33,42	33,58	13.391,00
17-01-24	FIA RVA EMB II	Compra	WEGE3	33,45	1.558,00	52.107,62	33,17	33,42	33,58	13.391,00
17-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	24,77	900,00	22.292,08	24,59	24,82	25,16	14.065,00
17-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	14,21	5.496,00	78.089,71	13,72	14,09	14,74	33.768,00
17-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	55,90	4.023,00	224.878,93	55,63	55,89	56,10	36.496,00
17-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	33,75	900,00	30.377,06	33,45	33,76	33,92	16.953,00
17-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	37,38	1.685,00	62.993,46	36,58	37,23	38,03	37.243,00
17-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	37,11	600,00	22.263,05	36,58	37,23	38,03	37.243,00
17-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	4,51	3.600,00	16.247,65	4,46	4,51	4,62	23.304,00
17-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	9,06	4.971,00	45.037,26	9,01	9,08	9,19	8.735,00
17-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	9,07	7.402,00	67.160,16	9,01	9,08	9,19	8.735,00
17-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	10,14	8.899,00	90.221,90	10,03	10,13	10,20	16.313,00
17-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	42,06	1.549,00	65.150,45	41,70	42,02	42,42	21.856,00
17-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	42,02	303,00	12.732,06	41,70	42,02	42,42	21.856,00
17-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,64	4.000,00	50.564,66	12,54	12,62	12,74	9.204,00
17-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	35,28	1.900,00	67.033,73	35,09	35,28	35,63	27.557,00
17-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,35	5.100,00	22.199,02	4,25	4,34	4,50	65.560,00
17-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	23,71	2.700,00	64.012,74	23,47	23,69	23,88	20.719,00
17-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,09	1.800,00	18.154,92	10,02	10,08	10,13	25.200,00
17-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	32,98	600,00	19.790,28	32,83	33,01	33,16	47.142,00
17-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	16,59	2.500,00	41.481,92	16,44	16,61	16,84	31.823,00
17-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	MGLU3	2,15	41.351,00	88.862,66	2,12	2,15	2,21	48.846,00
17-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	MGLU3	2,14	7.117,00	15.230,38	2,12	2,15	2,21	48.846,00
17-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	16,57	2.353,00	38.993,53	16,23	16,69	16,92	25.790,00
17-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	PETRA	37,97	400,00	15.188,00	37,82	37,95	38,15	71.562,00
17-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	44,66	800,00	35.726,28	44,27	44,81	45,49	35.009,00
17-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,16	1.527,00	33.838,32	21,84	22,19	22,38	45.207,00
17-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,23	5.867,00	130.448,74	21,84	22,19	22,38	45.207,00
17-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	20,62	1.400,00	28.870,98	20,30	20,63	20,85	8.649,00
17-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	60,79	900,00	54.713,31	60,01	60,72	61,19	18.019,00
17-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	25,16	1.100,00	27.674,33	25,04	25,23	25,56	9.214,00
17-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	7,15	3.200,00	22.894,62	7,03	7,15	7,31	25.499,00
17-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	52,89	1.200,00	63.469,03	52,60	52,86	53,13	11.996,00
17-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	20,64	5.555,00	114.656,16	20,46	20,64	20,88	16.313,00
17-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	20,56	7.814,00	160.690,57	20,46	20,64	20,88	16.313,00
17-01-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	MALL11	118,25	730,00	86.325,05	117,72	118,12	118,48	2.321,00
18-01-24	FIA RVA EMB II	Compra	BRSR6	13,56	5.700,00	77.318,68	13,46	13,73	13,89	6.323,00
18-01-24	FIA RVA EMB II	Venda	HAPV3	4,06	67.300,00	273.457,50	3,98	4,09	4,34	52.541,00
18-01-24	FIA RVA EMB II	Venda	LREN3	16,49	15.400,00	253.978,93	16,33	16,48	16,85	25.027,00
18-01-24	FIA RVA EMB II	Compra	RRRP3	29,54	7.300,00	215.642,00	28,58	29,92	31,90	54.250,00
18-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	24,48	1.200,00	29.371,76	24,35	24,47	25,05	13.388,00
18-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	14,11	1.800,00	25.392,04	13,67	13,85	14,30	14.440,00
18-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	55,42	600,00	33.249,73	55,26	55,51	56,11	24.938,00
18-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	34,17	1.000,00	34.174,57	33,88	34,17	34,45	15.021,00
18-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	36,40	700,00	25.478,15	36,10	36,42	37,13	30.439,00
18-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	4,45	2.700,00	12.003,74	4,41	4,46	4,55	16.394,00
18-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	9,01	7.800,00	70.265,21	8,92	8,97	9,15	7.017,00
18-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	9,03	4.700,00	42.441,00	8,92	8,97	9,15	7.017,00
18-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	9,99	10.100,00	100.901,57	9,89	9,95	10,16	11.655,00
18-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	41,10	3.100,00	127.418,60	40,90	41,21	42,23	18.673,00
18-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENAT3	19,15	900,00	17.235,45	18,70	19,26	20,09	9.033,00
18-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,31	1.700,00	20.927,00	12,26	12,36	12,68	11.229,00
18-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,45	9.200,00	114.569,54	12,26	12,36	12,68	11.229,00
18-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	34,47	100,00	3.446,60	34,09	34,58	35,25	22.142,00
18-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	16,46	1.100,00	18.103,71	16,36	16,50	16,90	8.450,00
18-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,11	50.300,00	206.838,67	3,98	4,09	4,34	52.541,00
18-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	23,56	2.800,00	65.962,40	23,39	23,53	23,89	8.072,00
18-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	9,99	3.200,00	31.971,27	9,98	10,00	10,10	26.762,00
18-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	32,83	900,00	29.546,72	32,74	32,85	33,20	43.473,00
18-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	16,43	3.700,00	60.785,80	16,33	16,48	16,85	25.027,00
18-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	16,42	1.700,00	27.906,35	16,33	16,48	16,85	25.027,00
18-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	MGLU3	2,06	93.600,00	192.451,64	1,99	2,08	2,21	66.913,00
18-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	16,76	1.200,00	20.116,12	16,63	16,78	17,01	16.770,00
18-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	44,85	1.500,00	67.270,12	44,44	44,88	45,57	19.859,00
18-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	21,84	3.000,00	65.527,63	21,68	21,82	22,18	22.802,00
18-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	24,15	900,00	21.735,00	22,48	23,10	24,23	33.674,00
18-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	23,01	1.400,00	32.211,05	22,48	23,10	24,23	33.674,00
18-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	59,81	1.000,00	59.812,67	59,36	60,14	61,50	18.879,00
18-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	SBSF3	75,96	200,00	15.191,70	75,44	75,95	77,07	11.114,00
18-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	25,25	700,00	17.676,62	25,04	25,26	25,61	5.214,00
18-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	7,03	8.100,00	56.916,13	6,95	7,04	7,30	12.852,00
18-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	51,97	1.400,00	72.753,71	51,53	52,12	52,99	13.199,00
18-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	20,69	1.400,00	28.967,51	20,30	20,72	21,21	8.792,00
18-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	20,95	4.000,00	83.780,00	20,30	20,72	21,21	8.792,00
18-01-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	49,99	2.139,00	106.933,12	49,69	50,40	52,92	18.875,00
18-01-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	BPML11	95,98	5.225,00	501.481,89	94,79	95,96	95,98	19,00
19-01-24	FIA RVA EMB II	Compra	AZUL4	13,18	15.600,00	205.586,22	12,49	12,87	13,26	19.153,00
19-01-24	FIA RVA EMB II	Compra	BRSR6	13,96	6.900,00	96.324,00	13,78	13,90	13,96	5.845,00
19-01-24	FIA RVA EMB II	Venda	ECOR3	9,03	55.400,00	500.515,41	8,84	9,04	9,20	9.087,00
19-01-24	FIA RVA EMB II	Compra	ENEV3	12,46	7.900,00	98.434,00	12,27	12,52	12,76	12.129,00
19-01-24	FIA RVA EMB II	Compra	PETRA	37,48	12.400,00	464.734,44	37,23	37,51	37,90	39.117,00
19-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	24,37	900,00	21.932,29	23,92	24,35	24,59	12.939,00
19-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	55,69	1.200,00	66.831,92	55,28	55,78	56,35	24.795,00
19-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	55,77	300,00	16.730,48	55,28	55,78	56,35	24.795,00
19-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	34,50	6.000,00	207.028,47	34,26	34,54	34,79	16.520,00
19-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	34,51	500,00	17.256,63	34,26	34,54	34,79	16.520,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2024

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE JANEIRO DE 2024 À 31 DE JANEIRO 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
19-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	36,67	400,00	14.668,78	36,24	36,73	37,06	20.107,00
19-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPL6	8,94	1.500,00	13.411,00	8,90	8,95	8,99	6.086,00
19-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	41,84	1.200,00	50.211,44	41,16	41,84	42,19	19.348,00
19-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,47	2.800,00	34.929,32	12,27	12,52	12,76	12.129,00
19-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	34,39	1.100,00	37.828,92	34,16	34,40	34,70	19.344,00
19-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	3,98	2.900,00	11.545,33	3,80	3,94	4,05	52.401,00
19-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	23,63	2.000,00	47.265,05	23,13	23,56	24,16	16.861,00
19-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	9,98	2.300,00	22.956,26	9,94	9,99	10,04	18.363,00
19-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	32,87	500,00	16.435,08	32,71	32,89	33,04	34.137,00
19-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	32,86	3.100,00	101.868,75	32,71	32,89	33,04	34.137,00
19-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	16,42	1.600,00	26.270,34	16,08	16,37	16,80	30.567,00
19-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	MGLU3	1,96	32.900,00	64.337,78	1,94	2,00	2,06	70.751,00
19-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	16,26	5.800,00	94.316,23	15,89	16,62	17,36	31.970,00
19-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	16,32	1.200,00	19.584,00	15,89	16,62	17,36	31.970,00
19-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	11,66	1.100,00	12.827,00	11,46	11,64	11,80	8.110,00
19-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	44,52	600,00	26.711,43	44,28	44,55	44,87	12.978,00
19-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	22,09	2.100,00	46.385,14	21,51	22,18	22,59	24.183,00
19-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	23,38	1.100,00	25.721,36	22,53	23,30	23,68	18.320,00
19-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	59,66	700,00	41.765,44	58,24	59,66	60,57	20.306,00
19-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	25,53	500,00	12.766,38	25,07	25,43	25,91	6.960,00
19-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	7,00	6.500,00	45.502,24	6,69	6,93	7,10	15.658,00
19-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	51,31	1.200,00	61.568,17	50,98	51,36	51,92	13.019,00
19-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	20,30	2.500,00	50.750,00	20,01	20,59	21,26	13.187,00
19-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	20,18	2.700,00	54.484,86	20,01	20,59	21,26	13.187,00
19-01-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	49,40	255,00	12.597,01	48,79	49,45	50,06	17.389,00
19-01-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	49,43	613,00	30.302,85	48,79	49,45	50,06	17.389,00
19-01-24	FIA RVA EMB IV	Compra	VBRR3	22,38	9.548,00	213.726,50	22,05	22,49	22,75	16.122,00
22-01-24	FIA RVA EMB II	Compra	AZUL4	13,29	15.400,00	204.706,71	13,15	13,44	13,93	21.595,00
22-01-24	FIA RVA EMB II	Compra	BRSR6	13,57	9.900,00	134.332,39	13,44	13,58	13,93	4.693,00
22-01-24	FIA RVA EMB II	Venda	LREN3	15,83	10.200,00	161.490,32	15,64	15,98	16,50	32.650,00
22-01-24	FIA RVA EMB II	Venda	PRI03	44,25	6.300,00	278.802,92	43,80	44,25	44,77	13.085,00
22-01-24	FIA RVA EMB II	Compra	RECV3	23,48	11.800,00	277.077,86	22,87	23,42	24,02	13.565,00
22-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	24,30	900,00	21.874,43	24,16	24,35	24,69	12.086,00
22-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	24,20	1.200,00	29.036,08	24,16	24,35	24,69	12.086,00
22-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	8,08	15.100,00	122.008,00	8,02	8,11	8,39	5.788,00
22-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	8,06	6.000,00	48.337,50	8,02	8,11	8,39	5.788,00
22-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	8,08	800,00	6.463,28	8,02	8,11	8,39	5.788,00
22-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	13,12	2.100,00	27.552,00	13,06	13,10	13,15	6.785,00
22-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	13,11	4.100,00	53.764,51	13,06	13,10	13,15	6.785,00
22-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	13,10	2.200,00	28.820,00	13,06	13,10	13,15	6.785,00
22-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	34,56	1.400,00	48.384,76	34,47	34,64	34,98	19.738,00
22-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	34,50	500,00	17.250,99	34,47	34,64	34,98	19.738,00
22-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	34,56	4.300,00	148.617,84	34,47	34,64	34,98	19.738,00
22-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	4,56	3.300,00	15.059,37	4,50	4,59	4,69	18.614,00
22-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	9,97	4.400,00	43.871,66	9,81	9,90	10,03	13.860,00
22-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	40,82	1.200,00	48.985,06	40,46	40,95	42,06	26.764,00
22-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	40,76	1.300,00	52.986,17	40,46	40,95	42,06	26.764,00
22-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENAT3	19,16	600,00	11.497,56	18,90	19,19	19,43	7.628,00
22-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,67	2.300,00	29.146,14	12,53	12,68	12,81	9.666,00
22-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	33,93	1.300,00	44.107,49	33,74	34,03	34,51	12.551,00
22-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	16,30	800,00	13.039,84	16,16	16,26	16,37	5.215,00
22-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,84	76.300,00	292.661,70	3,77	3,85	4,04	38.325,00
22-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,82	3.400,00	12.981,14	3,77	3,85	4,04	38.325,00
22-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,85	41.300,00	159.005,00	3,77	3,85	4,04	38.325,00
22-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	23,25	1.600,00	37.192,09	23,15	23,49	23,86	10.904,00
22-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	9,88	1.700,00	16.794,91	9,83	9,94	10,07	19.116,00
22-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	32,23	600,00	19.335,45	31,97	32,54	33,17	40.755,00
22-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	MGLU3	1,97	54.000,00	106.560,00	1,93	1,98	2,06	45.984,00
22-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	43,99	500,00	21.994,84	43,80	44,25	44,77	13.085,00
22-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	22,21	1.700,00	37.752,03	22,15	22,31	22,62	18.989,00
22-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	23,17	800,00	18.534,86	22,87	23,42	24,02	13.565,00
22-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	58,64	500,00	29.320,24	58,43	59,19	60,61	17.685,00
22-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	SBSR3	75,99	200,00	15.198,77	75,38	76,10	76,68	9.583,00
22-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	6,66	11.100,00	73.950,64	6,61	6,78	7,05	13.512,00
22-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	51,77	700,00	36.236,70	51,42	51,67	52,07	9.168,00
22-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	20,98	4.500,00	94.418,29	20,68	20,96	21,45	15.592,00
23-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	24,78	700,00	17.346,56	24,46	24,82	25,01	12.906,00
23-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	8,29	2.900,00	24.035,25	8,15	8,29	8,39	6.648,00
23-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	8,31	3.200,00	26.592,00	8,15	8,29	8,39	6.648,00
23-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	8,27	5.100,00	42.177,00	8,15	8,29	8,39	6.648,00
23-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	8,30	1.500,00	12.447,34	8,15	8,29	8,39	6.648,00
23-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	13,81	1.600,00	22.089,42	13,60	13,74	13,91	18.659,00
23-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	13,76	1.400,00	19.265,16	13,60	13,74	13,91	18.659,00
23-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	13,17	5.900,00	77.688,21	13,08	13,15	13,20	5.328,00
23-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	AURE3	13,14	192,00	2.522,49	13,08	13,15	13,20	5.328,00
23-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	56,29	400,00	22.516,95	55,55	56,25	56,59	23.062,00
23-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	34,44	3.200,00	110.206,84	34,22	34,42	34,75	18.000,00
23-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	37,19	600,00	22.313,38	36,73	37,11	37,44	22.520,00
23-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	9,91	5.900,00	58.488,93	9,83	9,93	10,01	25.550,00
23-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	41,02	1.500,00	61.528,16	40,59	41,02	41,43	27.926,00
23-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,95	2.500,00	32.365,89	12,74	12,92	13,02	12.133,00
23-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	33,86	700,00	23.704,12	33,75	33,97	34,24	19.397,00
23-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	3,95	3.200,00	12.649,67	3,82	3,94	4,01	39.372,00
23-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	23,73	1.600,00	37.960,95	23,40	23,74	24,03	14.534,00
23-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,03	1.800,00	18.054,84	9,89	10,02	10,09	38.392,00
23-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	32,42	500,00	16.211,22	32,17	32,40	32,62	55.317,00
23-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	16,00	1.000,00	15.998,13	15,76	16,02	16,27	34.819,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2024

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE JANEIRO DE 2024 À 31 DE JANEIRO 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
23-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	MGLU3	1,95	45.200,00	88.140,00	1,93	1,96	2,01	33.591,00
23-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	17,29	1.000,00	17.291,38	17,05	17,30	17,51	18.078,00
23-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	PETR4	38,13	400,00	15.250,00	37,43	37,95	38,37	54.433,00
23-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	3,51	18.300,00	64.251,89	3,47	3,54	3,63	11.918,00
23-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	3,56	1.100,00	3.916,00	3,47	3,54	3,63	11.918,00
23-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	3,54	2.000,00	7.075,82	3,47	3,54	3,63	11.918,00
23-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	44,23	600,00	26.540,73	44,00	44,23	44,54	17.282,00
23-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	22,59	1.700,00	38.403,00	22,15	22,63	23,02	34.475,00
23-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	23,11	900,00	20.797,31	22,97	23,20	23,70	9.486,00
23-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	58,82	600,00	35.289,48	58,35	58,96	59,66	27.774,00
23-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	24,53	900,00	22.078,40	24,38	24,69	25,15	7.816,00
23-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	6,87	3.100,00	21.308,26	6,78	6,90	7,02	12.322,00
23-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	51,88	400,00	20.753,12	51,47	51,89	52,24	9.880,00
23-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	21,05	2.700,00	56.825,22	20,84	21,07	21,30	10.566,00
24-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	GMAT3	6,65	33.200,00	220.654,39	6,60	6,65	6,78	9.373,00
24-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	24,37	2.000,00	48.735,27	24,17	24,52	25,28	10.150,00
24-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	24,55	3.100,00	76.105,00	24,17	24,52	25,28	10.150,00
24-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	8,36	1.600,00	13.370,68	8,23	8,40	8,64	6.832,00
24-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	8,33	1.800,00	14.994,58	8,23	8,40	8,64	6.832,00
24-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	13,72	600,00	8.231,72	13,35	13,53	13,86	15.537,00
24-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	13,48	300,00	4.043,51	13,35	13,53	13,86	15.537,00
24-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	56,60	2.300,00	130.188,51	56,44	56,65	57,04	19.536,00
24-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	4,79	28.600,00	136.991,98	4,74	4,79	4,87	24.838,00
24-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL66	9,99	10.400,00	103.941,86	9,92	10,00	10,15	14.761,00
24-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	41,09	700,00	28.765,40	40,81	41,07	41,44	13.280,00
24-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	41,11	1.100,00	45.224,85	40,81	41,07	41,44	13.280,00
24-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	41,12	1.800,00	74.007,38	40,81	41,07	41,44	13.280,00
24-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	41,20	1.000,00	41.198,21	40,81	41,07	41,44	13.280,00
24-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,92	1.800,00	23.256,00	12,81	12,93	13,08	10.339,00
24-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,94	10.100,00	130.675,60	12,81	12,93	13,08	10.339,00
24-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,94	2.500,00	32.341,98	12,81	12,93	13,08	10.339,00
24-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	23,77	3.700,00	87.953,95	23,37	23,78	24,25	10.795,00
24-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	23,58	1.200,00	28.290,51	23,37	23,78	24,25	10.795,00
24-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	23,60	1.200,00	28.318,81	23,37	23,78	24,25	10.795,00
24-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	MGLU3	1,92	14.500,00	27.840,00	1,90	1,96	2,02	51.469,00
24-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	16,59	7.300,00	121.121,35	16,32	16,73	17,46	14.523,00
24-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	3,46	3.100,00	10.732,86	3,40	3,46	3,59	11.893,00
24-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	3,42	500,00	1.710,32	3,40	3,46	3,59	11.893,00
24-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	SBS33	76,59	1.400,00	107.231,99	76,14	76,85	78,25	9.182,00
24-01-24	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	3,99	5.956,00	23.793,84	3,94	3,98	4,05	26.322,00
24-01-24	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	3,98	19.708,00	78.521,31	3,94	3,98	4,05	26.322,00
24-01-24	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	3,99	14.890,00	59.381,32	3,94	3,98	4,05	26.322,00
24-01-24	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	3,99	13.818,00	55.133,82	3,94	3,98	4,05	26.322,00
25-01-24	FIA RVA EMB II	Compra	BBS33	33,82	16.100,00	544.497,01	33,74	33,87	34,25	12.122,00
25-01-24	FIA RVA EMB II	Venda	CXSE3	14,39	20.500,00	294.932,71	14,35	14,55	14,97	14.190,00
25-01-24	FIA RVA EMB II	Venda	LJQQ3	4,94	33.100,00	163.548,87	4,80	4,97	5,12	7.253,00
25-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	24,68	4.600,00	113.549,38	24,29	24,69	24,90	11.886,00
25-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	8,75	4.000,00	34.986,84	8,43	8,71	8,85	3.855,00
25-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	13,83	2.500,00	34.574,58	13,35	13,79	14,04	14.867,00
25-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	4,85	13.400,00	64.972,92	4,77	4,82	4,86	11.076,00
25-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL66	10,01	17.100,00	171.174,52	9,94	10,02	10,08	10.266,00
25-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	41,15	300,00	12.345,67	40,90	41,19	41,46	11.351,00
25-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	41,14	1.900,00	78.161,17	40,90	41,19	41,46	11.351,00
25-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,95	2.300,00	29.779,35	12,89	12,94	13,08	9.630,00
25-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	13,01	1.800,00	23.418,00	12,89	12,94	13,08	9.630,00
25-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,95	900,00	11.655,00	12,89	12,94	13,08	9.630,00
25-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,97	1.800,00	23.346,00	12,89	12,94	13,08	9.630,00
25-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	23,72	400,00	9.486,62	23,72	23,88	24,00	10.058,00
25-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	23,74	3.600,00	85.472,97	23,50	23,72	23,88	10.058,00
25-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	23,80	900,00	21.420,00	23,50	23,72	23,88	10.058,00
25-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	16,39	10.600,00	173.699,97	16,19	16,45	16,65	22.634,00
25-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	23,84	1.700,00	40.530,96	23,23	23,59	23,98	9.303,00
25-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	23,89	1.400,00	33.442,54	23,23	23,59	23,98	9.303,00
25-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	SBS33	76,70	1.500,00	115.046,73	76,03	76,79	77,28	10.042,00
25-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	SBS33	76,63	700,00	53.641,42	76,03	76,79	77,28	10.042,00
25-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	20,14	5.700,00	114.804,32	19,52	20,03	20,55	12.459,00
26-01-24	FIA RVA EMB II	Venda	HYPE3	31,09	9.200,00	286.050,47	30,91	31,25	31,72	11.580,00
26-01-24	FIA RVA EMB II	Compra	PETR4	39,97	6.400,00	255.816,04	38,91	39,72	40,09	57.727,00
26-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	24,72	2.200,00	54.393,88	24,53	24,70	24,92	6.344,00
26-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	8,65	700,00	6.053,40	8,62	8,69	8,80	5.954,00
26-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	13,75	3.900,00	53.631,99	13,63	13,79	14,00	10.933,00
26-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	56,81	2.700,00	153.380,80	56,55	56,81	56,99	18.474,00
26-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	4,94	3.700,00	18.278,00	4,82	4,92	4,97	20.206,00
26-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	4,92	23.200,00	114.142,60	4,82	4,92	4,97	20.206,00
26-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	4,92	3.700,00	18.217,13	4,82	4,92	4,97	20.206,00
26-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,97	16.700,00	66.279,49	3,89	3,96	4,06	37.364,00
26-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	23,51	2.200,00	51.718,83	23,35	23,51	23,71	8.933,00
26-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	15,90	7.500,00	119.270,49	15,84	16,07	16,43	18.850,00
26-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	16,19	6.200,00	100.408,06	15,84	16,07	16,43	18.850,00
26-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	3,38	9.400,00	31.787,83	3,35	3,39	3,47	7.443,00
26-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	57,07	1.500,00	85.602,82	56,04	57,02	58,90	31.598,00
26-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	19,36	5.000,00	96.796,56	18,99	19,29	19,78	13.350,00
26-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	19,64	4.800,00	94.251,76	18,99	19,50	19,78	13.350,00
26-01-24	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	3,98	55.272,00	220.020,53	3,89	3,96	4,06	37.364,00
29-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	24,50	1.800,00	44.103,73	24,31	24,48	24,77	7.742,00
29-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	24,51	1.900,00	46.574,79	24,31	24,48	24,77	7.742,00
29-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	24,56	1.700,00	41.750,09	24,31	24,48	24,77	7.742,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JANEIRO 2024

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE JANEIRO DE 2024 À 31 DE JANEIRO DE 2024



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBVBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
29-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	14,08	3.904,00	54.954,14	13,71	14,21	14,48	16.921,00
29-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	4,96	15.300,00	75.816,73	4,83	4,91	4,99	23.742,00
29-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	4,91	10.400,00	51.058,69	4,83	4,91	4,99	23.742,00
29-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	35,14	2.100,00	73.802,27	35,00	35,17	35,36	8.714,00
29-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	23,76	4.500,00	106.937,10	23,34	23,77	23,95	10.104,00
29-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	23,70	900,00	21.331,79	23,34	23,77	23,95	10.104,00
29-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	2,19	167.500,00	367.234,74	2,07	2,15	2,28	40.624,00
29-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	15,82	8.200,00	129.707,91	15,60	15,81	16,07	18.019,00
29-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	PETZ3	3,42	10.000,00	34.192,28	3,36	3,41	3,47	11.253,00
29-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	44,55	1.000,00	44.548,69	44,21	44,80	45,79	14.958,00
29-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	23,25	2.700,00	62.786,56	23,11	23,31	23,97	6.636,00
29-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	55,76	3.100,00	172.861,18	55,04	55,87	57,31	29.983,00
29-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	50,53	900,00	45.477,00	50,31	50,92	52,24	36.380,00
29-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	50,92	7.700,00	392.084,53	50,31	50,92	52,24	36.380,00
29-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	19,68	2.300,00	45.257,97	19,49	19,69	20,00	9.137,00
29-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	19,77	2.200,00	43.494,00	19,49	19,69	20,00	9.137,00
30-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	B3SA3	13,02	25.400,00	330.648,56	12,93	13,02	13,26	32.804,00
30-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	BBDCA	15,31	50.900,00	779.428,94	15,27	15,37	15,51	30.607,00
30-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	BRF53	13,74	12.600,00	173.108,35	13,63	13,82	14,24	11.632,00
30-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	HYPE3	31,15	7.200,00	224.295,10	30,66	31,09	32,03	11.166,00
30-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	23,63	2.000,00	47.260,00	23,58	23,86	24,41	17.378,00
30-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	23,84	1.100,00	26.219,44	23,58	23,86	24,41	17.378,00
30-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	8,31	300,00	2.493,70	8,25	8,33	8,45	5.081,00
30-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	8,30	15.200,00	126.160,00	8,25	8,33	8,45	5.081,00
30-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBA53	56,28	400,00	22.510,52	55,95	56,23	56,50	23.050,00
30-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSF3	33,89	1.500,00	50.839,42	33,79	33,92	34,14	11.080,00
30-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	35,84	800,00	28.673,93	35,56	35,96	36,75	22.275,00
30-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	4,72	3.800,00	17.949,29	4,70	4,74	4,87	17.874,00
30-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPL66	9,89	1.500,00	14.832,00	9,86	9,91	10,04	16.078,00
30-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	40,15	2.100,00	84.315,00	40,00	40,27	40,85	13.864,00
30-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENAT3	18,90	800,00	15.120,97	18,82	18,98	19,42	5.183,00
30-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,76	5.200,00	66.361,57	12,65	12,78	12,96	12.194,00
30-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	34,51	2.800,00	96.631,06	34,40	34,60	35,18	20.377,00
30-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	16,13	2.600,00	41.930,86	16,06	16,16	16,42	6.767,00
30-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	16,13	1.600,00	25.808,00	16,06	16,16	16,42	6.767,00
30-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,80	10.400,00	39.567,22	3,76	3,81	3,92	37.669,00
30-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	23,55	1.800,00	42.390,00	23,26	23,64	23,87	14.618,00
30-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	23,57	1.000,00	23.567,99	23,26	23,64	23,87	14.618,00
30-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	23,52	1.500,00	35.284,18	23,26	23,64	23,87	14.618,00
30-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	9,88	4.000,00	39.515,82	9,86	9,90	9,97	25.579,00
30-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	32,43	1.100,00	35.675,25	32,33	32,51	32,74	34.683,00
30-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	15,58	1.100,00	17.141,08	15,37	15,54	15,71	16.411,00
30-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	2,01	24.000,00	48.304,65	1,98	2,04	2,13	36.193,00
30-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	15,29	5.400,00	82.552,55	15,06	15,35	15,64	26.225,00
30-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	11,47	1.200,00	13.765,09	11,27	11,43	11,61	3.333,00
30-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	43,71	100,00	4.371,20	43,51	43,94	44,50	31.768,00
30-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	22,81	3.700,00	84.406,43	22,60	22,78	23,10	18.621,00
30-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	22,79	1.100,00	25.068,80	22,72	22,87	23,33	5.954,00
30-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	22,89	300,00	6.865,71	22,72	22,87	23,33	5.954,00
30-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	54,33	3.200,00	173.841,58	53,85	54,40	55,65	33.393,00
30-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	54,55	1.100,00	60.007,63	53,85	54,40	55,65	33.393,00
30-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	SBSF3	77,88	300,00	23.362,52	77,58	78,02	78,30	10.491,00
30-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	24,33	800,00	19.460,33	24,18	24,40	24,77	3.598,00
30-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	6,75	4.800,00	32.417,06	6,67	6,75	6,82	10.482,00
30-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	52,10	1.700,00	88.574,05	50,52	51,77	52,26	14.807,00
30-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	18,86	12.200,00	230.038,99	18,64	18,90	19,59	18.354,00
30-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	18,97	1.700,00	32.249,00	18,64	18,90	19,59	18.354,00
30-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	18,80	1.700,00	31.960,00	18,64	18,90	19,59	18.354,00
30-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	18,90	700,00	13.232,80	18,64	18,90	19,59	18.354,00
30-01-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	49,80	21.541,00	1.072.741,80	50,06	50,51	51,70	23.163,00
30-01-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI4	9,96	200	19,92	8,27	8,38	8,58	29,00
30-01-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	RRCB11	157,80	634,00	100.045,20	157,50	157,81	158,84	717,00
31-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	24,44	1.900,00	46.426,97	24,16	24,73	25,03	13.275,00
31-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	CIEL3	4,98	6.600,00	32.841,35	4,76	4,94	5,03	33.645,00
31-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL66	8,98	18.300,00	164.313,21	8,84	8,99	9,11	12.085,00
31-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL66	8,95	2.000,00	17.900,00	8,84	8,99	9,11	12.085,00
31-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPL66	10,10	1.800,00	18.180,00	9,95	10,13	10,24	26.562,00
31-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPL66	10,13	13.000,00	131.646,06	9,95	10,13	10,24	26.562,00
31-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPL66	10,11	3.200,00	32.352,00	9,95	10,13	10,24	26.562,00
31-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	41,11	2.900,00	119.210,40	40,40	41,00	41,50	22.967,00
31-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	13,11	700,00	9.175,73	12,73	12,96	13,18	12.284,00
31-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	13,09	3.600,00	47.106,00	12,73	12,96	13,18	12.284,00
31-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	13,00	1.800,00	23.400,00	12,73	12,96	13,18	12.284,00
31-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	35,70	700,00	24.991,57	34,59	35,47	35,74	23.407,00
31-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	35,57	3.100,00	110.265,97	34,59	35,47	35,74	23.407,00
31-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	16,37	2.100,00	34.381,03	16,11	16,32	16,48	12.167,00
31-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	16,32	900,00	14.688,00	16,11	16,32	16,48	12.167,00
31-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	16,31	1.300,00	21.200,97	16,11	16,32	16,48	12.167,00
31-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	16,36	3.300,00	53.978,31	16,11	16,32	16,48	12.167,00
31-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,95	2.800,00	11.064,07	3,86	3,94	4,02	46.046,00
31-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	24,23	1.800,00	43.622,27	23,63	24,16	24,43	15.201,00
31-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	PETRA	40,70	5.200,00	211.645,95	40,18	40,67	41,24	61.288,00
31-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	44,30	4.800,00	212.661,86	43,76	44,17	44,74	17.645,00
31-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	54,92	5.800,00	318.514,23	54,12	54,77	55,82	35.789,00
31-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	24,65	2.900,00	71.477,73	24,25	24,62	25,16	8.778,00
31-01-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	7,89	53.200,00	419.950,87	6,78	7,77	8,12	38.988,00
31-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	19,16	5.800,00	111.100,84	18,78	19,27	19,55	15.903,00

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE JANEIRO DE 2024 À 31 DE JANEIRO 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
31-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	19,34	3.800,00	73.473,66	18,78	19,27	19,55	15.903,00
31-01-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	19,15	1.300,00	24.895,00	18,78	19,27	19,55	15.903,00
31-01-24	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	23,75	2.647,00	62.866,77	23,45	23,78	24,03	31.720,00
31-01-24	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	23,82	7.930,00	188.856,96	23,45	23,78	24,03	31.720,00
31-01-24	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	23,81	876,00	20.859,60	23,45	23,78	24,03	31.720,00

7. RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS

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

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

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

8. GLOSSÁRIO

Administrador

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

Carteira

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

Dados Gerais

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

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

Duration

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

Vide também glossário de Valor Presente.

ETL (Expected Tail Loss)

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

Fundo de Investimento

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

Índice de Referência (*Benchmark*)

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

LDI (*Liability Driven Investments*)

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

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

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

Patrimônio de Cobertura

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

Patrimônio Líquido (PL)

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

Rating

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

Stress Testing

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

Tracking Error

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

Túnel de Preços

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

Valor Presente

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

Value at Risk (VaR)

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