



# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO

Junho/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









## Relatório de Risco de Mercado



Data: 28/06/2024

FUNDO: EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS  
CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais							
PL:	4.844.348.854,91	VAR / PL:	0,8992%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	1.539,26
VAR:	43.660.007,24	ETL / PL:	1,1276%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1.059,23
ETL:	54.626.006,44	VAR / CDI:	0,0098%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	153.037.847,92	Cenário Baixa - 10000 (+):	228.847.909,24	CENARIO BRADESCO 1 (+):	293.138.637,08	CENARIO BRADESCO 2 (+):	2.959.536.888,28
Cenário Alta - 09999 (-):	-225.535.324,84	Cenário Baixa - 10000 (-):	-184.386.994,92	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-24.575.639,66	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-3.255.328.043,80
Cenário Alta - 09999:	-72.497.476,92	Cenário Baixa - 10000:	44.460.914,32	CENARIO BRADESCO 1:	268.562.997,53	CENARIO BRADESCO 2:	-295.791.155,52

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
TAE11	406.618,17	19.813,60	9.104,03	0,02%	-49.576,48	-11.087,52	11.335,62	-15.336,18
TBSP11	2.657.481,54	387,75	292,88	0,00%	-2.536,66	2.066,91	3.500,92	-4.966,16
TCI11	10.235.352,19	184.929,20	143.664,31	0,33%	-1.234.543,63	-19.959,93	566.043,47	-692.146,41
TEPP11	4.722.268,00	259.118,48	161.505,56	0,37%	2.361.134,00	-2.361.134,00	692.284,49	-697.951,21
TIMS3	1.373.778,80	86.018,38	21.960,89	0,05%	439.609,22	-315.969,12	201.395,97	-203.044,51
TOTF3	1.391.959,49	126.679,07	-7.822,23	-0,02%	278.391,90	-278.391,90	204.061,26	-205.731,61
TRPL4	564.906,12	39.068,39	23.646,05	0,05%	112.981,02	-141.226,28	82.815,09	-83.492,98
TRXF11	9.506.187,60	252.887,57	132.439,64	0,30%	2.471.608,78	-2.471.608,78	1.393.607,10	-1.405.014,53
UGPA3	12.209.486,40	803.338,78	345.105,09	0,79%	3.052.371,60	-2.441.897,28	1.789.910,71	-1.804.562,09
UNEG11	9.587.361,87	217.054,65	155.551,05	0,36%	-1.288.998,50	42.155,43	634.332,46	-777.212,90
USIM5	221.456,27	26.944,02	-2.230,14	-0,01%	86.367,95	-48.720,38	32.465,49	-32.731,24
UTPS21	5.963.673,28	117.427,82	83.939,29	0,19%	-735.144,22	-16.111,98	326.899,61	-408.738,52
VALE3	25.878.169,08	2.015.327,66	1.188.540,45	2,73%	6.469.542,27	-6.469.542,27	3.793.739,59	-3.824.793,39
VAMO22	1.087.067,81	41,35	29,48	0,00%	-253,50	206,30	364,38	-533,62
VAMO3	205.252,98	32.960,53	29.884,97	0,07%	71.838,54	-82.101,19	30.090,09	-30.336,39
VAMO33	4.031.484,19	61.262,71	45.153,29	0,10%	-435.186,25	-51.457,30	158.334,39	-203.920,66
VAMO34	7.156.450,42	107.460,82	79.495,74	0,18%	-767.895,15	-81.350,43	286.761,21	-368.457,84
VBBR3	3.924.748,30	381.776,46	254.193,15	0,58%	981.187,08	-981.187,08	575.368,10	-580.077,80
VCES11	1.589.222,84	578,11	442,83	0,00%	-4.119,84	3.427,32	5.719,12	-7.787,72
VECS11	3.632.845,33	34,89	21,69	0,00%	-221,65	188,57	357,02	-533,44
VERDECS2	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
VERO12	8.269.771,40	95.949,22	64.616,05	0,15%	-748.265,93	-171.476,16	209.508,33	-274.171,65
VIMT13	8.568.616,85	159.604,50	119.673,53	0,27%	-1.000.419,17	-42.991,36	427.174,99	-535.576,38
VIV3	1.330.590,42	166.726,67	80.042,42	0,18%	399.177,13	-399.177,13	195.064,56	-196.661,26
VIVT3	2.593.175,96	169.420,42	-63.403,94	-0,15%	394.890,25	-384.601,05	380.159,60	-383.271,41
VIXL14	2.173.396,57	84,90	57,81	0,00%	-514,01	425,29	774,34	-1.143,85
VRDN12	9.531.767,50	155.022,37	114.997,11	0,26%	-1.056.970,45	-114.356,50	480.876,12	-509.079,79
VVMR11	3.991.110,50	47.320,34	-873,91	0,00%	0,00	0,00	585.096,80	-589.886,13
VVRT11	2.574.425,15	224,61	167,22	0,00%	-1.439,19	1.169,27	1.998,41	-2.867,25
WDOQ24	-54.445,15	210.252,54	134.482,15	0,31%	-434.041,04	441.935,82	-562.201,09	565.600,64
WEGE3	5.892.002,26	470.228,99	47.711,97	0,11%	1.473.000,57	-1.473.000,57	863.767,53	-870.837,93
XPIN11	2.733.252,90	99.369,84	62.368,63	0,14%	1.366.626,45	-1.366.626,45	400.694,88	-403.974,78
XPPR11	1.966.885,56	70.904,04	4.776,55	0,01%	983.442,78	-983.442,78	288.345,42	-290.705,69
YDUQ3	2.207.929,77	327.408,92	88.143,15	0,20%	861.092,81	-551.982,44	323.682,90	-326.332,02
Total Var:	4.924.698.265,86	82.697.192,27	43.560.007,24	99,95%	-72.497.476,92	44.460.914,32	268.562.997,51	-295.791.155,52

## Relatório de Risco de Mercado



Data: 28/06/2024

FUNDO: EMBRAERPREV RENDA FIXA  
CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais							
PL:	4.077.943.493,15	VAR / PL:	0,7944%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	1.774,43
VAR:	32.393.466,04	ETL / PL:	0,9962%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1.221,07
ETL:	40.622.713,28	VAR / CDI:	0,0087%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	0,00	Cenário Baixa - 10000 (+):	183.386.639,54	CENARIO BRADESCO 1 (+):	199.232.856,97	CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00
Cenário Alta - 09999 (-):	-205.822.121,00	Cenário Baixa - 10000 (-):	-3.747.448,13	CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-224.701.676,05
Cenário Alta - 09999:	-205.822.121,00	Cenário Baixa - 10000:	179.639.091,42	CENARIO BRADESCO 1:	199.232.856,97	CENARIO BRADESCO 2:	-224.701.676,05

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
CAXA	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
FI RF EMB II	3.197.322.317,02	25.902.773,96	25.623.926,02	79,10%	-155.800.211,41	175.850.836,41	175.490.399,27	-195.841.122,31
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	134.106.766,08	1.337.136,03	978.165,17	3,02%	-5.802.725,07	-885.479,06	1.640.254,30	-2.163.592,28
FIM EMB II A	236.775.842,72	349.395,13	304.660,29	0,94%	-1.418.709,23	1.639.533,91	1.338.625,32	-1.843.938,09
FIM EMB VI A CRED PRIV	241.796.126,54	1.954.253,21	1.799.483,55	5,56%	-11.859.984,91	5.896.169,23	8.620.885,65	-9.553.202,85
FIM EMB VII A CRED PRIV	317.201.049,30	4.566.076,53	3.687.231,00	11,39%	-31.240.490,39	-2.861.989,07	12.142.892,43	-15.299.820,52
Total Var:	4.127.202.101,67	34.109.634,86	32.393.466,04	100,00%	-205.822.121,00	179.639.091,42	199.232.856,97	-224.701.676,05

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JUNHO 2024

## Relatório de Risco de Mercado



Data: 28/06/2024

FUNDO: **EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL**  
 CNPJ: **10679245000140**

Dados Gerais			
PL:	495.575.278,67	VAR / PL:	4,9394%
VAR:	24.478.269,33	ETL / PL:	6,1942%
ETL:	30.696.737,28	VAR / CDI:	0,0541%
Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	3,76
Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1,53
Benchmark:			

Cenários de STRESS			
Cenário Alta - 09999 (+):	117.955.782,91	Cenário Baixa - 10000 (+):	0,00
Cenário Alta - 09999 (-):	0,00	Cenário Baixa - 10000 (-):	-115.552.860,31
Cenário Alta - 09999:	117.955.782,91	Cenário Baixa - 10000:	-115.552.860,31
CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	63.307.770,65	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	0,00
CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	-63.828.201,66
CENÁRIO BRADESCO 1:	63.307.770,65	CENÁRIO BRADESCO 2:	-63.828.201,66

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	90.539.363,06	4.464.411,52	4.438.323,05	18,13%	22.983.039,15	-23.247.204,57	13.031.120,73	-13.137.837,02
FIA RVA EMB III	105.769.479,32	5.567.527,86	5.152.046,06	21,05%	28.573.591,85	-26.934.507,99	13.680.872,29	-13.795.711,35
FIA RVA EMB IV	100.605.160,38	5.205.419,97	4.995.664,91	20,41%	29.550.304,79	-28.015.089,73	13.841.516,35	-13.955.123,34
FIC FIA EMB VIII ETF	84.930.132,90	4.609.929,48	4.477.827,98	18,29%	7.631.479,82	-7.631.513,40	6.215.447,14	-6.266.325,35
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	113.739.324,86	5.515.374,84	5.414.407,32	22,12%	29.217.367,31	-29.724.544,63	16.538.814,15	-16.673.204,60
<b>Total Var:</b>	<b>495.575.460,53</b>	<b>25.362.663,68</b>	<b>24.478.269,33</b>	<b>100,00%</b>	<b>117.955.782,91</b>	<b>-115.552.860,31</b>	<b>63.307.770,65</b>	<b>-63.828.201,66</b>

## Relatório de Risco de Mercado



Data: 28/06/2024

FUNDO: **FI RF EMB II**  
 CNPJ: **11005764000196**

Dados Gerais			
PL:	3.186.453.029,89	VAR / PL:	0,8129%
VAR:	25.902.763,89	ETL / PL:	1,0194%
ETL:	32.483.110,93	VAR / CDI:	0,0089%
Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	1.963,71
Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1.350,94
Benchmark:			

Cenários de STRESS			
Cenário Alta - 09999 (+):	0,00	Cenário Baixa - 10000 (+):	176.761.357,03
Cenário Alta - 09999 (-):	-155.800.150,80	Cenário Baixa - 10000 (-):	-910.589,02
Cenário Alta - 09999:	-155.800.150,80	Cenário Baixa - 10000:	175.850.768,00
CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	175.490.331,01	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	0,00
CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	-195.841.046,13
CENÁRIO BRADESCO 1:	175.490.331,01	CENÁRIO BRADESCO 2:	-195.841.046,13

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	8.413.084,00	109.241,37	60.585,15	0,23%	0,00	0,00	0,00	0,00
ELET42	14.722.647,31	177.884,52	72.165,94	0,28%	0,00	0,00	0,00	0,00
ENTV12	13.918.857,82	171.328,25	91.788,84	0,35%	-33.566,76	34.236,07	117.696,59	-179.144,09
GASP17	49.639.450,74	689.113,61	500.639,91	1,93%	0,00	0,00	0,00	0,00
IGSN15	2.666.868,49	40.437,14	28.272,67	0,11%	-142.750,24	-17.579,61	30.304,67	-40.845,35
NEOE16	7.428.212,55	92.775,38	39.224,88	0,15%	0,00	0,00	0,00	0,00
NTNB20240815 - 760199_VENCIMENTO	128.781.520,02	248.415,95	-130.357,96	-0,50%	-1.404.710,48	-381.501,09	358.288,00	-471.149,92
NTNB20260815 - 760199_VENCIMENTO	43.448.046,17	245.525,13	210.482,46	0,81%	-1.322.235,87	-255.809,30	405.358,15	-527.339,41
NTNB20300815 - 760199_VENCIMENTO	26.456.328,73	266.007,79	251.471,94	0,97%	-1.238.117,84	1.411.109,32	1.094.429,87	-1.442.749,86
NTNB20350515 - 760199_VENCIMENTO	230.281.304,46	3.015.764,25	2.978.072,60	11,50%	-269.175,25	-30.405,73	100.205,53	-127.581,67
NTNB20400815 - 760199_VENCIMENTO	28.935.784,04	416.384,43	415.316,97	1,60%	-738.073,68	-199.915,69	190.490,91	-250.137,58
NTNB20450515 - 760199_VENCIMENTO	215.695.851,37	3.399.849,24	3.376.002,02	13,03%	-210.812,97	294.091,50	200.860,89	-272.072,49
NTNB20500815 - 760199_VENCIMENTO	690.204.372,74	11.493.603,20	11.457.545,79	44,23%	-976.984,58	980.661,20	830.709,88	-1.101.267,03
NTNB20550515 - 760199_VENCIMENTO	213.624.190,49	3.825.887,25	3.810.524,34	14,71%	-1.437.800,08	1.266.623,43	1.297.095,12	-1.652.403,68
PETRA5	9.767.758,87	23.842,24	3.668,92	0,01%	-18.129.685,27	17.439.532,77	18.299.860,62	-22.305.284,35
SBSP2C	4.963.582,99	40.731,97	18.813,95	0,07%	-2.950.212,53	2.682.566,46	2.953.483,80	-3.456.745,47
BBTOPIND	256.495.681,98	2.462.709,42	2.402.343,69	9,27%	-21.271.579,67	29.212.523,18	26.172.101,35	-29.587.456,50
CAIXA	5.000,00	0,00	0,00	0,00%	-78.578.790,18	93.368.617,20	92.309.949,84	-101.102.645,71
COMPROMISSADA_PRE	1.171.558.763,02	12.718,30	6.185,58	0,02%	-26.938.098,91	30.071.495,89	31.097.222,11	-33.280.478,54
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-65.898,48	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-49.499,81	-11.335,65	10.182,53	-13.801,21
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-107.056,70	-14.041,94	22.181,16	-29.943,24
cota_BBTOPIMA	80.379.666,00	438.688,51	310.014,20	1,20%	0,00	0,00	0,00	0,00
<b>Total Var:</b>	<b>3.197.321.073,33</b>	<b>27.169.907,95</b>	<b>25.902.763,89</b>	<b>99,97%</b>	<b>-155.800.150,80</b>	<b>175.850.768,01</b>	<b>175.490.331,01</b>	<b>-195.841.046,13</b>



# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JUNHO 2024



Data: 28/06/2024

## Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FI RF EMB V CREDITO PRIVADO  
CNPJ: 20726178000121

Dados Gerais							
PL:	131.189.943,32	VAR / PL:	1,0192%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	622,10
VAR:	1.337.136,03	ETL / PL:	1,2782%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	429,16
ETL:	1.676.822,52	VAR / CDI:	0,0112%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	0,00	Cenário Baixa - 10000 (+):	292.232,36	CENARIO BRADESCO 1 (+):	1.640.254,30	CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00
Cenário Alta - 09999 (-):	-5.802.725,06	Cenário Baixa - 10000 (-):	-1.177.711,42	CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-2.163.592,28
Cenário Alta - 09999:	-5.802.725,06	Cenário Baixa - 10000:	-885.479,06	CENARIO BRADESCO 1:	1.640.254,30	CENARIO BRADESCO 2:	-2.163.592,28

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
17H0164854	6.875.093,19	80.449,08	71.090,23	5,32%	-347.319,87	-92.234,14	74.761,80	-99.744,36
AEGP23	15.584.871,56	248.024,34	223.156,99	16,69%	-243.042,54	-20.558,78	54.151,12	-72.893,36
CCRDD1	3.221.489,23	29.132,60	16.468,94	1,23%	0,00	0,00	0,00	0,00
CMDT33	716.821,53	5.882,35	3.447,57	0,26%	-48.125,20	-11.435,19	10.362,00	-14.008,57
ENJG21	1.419.479,50	19.649,79	17.977,43	1,34%	-15.460,72	-2.027,88	3.203,32	-4.324,29
ENM21	925.985,53	12.959,27	11.772,63	0,88%	-273,26	278,71	958,14	-1.458,37
ENTV12	18.297.498,51	225.225,27	174.079,74	13,02%	0,00	0,00	0,00	0,00
ERDV17_VENCIMENTO	6.430.442,10	194.191,10	172.246,44	12,88%	0,00	0,00	0,00	0,00
ERDV36	2.209.617,48	19.981,96	11.296,03	0,84%	-72.870,32	-19.463,30	15.366,58	-20.523,73
GASP17	10.270.231,19	142.575,23	45.851,83	3,43%	-48.483,71	-12.992,96	10.227,47	-13.657,91
GRRB24_VENCIMENTO	16.860.696,91	201.269,25	133.818,36	10,01%	-1.738.189,24	-336.282,64	532.877,06	-693.231,60
LFSN16000GM	15.497.678,30	162.889,60	97.998,78	7,33%	-182.656,08	-7.871,24	43.076,38	-57.998,79
LFSN18000DC5	5.066.924,06	159.837,23	143.069,22	10,70%	-33.009,04	-7.843,39	7.107,29	-9.608,47
OMGE31	13.017.282,93	208.746,60	187.405,52	14,02%	-256.162,31	291.953,65	226.433,77	-298.499,97
SBSPC2	3.803.894,38	31.215,38	18.294,94	1,37%	-1.612.554,45	-444.067,60	409.655,03	-538.505,70
TAE33	4.385.871,30	23.613,37	9.107,34	0,68%	-284.805,03	-20.865,98	67.722,28	-91.431,40
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	-170.446,26	-19.782,49	37.409,84	-50.329,00
COMPROMISSADA_PRE	9.537.398,31	103,54	54,04	0,00%	-617.706,55	-160.437,12	118.607,86	-159.093,25
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-15.599,95	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-82.044,03	-10.761,19	16.998,77	-22.947,32
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-49.576,48	-11.087,52	11.336,62	-15.336,18
Total Var:	134.106.766,07	1.765.744,85	1.337.136,03	100,00%	-5.802.725,07	-885.479,06	1.640.254,30	-2.163.592,28



# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JUNHO 2024



Data: 28/06/2024

## Relatório de Risco de Mercado

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

Dados Gerais								
PL:	245.207.949,65	VAR / PL:	0,8589%	Limite Fundo:		0,00%	Dutacion DC:	999,29
VAR:	2.106.181,97	ETL / PL:	1,0771%	Status:	ENQUADRADO		Dutacion DU:	688,76
ETL:	2.641.237,16	VAR / CDI:	0,0094%	Benchmark:				

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	315.560,37	Cenário Baixa - 10000 (+):	7.323.690,04	CENARIO BRADESCO 1 (+):	9.629.970,32	CENARIO BRADESCO 2 (+):	129.774.316,08
Cenário Alta - 09999 (-):	-12.774.248,77	Cenário Baixa - 10000 (-):	-969.137,19	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-338.874,46	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-140.070.209,93
Cenário Alta - 09999:	-12.458.688,40	Cenário Baixa - 10000:	6.354.552,86	CENARIO BRADESCO 1:	9.291.095,86	CENARIO BRADESCO 2:	-10.295.893,84

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
RDOR9	1.129.301,45	611,84	460,32	0,02%	-4.623,15	3.914,93	6.542,88	-8.851,38
RDORCS	1.614.901,08	874,93	688,26	0,03%	-6.611,10	5.598,35	9.356,33	-12.371,47
RIS412	2.775.136,35	46.410,53	37.885,92	1,80%	-318.431,81	-32.111,30	123.350,49	-156.870,48
RLOG11	1.023.295,25	12,97	6,76	0,00%	-78,48	67,30	129,78	-193,86
RODB11	2.817.430,86	2.446,38	1.839,18	0,09%	-17.896,22	15.006,28	25.049,55	-33.731,31
RSAN24	1.880.275,70	55,44	33,36	0,00%	-335,92	275,31	503,77	-744,96
SNGO18	1.190.649,98	24,47	13,78	0,00%	-151,61	127,29	235,87	-350,59
TBSP11	2.657.481,54	387,75	278,24	0,01%	-2.536,66	2.066,91	3.600,92	-4.966,16
UNEG11	4.591.545,83	103.951,05	83.242,36	3,95%	-617.322,66	20.188,93	303.792,28	-372.220,09
VAMO33	2.771.565,52	42.116,90	32.995,40	1,57%	-299.181,93	-35.375,88	108.851,76	-140.191,41
VCCS11	1.589.222,84	578,11	433,51	0,02%	-4.119,84	3.427,32	5.719,12	-7.787,72
VECS11	3.632.845,33	34,89	18,33	0,00%	-221,65	188,57	357,02	-533,44
VERDECS2	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
VIXL14	2.173.396,57	84,90	51,23	0,00%	-514,01	425,29	774,34	-1.143,85
VVRT11	2.574.425,15	224,61	156,92	0,01%	-1.439,19	1.169,27	1.998,41	-2.867,25
<b>Total Var:</b>	<b>260.593.990,36</b>	<b>2.695.936,76</b>	<b>2.106.181,97</b>	<b>100,01%</b>	<b>-12.458.688,40</b>	<b>6.354.552,86</b>	<b>9.291.095,86</b>	<b>-10.295.893,84</b>

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JUNHO 2024

## Relatório de Risco de Mercado



Data: 28/06/2024

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

Dados Gerais	
PL: 292.694.079,79	VAR / PL: 1,6591%
VAR: 4.856.086,75	ETL / PL: 2,0806%
ETL: 6.069.726,70	VAR / CDI: 0,0182%
Limite Fundo: ENQUADRADO	0,00%
Status: ENQUADRADO	Dutacion DC: 1,755,15
Benchmark:	Dutacion DU: 1,208,48

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	0,00	Cenário Baixa - 10000 (+):	114.418,31	CENARIO BRADESCO 1 (+):	12.913.924,57	CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00
Cenário Alta - 09999 (-):	-33.224.701,91	Cenário Baixa - 10000 (-):	-3.158.162,76	CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-16.271.574,80
Cenário Alta - 09999:	-33.224.701,91	Cenário Baixa - 10000:	-3.043.744,45	CENARIO BRADESCO 1:	12.913.924,57	CENARIO BRADESCO 2:	-16.271.574,80

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
ANEM11	10.276.500,21	202.321,03	198.025,99	4,08%	-1.258.599,55	-19.554,73	569.135,42	-703.456,75
ANET11	1.932.080,07	19.413,43	16.254,34	0,33%	-127.509,73	-35.461,95	29.476,12	-39.009,21
APPSA2	3.363.014,80	47.038,61	43.746,26	0,90%	-352.725,46	-47.474,49	124.244,70	-160.255,20
ASAB11	5.893.843,50	83.255,19	82.556,96	1,70%	-597.990,51	-99.581,76	201.051,25	-258.128,78
ASER12	2.707.313,16	66.070,79	62.339,75	1,28%	-432.390,37	-19.023,40	220.978,58	-265.383,39
BRKP28	10.395.316,81	219.407,70	210.182,56	4,33%	-1.366.649,22	-107.349,25	566.510,99	-713.770,92
CAEC21	9.224.883,98	112.384,72	85.238,84	1,76%	-819.334,22	-238.169,54	195.767,66	-258.290,85
CAXA	999,99	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CART13	9.755.891,34	161.274,41	160.833,12	3,31%	-1.081.899,80	-102.721,73	418.895,75	-531.187,90
CBAN32	16.286.106,22	260.686,18	258.379,38	5,32%	-1.832.205,00	-198.083,67	696.211,24	-886.033,18
CBAN72	4.305.766,31	72.260,59	71.442,56	1,47%	-497.452,60	-47.938,26	193.856,89	-246.180,50
CJEN13	6.870.964,68	114.087,36	113.772,54	2,34%	-745.217,30	-64.091,91	292.311,84	-369.729,15
CNRD11	9.854.947,53	185.076,14	181.443,45	3,74%	-1.166.203,40	-67.094,93	487.133,15	-612.270,68
COMPROMISSADA_PRE	21.069.186,74	228,72	58,93	0,00%	-603,66	615,70	2.116,64	-3.221,71
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	3.496.875,09	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CRMO15	8.932.543,00	119.291,92	111.035,85	2,29%	-759.456,54	-127.157,84	239.032,55	-310.571,90
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ERDV17	4.790.679,37	144.672,37	79.801,82	1,64%	-136.078,78	-5.864,08	32.091,90	-43.209,10
ERDV38	5.907.683,43	71.702,85	49.968,98	1,03%	-248.042,12	-59.340,61	47.944,64	-64.372,83
GBSP11	4.445.091,02	96.192,45	91.279,30	1,88%	-662.316,74	21.933,52	332.279,75	-398.352,75
GRRB24	9.707.257,91	115.877,33	88.776,85	1,83%	-928.400,65	-255.664,33	235.851,88	-310.035,45
HARG11	9.948.679,14	183.613,60	179.431,45	3,69%	-1.129.307,29	-22.133,91	499.952,02	-623.280,76
HVRD15	11.385.348,53	198.308,08	193.964,63	3,99%	-1.389.070,57	-118.965,69	553.148,70	-698.958,07
IPIL11	7.483.690,24	112.652,61	112.297,94	2,31%	-738.503,61	-82.216,58	272.552,70	-346.628,01
IRBR12	11.567.954,66	183.918,80	131.317,66	2,70%	-687.893,50	-194.789,35	138.984,33	-185.748,35
ITPQ14	9.047.336,89	180.309,02	176.065,00	3,63%	-1.149.040,82	-31.075,06	506.996,90	-633.319,55
LCAMD1	11.036.679,42	166.347,62	156.064,54	3,21%	-1.185.783,67	-120.129,93	446.037,33	-573.146,35
LORTA7	6.382.431,94	98.127,99	91.846,20	1,89%	-673.847,04	-41.655,30	268.342,58	-344.610,71
MOVI37	8.677.790,59	128.317,68	120.729,26	2,49%	-918.763,95	-97.165,42	342.246,98	-439.995,63
MTRJ19	8.504.895,75	110.697,34	105.279,24	2,17%	-773.059,85	-137.482,02	243.835,81	-316.127,38
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PASN12	3.564.041,04	39.974,91	35.452,89	0,73%	-251.469,44	-56.649,20	69.136,17	-89.324,32
PEJAI11	5.022.746,94	67.023,97	64.695,07	1,33%	-528.286,11	-91.587,68	174.807,94	-225.370,63
QUAT12	3.420.837,07	75.915,48	45.485,04	0,94%	-150.215,18	-32.576,58	29.670,51	-39.849,70
RAHD11	8.563.950,65	158.705,57	156.324,43	3,20%	-1.049.348,87	-24.228,92	471.956,44	-581.241,10
RDVE11	8.718.243,93	136.179,53	135.259,04	2,79%	-892.435,85	-63.040,06	368.053,87	-460.814,19
RMSA12	11.328.656,40	269.636,87	256.332,67	5,28%	-1.745.878,31	50.879,19	870.734,14	-1.053.017,33
RSAN44	7.496.392,64	81.764,28	75.961,61	1,56%	-597.823,49	-116.599,21	176.288,65	-229.789,83
TCII11	10.235.352,19	184.929,20	180.897,26	3,73%	-1.234.543,63	-19.959,93	566.043,47	-629.146,41
UNEG11	4.995.816,04	113.103,60	107.466,51	2,21%	-671.675,85	21.966,50	330.540,17	-404.992,82
UTPS21	5.963.673,28	117.427,82	114.242,33	2,35%	-735.144,22	-16.111,98	326.899,61	-468.738,52
VAMO33	1.259.918,67	19.145,81	17.608,09	0,36%	-136.004,32	-16.081,43	49.482,63	-63.729,25
VAMO34	7.156.450,42	107.460,82	101.894,69	2,10%	-767.895,15	-81.350,43	286.761,21	-368.457,84
VERO12	8.269.771,40	95.949,22	81.719,20	1,68%	-748.265,93	-171.476,16	209.508,33	-274.171,65
VIMT13	8.568.616,85	159.604,50	157.494,49	3,24%	-1.000.419,17	-42.991,36	427.174,99	-535.576,38
VRDN12	9.531.767,50	155.022,37	154.120,02	3,17%	-1.056.970,45	-114.356,50	400.876,12	-509.079,79
<b>Total Var:</b>	<b>337.347.787,35</b>	<b>5.235.378,44</b>	<b>4.856.086,75</b>	<b>99,98%</b>	<b>-33.224.701,91</b>	<b>-3.043.744,45</b>	<b>12.913.924,57</b>	<b>-16.271.574,80</b>

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JUNHO 2024



Data: 28/06/2024

## Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIRF EMB II A CRED PRIV  
 CNPJ: 20725957000102

Dados Gerais		Limite Fundo:		ENQUADRADO		0,00% Dutation DC:		688,80	
PL:	222.398.490,50	VAR / PL:	0,1484%	Status:		Dutation DC:			
VAR:	329.960,79	ETL / PL:	0,1861%	Benchmark:		Dutation DU:			475,94
ETL:	413.784,14	VAR / CDI:	0,0016%						

Cenários de STRESS										
Cenário Alta - 09999 (+):	1.066.763,41	Cenário Baixa - 10000 (+):	2.425.800,34	CENARIO BRADESCO 1 (+):	2.730.835,62	CENARIO BRADESCO 2 (+):	34.340.626,23			
Cenário Alta - 09999 (-):	-2.406.560,03	Cenário Baixa - 10000 (-):	-877.461,93	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-1.466.668,42	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-36.081.999,28			
Cenário Alta - 09999:	-1.339.796,62	Cenário Baixa - 10000:	1.548.338,41	CENARIO BRADESCO 1:	1.264.167,20	CENARIO BRADESCO 2:	-1.741.373,05			

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
CAXA	8.999,99	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CD3323R5TI	6.683.907,18	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	4.687.383,18	50,67	28,56	0,01%	-133,73	136,39	488,99	-713,69
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-27.075,47	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPGT16	149.444,40	1,41	-0,39	0,00%	4,41	-4,50	-14,88	22,65
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DHF25	-4.646,52	10.347,30	6.032,46	1,83%	-83.019,42	64.265,44	124.648,80	-186.559,10
DHF26	823,05	1.407,52	-917,18	-0,28%	8.490,53	-6.348,38	-11.005,36	15.882,63
DHF27	52.504,70	90.725,74	-58.179,17	-17,63%	615.390,14	-476.966,11	-807.494,14	1.122.536,27
DHF29	18.968,17	31.752,62	-17.919,97	-5,43%	253.080,76	-209.397,16	-355.510,58	457.953,50
DHF33	10.466,85	20.814,20	-8.602,82	-2,61%	178.943,23	-160.333,47	-278.555,71	309.014,46
DHN26	1.002,89	1.712,76	-1.119,93	-0,34%	10.854,32	-8.308,80	-14.078,81	19.949,02
DHV24	-9.485,67	51.575,92	17.992,15	5,45%	-262.876,79	265.018,98	593.115,97	-895.189,77
DHV25	-233,47	386,81	248,09	0,08%	-2.356,53	1.795,50	3.094,64	-4.508,60
IDIN24P400700	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	-19.447.185,45
IDIN24P400800	0,05	0,03	0,02	0,00%	-0,04	0,17	-0,05	19.480.167,40
IDIV24P410200	-0,03	0,11	-0,04	0,00%	0,03	-16.103,50	0,03	-12.911.955,91
IDIV24P410300	0,14	0,54	0,18	0,00%	-0,14	25.769,58	-0,14	12.935.086,98
LF002200U5M	10.677.573,62	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002200U5N	11.194.789,32	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306J15	11.191.277,41	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306J55	6.670.601,86	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002400X0E	10.677.333,95	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002400X0G	10.658.170,06	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002400X0N	10.634.771,04	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002400X2C	6.513.923,37	55.020,12	35.276,52	10,69%	-363.482,38	297.247,36	490.175,07	-681.122,33
LF002400X2S	4.573.281,86	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002400X2Z	10.621.450,74	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002400X3U	6.802.651,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002400X3Q	11.191.602,08	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002400G12	11.235.870,80	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002400F1	6.853.702,14	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024009LF	6.744.716,28	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002400D4A	3.392.845,65	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20250301 - 210100	630.328,34	112,84	-58,40	-0,02%	-1.073,08	1.313,23	-8,75	13,32
LFT20260301 - 210100	270.030,87	58,10	-19,78	-0,01%	-1.214,65	1.950,93	24,36	-37,08
LFT20260901 - 210100	929.780,67	174,94	-39,16	-0,01%	-5.208,44	9.034,10	167,20	-254,80
LFT20270301 - 210100	404.336,73	70,28	7,75	0,00%	-2.264,51	5.315,94	217,95	-331,60
LFT20270901 - 210100	134.564,96	30,56	8,52	0,00%	-739,41	2.273,42	127,28	-193,65
LFT20300301 - 210100	960.705,26	1.050,39	-355,75	-0,11%	-12.832,01	33.053,48	2.487,61	-3.775,23
LFTN20260701 - 100000	239.951,06	1.647,61	1.061,98	0,32%	-10.700,59	8.462,53	14.111,42	-19.891,11
NTNB20240815 - 760199_NEGOCIACAO	14.291.063,25	27.567,06	-6.833,31	-2,07%	-23.394,21	32.635,74	22.289,81	-30.192,26
NTNB20250515 - 760199_NEGOCIACAO	9.209.366,72	17.836,62	14.672,34	4,45%	-118.750,06	114.864,43	73.320,02	-98.565,49
NTNB20260815 - 760199_NEGOCIACAO	13.920.753,99	78.666,25	77.721,38	23,55%	-313.025,86	314.203,85	266.159,45	-352.845,96
NTNB20270515 - 760199_NEGOCIACAO	11.042.805,04	86.658,50	84.801,97	25,70%	-323.884,91	323.600,73	283.144,23	-372.422,11
NTNB20280815 - 760199_NEGOCIACAO	18.429.801,06	169.684,49	161.816,42	49,04%	-698.028,34	713.709,37	649.311,94	-842.966,22
NTNB20290515 - 760199_NEGOCIACAO	679.271,05	6.427,80	5.913,93	1,79%	-30.297,85	29.023,02	27.909,67	-35.976,86
NTNB20500815 - 760199_NEGOCIACAO	1.346.323,97	22.419,61	18.424,41	5,58%	-153.277,08	182.126,16	180.061,30	-197.212,48
OUTRAS DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
Total Var:	223.605.702,60	676.200,81	329.960,79	99,98%	-1.339.796,62	1.548.338,41	1.264.167,21	-1.741.373,05



# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JUNHO 2024

## Relatório de Risco de Mercado



Data: 28/06/2024

FUNDO: FIM EMB III A IMOBILIARIO  
CNPJ: 32711990000162

Dados Gerais			
PL: 70.355.994,49	VAR / PL: 3,1352%	Limite Fundo: 0,00%	Dutacion DC: 3,00
VAR: 2.205.827,60	ETL / PL: 3,9317%	Status: ENQUADRADO	Dutacion DU: 1,00
ETL: 2.766.196,80	VAR / CDI: 0,0343%	Benchmark:	

Cenários de STRESS			
Cenário Alta - 09999 (+): 31.876.582,14	Cenário Baixa - 10000 (+): 11,12	CENARIO BRADESCO 1 (+): 9.430.472,29	CENARIO BRADESCO 2 (+): 0,00
Cenário Alta - 09999 (-): -10,90	Cenário Baixa - 10000 (-): -31.876.582,14	CENARIO BRADESCO 1 (-): 0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-): -9.507.685,43
Cenário Alta - 09999: 31.876.571,24	Cenário Baixa - 10000: -31.876.571,03	CENARIO BRADESCO 1: 9.430.472,29	CENARIO BRADESCO 2: -9.507.685,43

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
AJEC11	1.958.697,60	59.915,72	35.822,96	1,61%	979.348,80	-979.348,80	287.145,07	-289.495,51
BMLC11	3.603.139,65	196.720,48	-71.838,99	-3,26%	3.603.139,65	-3.603.139,65	528.220,27	-532.544,04
BPML11	4.528.608,00	410.930,14	275.439,41	12,49%	4.528.608,00	-4.528.608,00	663.893,93	-669.328,26
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CEOC11	622.172,00	10.405,57	3.959,38	0,18%	311.086,00	-311.086,00	91.210,42	-91.957,02
CNES11	275.878,30	221.155,49	-144.851,05	-6,57%	137.939,15	-137.939,15	40.443,76	-40.774,81
COMPROMISSADA_PRE	380.380,09	4,13	3,53	0,00%	-10,90	11,12	38,21	-58,16
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-314.340,93	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
EVBI11	307.282,30	697.326,29	606.335,10	27,49%	307.282,30	-307.282,30	45.047,59	-45.416,32
FIGS11	172.212,04	2.931,39	-235,25	-0,01%	86.106,02	-86.106,02	25.246,29	-25.452,94
FVPQ11	785.911,00	55.184,34	51.076,14	2,32%	392.955,50	-392.955,50	115.214,55	-116.157,65
GZIT11	771.342,00	25.533,24	11.464,84	0,52%	385.671,00	-385.671,00	113.078,74	-114.004,35
HOFCC11	337.343,67	93.213,13	70.821,40	3,21%	0,00	0,00	49.454,58	-49.859,39
MALL11	4.647.937,60	97.074,60	34.385,27	1,56%	1.208.463,78	-1.208.463,78	681.387,65	-686.965,18
MAXR11	1.997.356,00	60.781,14	49.178,28	2,23%	998.678,00	-998.678,00	292.812,39	-295.209,22
NEWL11	7.003.603,68	197.320,38	77.297,01	3,50%	3.501.801,84	-3.501.801,84	1.026.728,30	-1.035.132,62
NEWU11	1.729.974,40	175.669,28	-3.479,07	-0,16%	1.729.974,40	-1.729.974,40	253.614,25	-255.690,22
OULG11	323.815,50	8.305,80	-116,73	-0,01%	161.907,75	-161.907,75	47.471,35	-47.859,93
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PATCC11	4.139.136,00	172.325,08	140.669,24	6,38%	2.069.568,00	-2.069.568,00	606.797,34	-611.764,30
QAGR11	5.305.499,80	112.521,19	-28.688,13	-1,30%	2.652.749,90	-2.652.749,90	777.786,27	-784.152,87
RBRL11	378.940,20	16.651,40	5.310,26	0,24%	378.940,20	-378.940,20	55.552,63	-56.007,36
RBRP11	2.076.917,20	145.742,26	84.485,06	3,83%	1.038.458,60	-1.038.458,60	304.476,06	-306.968,36
RCRB11	5.961.301,08	402.906,66	383.362,09	17,38%	0,00	0,00	0,00	0,00
SARE11	442.182,50	49.056,22	40.204,05	1,82%	221.091,25	-221.091,25	64.823,95	-65.354,57
TEPP11	4.722.268,00	259.118,48	241.504,46	10,95%	2.361.134,00	-2.361.134,00	692.284,49	-697.951,21
TRXF11	9.506.187,60	252.887,57	240.010,00	10,88%	2.471.608,78	-2.471.608,78	1.393.607,10	-1.405.014,53
VVMR11	3.991.110,50	47.320,34	25.016,73	1,13%	0,00	0,00	585.096,80	-589.886,13
XPIN11	2.733.252,90	99.369,84	77.442,77	3,51%	1.366.626,45	-1.366.626,45	400.694,88	-403.974,78
XPPR11	1.966.885,56	70.904,04	1.450,84	0,07%	983.442,78	-983.442,78	288.345,42	-290.705,69
<b>Total Var:</b>	<b>70.355.994,24</b>	<b>3.941.274,23</b>	<b>2.205.827,60</b>	<b>99,99%</b>	<b>31.876.571,24</b>	<b>-31.876.571,03</b>	<b>9.430.472,29</b>	<b>-9.507.685,43</b>





# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JUNHO 2024



Data: 28/06/2024

## Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIA RVA EMB III  
CNPJ: 38452593000108

		Dados Gerais		Limite Fundo:		0,00% Dutation DC:		3,00	
PL:	105.760.851,85	VAR / PL:	5,2643%	Status:	ENQUADRADO	Dutation DU:			1,00
VAR:	5.567.527,86	ETL / PL:	6,6016%	Benchmark:					
ETL:	6.961.904,55	VAR / CDI:	0,0576%						

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	29.535.586,05	Cenário Baixa - 10000 (+):	978.680,49	CENARIO BRADESCO 1 (+):	14.925.746,14	CENARIO BRADESCO 2 (+):	1.252.401,42
Cenário Alta - 09999 (-):	-961.994,21	Cenário Baixa - 10000 (-):	-27.913.188,49	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-1.244.873,85	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-15.048.112,77
Cenário Alta - 09999:	28.573.591,85	Cenário Baixa - 10000:	-26.934.508,00	CENARIO BRADESCO 1:	13.680.872,29	CENARIO BRADESCO 2:	-13.795.711,35

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	4.246.260,48	316.823,50	96.908,96	1,74%	0,00	0,00	622.501,79	-627.597,30
B3SA3	689.152,00	41.246,71	19.868,62	0,36%	172.288,00	-172.288,00	101.029,68	-101.856,67
BBAS3	2.231.919,66	72.803,44	40.558,04	0,73%	557.878,42	-557.878,42	327.139,90	-329.617,72
BBOC4	1.606.156,00	94.724,46	46.229,52	0,83%	421.539,00	-421.539,00	247.190,47	-249.213,96
BBS3	2.344.616,00	101.141,87	73.540,48	1,32%	468.923,20	-468.923,20	343.720,71	-346.534,25
BPAC11	3.810.306,61	284.100,04	226.359,79	4,07%	1.143.091,98	-1.333.607,31	568.590,95	-563.163,32
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	3.706.505,57	40,24	5,75	0,00%	-106,20	108,31	372,36	-566,77
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	362.341,40	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPLE3	2.029.168,17	106.928,59	60.033,63	1,08%	446.417,00	-446.417,00	297.476,05	-299.911,06
CPLE6	2.253.464,40	115.885,01	53.559,90	0,96%	495.762,17	-495.762,17	330.357,88	-333.062,04
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DOLQ24	-120.557,12	465.559,19	95.713,05	1,72%	-961.888,01	978.572,18	-1.244.873,85	1.252.401,42
ELET3	7.614.109,80	426.671,20	333.318,56	5,99%	2.284.232,94	-2.284.232,94	1.116.228,50	-1.125.365,43
ENEV3	3.821.620,50	144.350,07	109.393,16	1,96%	1.413.999,59	-1.949.026,46	560.249,57	-564.835,51
EQTL3	9.451.077,57	505.220,72	396.233,93	7,12%	1.890.215,51	-1.890.215,51	1.385.527,97	-1.396.869,27
EQTL9	159.802,83	8.542,49	6.699,69	0,12%	0,00	0,00	23.427,10	-23.618,86
FLRY3	3.625.236,00	219.186,40	130.951,47	2,35%	725.047,20	-725.047,20	531.459,60	-535.809,88
HAPV3	3.596.871,73	817.872,57	346.984,34	6,23%	1.222.936,39	-1.223.030,30	527.301,40	-531.617,64
IGTI11	7.736.166,06	476.207,77	376.345,62	6,78%	1.547.233,21	-1.547.233,21	1.134.121,94	-1.143.405,34
ITSA4	3.906.396,00	245.427,08	129.111,14	2,32%	742.215,24	-742.215,24	572.677,65	-577.365,33
ITUB4	1.098.699,00	64.245,03	46.677,96	0,84%	219.739,80	-208.752,81	161.069,27	-162.367,71
IREN3	265.824,00	39.078,56	25.185,04	0,45%	53.164,80	-53.164,80	38.969,80	-39.288,79
MGLU3	1.219.146,70	280.161,42	243.068,06	4,37%	633.956,28	-548.616,02	178.726,91	-180.189,88
NTCO3	1.505.344,26	182.395,54	156.042,06	2,80%	376.336,07	-376.336,07	220.683,47	-222.489,88
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PRI03	2.770.008,00	372.433,65	255.105,09	4,58%	1.662.004,80	-1.662.004,80	406.083,17	-409.407,18
RAIL3	7.699.427,68	501.728,66	359.460,00	6,46%	3.464.705,30	-2.540.848,29	1.128.736,10	-1.137.975,41
RECV3	2.437.249,86	249.110,73	141.780,91	2,55%	1.462.349,92	-1.462.349,92	357.300,83	-360.225,53
RENT1	14.688,00	1.429,54	764,34	0,01%	0,00	0,00	2.153,26	-2.170,89
RENT3	6.694.842,00	754.947,13	628.449,64	11,29%	2.298.339,26	-1.691.117,09	981.463,84	-989.497,65
SCAR3	145.800,00	10.478,33	3.335,49	0,06%	87.480,00	-87.480,00	21.374,28	-21.549,24
SMFT3	4.205.520,00	317.019,31	227.988,95	4,09%	1.682.208,00	-1.682.208,00	616.529,23	-621.575,86
SOMA3	2.459.684,00	254.160,26	20.262,59	0,36%	737.905,20	-737.905,20	360.589,67	-363.541,30
SRNA3	171.795,00	20.968,99	11.425,78	0,21%	0,00	0,00	25.185,15	-25.391,30
SUZB3	8.688.723,07	1.586.216,66	763.379,71	13,71%	2.172.180,77	-1.737.744,61	1.273.766,80	-1.284.193,27
VIVA3	1.187.298,00	148.771,73	34.405,13	0,62%	356.189,40	-356.189,40	174.057,89	-175.482,64
WDOQ24	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
YDUQ3	2.044.222,11	303.133,08	108.295,45	1,95%	797.246,62	-511.055,53	299.682,96	-302.136,03
<b>Total Var:</b>	<b>105.769.479,33</b>	<b>9.529.009,98</b>	<b>5.567.527,86</b>	<b>100,01%</b>	<b>28.573.591,85</b>	<b>-26.934.508,00</b>	<b>13.680.872,29</b>	<b>-13.795.711,35</b>

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JUNHO 2024



Data: 28/06/2024

## Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIA RVA EMB IV  
CNPJ: 38452613000132

Dados Gerais			
PL: 100.605.162,53	VAR / PL: 5,1741%	Limite Fundo: 0,00%	Dutacion DC: 3,00
VAR: 5.205.419,97	ETL / PL: 6,4885%	Status: ENQUADRADO	Dutacion DU: 1,00
ETL: 6.527.806,65	VAR / CDI: 0,0567%	Benchmark:	

Cenários de STRESS			
Cenário Alta - 09999 (+): 29.550.475,01	Cenário Baixa - 10000 (+): 173,61	CENARIO BRADESCO 1 (+): 13.841.516,35	CENARIO BRADESCO 2 (+): 0,00
Cenário Alta - 09999 (-): -170,22	Cenário Baixa - 10000 (-): -28.015.263,35	CENARIO BRADESCO 1 (-): 0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-): -13.955.123,34
Cenário Alta - 09999: 29.550.304,80	Cenário Baixa - 10000: -28.015.089,73	CENARIO BRADESCO 1: 13.841.516,35	CENARIO BRADESCO 2: -13.955.123,34

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
AURE3	2.321.413,14	142.427,58	-57.620,82	-1,11%	880.353,29	-719.638,07	340.319,17	-343.104,86
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	5.941.016,18	64,49	33,65	0,00%	-170,22	173,61	596,84	-908,45
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	250.323,55	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPLE3	2.578.538,18	135.878,07	71.156,17	1,37%	567.278,40	-567.278,40	378.013,70	-381.107,94
CPLE6	4.884.090,30	251.165,66	92.180,85	1,77%	1.074.499,87	-1.074.499,87	716.007,64	-721.868,55
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ENG11	10.539.688,60	486.312,52	245.981,12	4,73%	1.791.706,96	-2.318.732,60	1.545.103,69	-1.557.751,20
ENG14	15,64	0,82	0,39	0,00%	12,51	-12,51	2,29	-2,31
EQTL3	12.835.355,94	686.132,10	392.857,10	7,55%	2.567.071,19	-2.567.071,19	1.881.663,18	-1.897.065,61
EQTL9	145.716,12	7.789,46	4.459,99	0,09%	0,00	0,00	21.361,98	-21.536,84
GGPS3	5.309.540,72	598.270,46	472.920,98	9,09%	2.389.293,32	-2.389.293,32	778.378,67	-784.750,12
GMAT3	4.896.100,44	576.014,80	364.334,43	7,00%	881.227,43	-783.446,72	717.768,33	-723.643,65
HAPV3	6.187.142,86	1.406.859,85	1.091.574,41	20,97%	2.103.628,57	-2.103.790,12	907.035,14	-914.459,72
ITUB4	4.113.736,48	240.545,51	131.719,01	2,53%	822.747,30	-781.609,93	603.073,77	-608.010,25
MATD3	689.752,70	94.053,63	67.331,96	1,29%	206.925,51	-206.940,97	101.117,75	-101.945,45
MULT3	5.138.173,32	261.983,25	140.485,49	2,70%	1.600.721,08	-1.250.349,63	753.256,21	-759.422,02
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PRI03	12.367.319,92	1.662.813,30	1.174.219,02	22,56%	7.420.391,95	-7.420.391,95	1.813.049,10	-1.827.889,88
RAIL3	9.715.400,80	633.098,36	279.854,19	5,38%	4.371.883,47	-3.206.129,15	1.424.277,76	-1.435.936,24
UGPA3	10.933.099,20	719.357,25	577.140,69	11,09%	2.733.274,80	-2.186.619,84	1.602.792,34	-1.615.912,06
VBBR3	1.757.836,30	170.991,99	156.791,44	3,01%	439.459,08	-439.459,08	257.698,80	-259.808,21
<b>Total Var:</b>	<b>100.605.160,39</b>	<b>8.073.759,13</b>	<b>5.205.419,97</b>	<b>100,02%</b>	<b>29.550.304,80</b>	<b>-28.015.089,73</b>	<b>13.841.516,35</b>	<b>-13.955.123,34</b>



# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JUNHO 2024



Data: 28/06/2024

## Relatório de Risco de Mercado

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

Dados Gerais							
PL:	113.739.773,30	VAR / PL:	4,8491%	Limite Fundo:	0,00%	Dutation DC:	6,32
VAR:	5.515.374,84	ETL / PL:	6,0810%	Status:	ENQUADRADO	Dutation DU:	3,30
ETL:	6.916.502,96	VAR / CDI:	0,0531%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	29.220.450,80	Cenário Baixa - 10000 (+):	4.053,05	CENARIO BRADESCO 1 (+):	16.538.823,50	CENARIO BRADESCO 2 (+):	14,23
Cenário Alta - 09999 (-):	-3.083,49	Cenário Baixa - 10000 (-):	-29.728.597,68	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-9,35	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-16.673.218,83
Cenário Alta - 09999:	29.217.367,31	Cenário Baixa - 10000:	-29.724.544,63	CENARIO BRADESCO 1:	16.538.814,15	CENARIO BRADESCO 2:	-16.673.204,60

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
TOTS3	850.305,49	76.773,50	-12.353,99	-0,22%	170.061,10	-170.061,10	124.654,79	-125.675,15
TRPL4	564.905,12	39.088,39	23.079,51	0,42%	112.981,02	-141.226,28	82.815,09	-83.492,98
UGPA3	1.276.387,20	83.981,53	67.336,45	1,22%	319.096,80	-255.277,44	187.118,36	-188.650,03
USIM5	221.456,27	26.944,02	262,33	0,00%	86.367,95	-48.720,38	32.465,49	-32.731,24
VALE3	14.971.314,18	1.165.928,78	795.446,91	14,42%	3.742.828,55	-3.742.828,55	2.194.794,66	-2.212.760,24
VAMO3	205.252,98	32.960,53	15.522,17	0,28%	71.838,54	-82.101,19	30.090,09	-30.336,39
VBBR3	1.266.122,00	123.160,91	105.894,03	1,92%	316.530,50	-316.530,50	185.613,49	-187.132,83
VIVA3	143.292,42	17.954,94	4.255,79	0,08%	42.987,73	-42.987,73	21.006,67	-21.178,62
VIVT3	1.006.275,96	65.743,21	2.261,98	0,04%	153.236,25	-149.243,55	147.520,06	-148.727,59
WEGE3	3.398.573,26	271.233,38	184.116,66	3,34%	849.643,32	-849.643,32	498.230,84	-502.309,13
YDUQ3	163.707,66	24.275,84	12.452,87	0,23%	63.845,99	-40.926,92	23.999,54	-24.195,99
<b>Total Var:</b>	<b>113.739.324,88</b>	<b>10.031.488,22</b>	<b>5.515.374,84</b>	<b>99,99%</b>	<b>29.217.367,31</b>	<b>-29.724.544,63</b>	<b>16.538.814,15</b>	<b>-16.673.204,60</b>

## 3. RISCO DE CRÉDITO

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

### 3.1. Relatório de Risco de Crédito

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JUNHO 2024



## RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

28/06/2024

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	679.022,93	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	251.319,44	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	150.791,66	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	20/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	502.502,67	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	25/08/17	25/08/17	15/08/24	PETR	9.766.773,68	AAA	Aaa.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	18/12/17	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	2.875.683,80	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	21/12/17	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	839.412,63	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/01/18	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	2.979.474,80	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB II	19/02/18	19/02/18	15/02/25	SABESP	4.930.061,14	brAAA	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/02/18	19/02/18	15/02/25	SABESP	3.059.641,50	brAAA	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	13/03/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	13.224.776,12	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB II	23/05/18	23/05/18	15/05/28	COMGAS	26.225.428,07	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	651.278,97	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	651.278,97	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	651.278,97	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	650.110,86	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	651.278,97	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	04/07/18	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	6.234.593,18	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/07/18	26/07/18	15/07/25	AEGEA SA	15.399.092,26	brA	Aa1.br	AA(bra)
FI RF EMB II	26/07/18	26/07/18	15/07/25	CSMG	8.336.435,69	-	Aa3.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/02/13	15/02/25	CEMIG	701.568,98	brA+	A1.br	AA(bra)
FIM EMB I A	12/02/19	09/01/19	15/01/25	ITAUBBB	2.628.399,33	-	AAA.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	567.910,44	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	3.595.856,02	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	2.047.754,00	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	6.191.042,93	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	757.128,26	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	6.125.856,00	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	9.085.539,24	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	936.085,86	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	621.152,04	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	30/09/20	28/09/20	22/09/25	HAPVIDA	173.670,94	-	-	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	05/02/21	07/08/19	15/07/24	COPEL GT	149.427,77	-	-	AA+(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	6.411.724,70	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	6.423.469,53	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	4.447.289,59	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/07/19	15/06/29	NEOENERG	633.175,28	brAA+	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/07/19	15/06/29	NEOENERG	6.294.078,31	brAA+	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	1.841.603,36	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	3.529.671,26	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	3.776.395,78	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	31/07/20	15/07/34	IGUA SAN	2.694.525,78	brAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	23/05/18	15/05/28	COMGAS	22.839.522,16	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	252.520,66	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	444.436,36	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	505.041,32	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	252.520,66	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	309.085,29	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	260.724,97	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	756.455,41	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	26/10/16	27/01/25	BRADESCO	15.323.372,48	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	12/12/17	15/11/24	CCR	3.212.418,09	brAAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	14/12/17	15/11/24	ECORODOV	2.202.808,81	brAA	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	19/02/18	15/02/25	SABESP	718.554,91	brAAA	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	23/05/18	15/05/28	COMGAS	10.150.780,03	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	28/06/18	15/06/27	JAGUARA	1.369.647,50	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	28/06/18	15/06/27	ENERGMIR	892.765,49	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	31/07/18	01/08/25	BRADESCO	4.934.488,06	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	183.876,19	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	22/12/20	15/12/26	IRB	2.723.936,65	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	583.821,61	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	1.331.780,18	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	07/04/21	15/03/31	LOCALIZA	5.444.091,61	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	1.662.782,19	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/06/21	06/01/21	15/11/25	QUATA	582.240,32	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	19.576,49	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	212.462,34	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	528.565,33	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	332.092,91	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	332.092,91	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	235.695,00	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	479.054,88	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	471.869,05	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	862.908,50	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	215.475,99	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	132.141,33	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	330.702,91	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	995.595,41	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	14/06/21	19/06/19	16/12/24	BNBBM	602.341,55	brAAA	AAbr	AA(bra)

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JUNHO 2024



## RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

28/06/2024

Fundo	INFORMAÇÕES DOS ATIVOS					INFORMAÇÕES DE RATING		
	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	14/06/21	12/06/19	09/12/24	BNBBM	905.938,82	brAAA	AAbr	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	16/06/21	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	382.610,01	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	17/06/21	18/03/21	15/02/26	CORSAN	525.548,31	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	18/06/21	18/06/21	15/12/30	MG050	498.738,30	brAAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	789.715,52	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	90.221,38	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	25/06/21	25/06/21	20/06/26	OURO VER	1.420.905,69	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	3.341.532,54	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	01/07/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	2.922.727,12	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	02/07/21	01/03/21	18/02/25	RENNER	575.788,35	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	02/07/21	01/03/21	18/02/25	RENNER	121.771,10	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/07/21	07/04/21	15/03/29	CAGECE	1.276.799,80	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	08/07/21	08/07/21	15/06/31	VAMOS	261.300,52	brAAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/07/21	07/04/21	15/03/29	CAGECE	2.909.888,66	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	12/07/21	12/07/21	12/07/26	BRADESCO	4.594.280,45	brAAA	Aa1.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	2.139.537,32	brAAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	228.999,18	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	1.039.203,84	brAAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	540.386,00	brAAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	1.926.751,68	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	301.195,96	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	4.279.074,63	brAAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	379.687,77	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	379.687,77	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	1.353.669,43	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	15/07/21	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	871.852,06	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/07/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	2.057.213,40	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/07/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	753.828,36	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.112.401,92	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	901.675,33	-	-	AA-(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	20/09/19	20/08/26	VAMOS	1.068.992,02	brAAA+	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	23/07/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.496.214,91	brAAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	29/07/21	07/11/19	15/10/24	BKBR	1.038.453,08	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	29/07/21	23/12/20	15/12/26	RD COLIN	2.073.898,89	brAAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	04/08/21	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	373.005,49	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	06/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	624.893,12	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	11/08/21	11/08/21	15/08/31	CSAN	1.078.157,92	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	11/08/21	19/11/19	15/06/27	AUTOPIST	994.360,74	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	17/08/21	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	2.810.473,96	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	18/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	1.159.095,99	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	18/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	899.448,55	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	27/08/21	27/08/21	20/08/31	S LUIZ A	1.062.585,41	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	704.519,54	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	63.091,30	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	315.456,51	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	12/05/21	15/04/26	ELETROB	2.024.881,58	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/09/21	22/10/19	21/10/26	AUTOBAN	457.955,94	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	20/09/21	20/09/21	15/09/29	MOV_PART	1.060.344,06	brAAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	18/06/21	15/12/30	MG050	997.476,61	brAAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	18/06/21	15/12/30	MG050	997.476,61	brAAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	1.125.089,31	brAAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	826.280,68	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	854.850,35	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	284.179,98	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	284.179,98	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	794.316,07	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	794.316,07	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	1.020.702,69	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	396.503,74	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	396.503,74	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	23/09/21	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	4.084.197,14	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	23/09/21	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	4.340.273,27	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	30/09/21	30/09/21	15/09/31	SIMPAR	872.224,52	brAAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	04/10/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	613.712,13	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/10/21	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	2.581.189,90	-	-	AA-(bra)
FIM EMB I A	20/10/21	20/10/21	20/10/25	DAYCOVAL	2.942.459,36	brAAA+	AA.br	AA(bra)
FIM EMB I A	20/10/21	20/10/21	20/10/24	DAYCOVAL	1.624.970,45	brAAA+	AA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/10/21	22/10/21	15/12/35	CART	2.331.905,64	brAAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	22/10/21	22/10/21	15/12/35	CART	875.886,51	brAAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	25/10/21	22/04/21	15/03/26	VIX LOGI	116.841,16	-	-	A+(bra)
FIM EMB I A	27/10/21	27/10/21	15/10/29	CONT GLO	1.927.907,45	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/10/21	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	878.369,70	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	04/11/21	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	3.374.811,54	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/11/21	10/11/21	15/10/28	LIGHT	379.687,50	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	12/11/21	12/11/21	15/10/31	VAMOS	2.119.955,12	brAAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/11/21	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	11.765,05	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/11/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	2.261.249,04	-	-	AA(bra)

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JUNHO 2024



## RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

28/06/2024

Fundo	INFORMAÇÕES DOS ATIVOS					INFORMAÇÕES DE RATING		
	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/11/21	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	2.289.478,39	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	03/12/21	11/06/19	09/12/24	BNBBM	598.435,82	brAAA	AAb	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/12/21	06/12/21	15/12/35	TESC	2.712.071,78	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/12/21	06/01/21	15/11/25	QUATA	2.608.030,71	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	20/12/21	20/12/21	15/11/35	ORIZON	2.176.625,24	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/01/22	22/04/21	15/03/26	VIX LOGI	672.361,43	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/01/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	377.402,71	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/01/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	1.816.675,81	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	364.004,78	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	352.629,63	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	2.816.856,72	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	841.761,06	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	750.759,87	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/03/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	1.050.618,81	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	19/04/22	19/04/22	16/04/29	VERT-10	311.871,59	-	-	AAAs(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	26/04/22	26/04/22	15/04/50	LIGHT	988.333,33	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	683.258,05	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	12/05/22	12/05/22	15/04/27	BRKA	1.931.638,28	-	A+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	12/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.477.622,09	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	26/05/22	26/05/22	10/05/27	GUAR	2.515.225,86	-	-	A
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	2.507.325,31	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	515.907,82	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.136.430,49	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	03/03/22	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	3.402.013,39	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/03/22	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	1.168.160,57	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/03/22	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	521.316,52	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/03/22	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	3.281.563,01	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/03/22	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	2.626.656,65	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/06/22	06/12/21	15/12/35	TESC	844.039,46	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	412.726,26	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	06/12/21	15/12/35	TESC	529.411,27	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	268.243,10	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	13/06/22	30/09/21	15/09/31	SIMPAR	1.877.578,04	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	13/06/22	08/07/21	15/06/31	VAMOS	889.666,06	brAA+	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	13/06/22	08/07/21	15/06/31	VAMOS	72.583,48	brAA+	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	13/06/22	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	750.058,31	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	13/06/22	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	848.163,44	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/06/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	1.377.519,91	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	27/06/22	27/06/22	08/07/24	LAGE	2.591.143,93	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	3.377.754,29	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	12/11/21	15/10/31	VAMOS	2.049.996,60	brAA+	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	12/11/21	15/10/31	VAMOS	1.536.967,46	brAA+	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	28/07/22	28/07/22	18/07/25	IV11	1.728.160,33	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	29/07/22	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	1.876.532,72	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/08/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	1.268,50	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	459.185,08	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	07/04/21	15/03/29	CAGECE	1.578.185,30	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	07/04/21	15/03/29	CAGECE	2.629.530,06	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	02/09/22	02/09/22	02/09/29	AEGEA SA	1.755.243,88	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	27/09/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	54.545,39	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	28/09/22	28/09/22	28/09/27	B.BRASIL	4.781.423,02	-	AAA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/10/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	38.054,92	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	03/11/22	06/04/21	15/03/29	ANET	1.749.264,76	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/11/22	08/11/22	15/06/42	BRK AMBI	5.498.115,62	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/11/22	02/05/22	15/04/38	RDVE	1.847.402,93	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	11/11/22	11/11/22	15/10/40	RAHOLD	2.775.236,90	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	11/11/22	11/11/22	15/10/40	RAHOLD	7.221.025,76	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	3.999.743,77	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	1.800.488,89	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	1.474.225,80	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.423.058,49	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.732.274,47	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.418.625,28	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	01/12/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	1.663.577,82	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	2.180.994,71	brAA+	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	2.313.691,74	brAA+	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	1.687.633,97	brAA+	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/12/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	2.848.843,01	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	15/12/21	15/11/36	ITAPOA T	1.285.918,17	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	02/05/22	15/04/38	RDVE	2.137.906,72	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	3.125.973,32	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	26/01/23	26/01/23	20/01/26	CELG	2.463.006,74	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/03/23	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	310.226,71	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	1.252.298,36	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	15/12/21	15/11/36	ITAPOA T	3.904.263,78	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	27/07/22	15/04/36	BRV_VDR	9.155.480,83	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	17/04/23	17/04/23	17/03/30	VERO	3.003.084,99	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	20/04/23	12/05/22	15/04/27	BRKA	1.147.133,68	-	A+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	20/04/23	12/05/22	15/04/27	BRKA	31.666,20	-	A+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/04/23	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	2.241.396,86	brAAA	-	-







## RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

28/06/2024

Fundo	INFORMAÇÕES DOS ATIVOS					INFORMAÇÕES DE RATING		
	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FIRF EMB II A CRED PRIV	24/01/24	24/01/24	25/01/27	BTG PACT	4.498.332,58	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	25/01/24	25/01/24	26/01/26	BTG PACT	6.745.116,10	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/01/24	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	1.095.209,99	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/01/24	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.286.320,59	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/01/24	22/04/21	15/03/26	VIX LOGI	1.348.920,74	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	30/01/24	28/04/21	15/04/31	MANAUSEN	2.424.129,73	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	30/01/24	01/06/23	25/05/26	LM TRANS	2.552.750,14	-	AA+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	30/01/24	27/10/21	15/10/29	CONT GLO	2.446.087,10	-	-	AA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	31/01/24	31/01/24	02/02/26	B. ALFA	11.116.776,95	-	AAA.br	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/02/24	08/02/24	15/09/31	PLANALTO	3.042.035,27	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CRED PRIV	15/02/24	15/02/24	15/12/43	AGUAS SE	2.145.333,48	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/02/24	12/11/21	30/04/29	HAPVIDA	547.721,67	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/02/24	18/03/21	15/02/26	CORSAN	1.319.126,25	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/02/24	19/05/22	13/05/28	CEA MODA	1.404.474,02	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/02/24	07/11/19	15/10/24	BKBR	1.512.707,24	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/02/24	19/04/22	16/04/29	VERT-10	1.209.570,48	-	-	AAAsf(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/02/24	07/04/21	15/03/26	CAGECE	2.525.443,85	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/02/24	24/03/22	11/03/27	ARTERIS	2.542.092,49	brAAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/02/24	16/02/24	15/02/34	NTRASSUD	2.703.124,73	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	286.414,93	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	18/06/21	15/12/30	MG050	284.280,83	brAAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	02/05/22	15/04/38	RDVE	803.601,41	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	809.615,81	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	286.414,93	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	12/02/21	15/12/35	MS 306	306.307,15	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	974.323,88	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	487.161,94	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	10/02/21	15/12/31	METRORIO	472.086,26	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	15/12/21	15/11/36	ITAPOA T	393.443,20	-	AA.br	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	26/02/24	26/02/24	01/03/27	BTG PACT	11.042.624,84	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	05/03/24	05/03/24	24/08/26	B VOTORA	6.775.724,17	brAAA	AA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	12/03/24	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	2.024.737,48	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/03/24	23/06/23	15/05/43	IGUA RJ	1.191.494,17	brAAA+	-	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	05/04/24	05/04/24	06/04/26	PSA	6.658.037,07	-	Aaa.br	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	16/05/24	16/05/24	18/05/26	BANSICRE	3.343.255,00	brAAA	AAA.br	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/05/24	10/11/21	30/10/31	DASA	1.634.289,66	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/06/24	18/06/24	10/06/29	OURO VER	611.219,47	-	AA.br	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	VERDECARD FIDC SN6	785.341,38	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	FIDC VERDECARD SN8	1.388.446,35	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	RB CAP CREDIT AL SN3	545.684,36	brAA-(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	INSS CONS PDL I FIDC	785.341,38	-	-	AAAsf(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	-	-	-	DRIVER SX FIDC SN	822.207,52	-	AAA.br	-

Observação: Em junho 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** **4.947.082.226,92**

Tópico do Enquadramento	Limite	Aplicação Atual	Valor Limite	% Aplicado	Status
% do Segmento RF/PL PLANO	100,00%	4.358.084.470,56	4.947.082.226,92	88,09%	Enquadrado
% do PL em Títulos de Emissão do Tesouro Nacional e/ou do BACEN	100,00%	3.542.461.938,60	4.947.082.226,92	71,61%	Enquadrado
% do PL em Títulos RF1, exceto títulos do Tesouro Nacional	80,00%	815.622.531,96	3.957.665.840,51	16,49%	Enquadrado
% do PL em FIDC	20,00%	Verificar Rel. de Diversificação de FIDC's	989.416.460,13	0,00%	Enquadrado
% do PL em uma mesma pessoa jurídica não-financeira	10,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Não Financ.	494.708.230,06	0,00%	Enquadrado
% do PL em Instituições Financeiras	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Financ.	1.236.770.556,73	0,00%	Enquadrado
% de uma mesma Série de Debêntures	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Debêntures	1.236.770.556,73	0,00%	Enquadrado
% do PL em RV	70,00%	480.741.533,08	3.462.957.499,87	9,72%	Enquadrado
% do capital votante de uma empresa	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação RV	1.236.770.556,73	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Imobiliários	20,00%	77.848.016,34	989.416.460,13	1,57%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Empréstimos	15,00%	26.475.776,75	742.062.363,52	0,54%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Estruturados	20,00%	0,00	989.416.460,13	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos no Exterior	10,00%	0,00	494.708.230,06	0,00%	Enquadrado

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



# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JUNHO 2024

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO  
 Cliente: EMBRAER PREV  
 Período: 01 DE JUNHO DE 2024 À 30 DE JUNHO DE 2024



## FIRF EMB II A CRED PRIV

DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	FONTE ANBIMA					FORA DO TÚNEL
							TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	
07/06/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2025	Compra	6,1546%	6,3121%	5,8124%	6,5872%	-0,1575%	NÃO
07/06/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2025	Compra	6,1546%	6,3121%	5,8124%	6,5872%	-0,1575%	NÃO
10/06/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2024	Compra	9,1079%	8,8791%	8,4812%	10,3654%	0,2288%	NÃO
10/06/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2026	Compra	6,3985%	6,4258%	6,1571%	6,5705%	-0,0273%	NÃO
10/06/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2026	Compra	6,3985%	6,4258%	6,1571%	6,5705%	-0,0273%	NÃO
17/06/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	LIQUIDEZ	LTN	01/01/2026	Venda	11,2506%	11,2840%	10,8702%	11,4122%	-0,0334%	NÃO
18/06/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	XP CCTVM	LFT	01/03/2026	Compra	0,0061%	0,0284%	0,0144%	0,0381%	-0,0223%	SIM
18/06/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	TERRA	LFT	01/03/2027	Compra	0,0872%	0,0856%	0,0628%	0,0929%	0,0016%	NÃO
18/06/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	XP CCTVM	LTN	01/01/2026	Venda	11,2804%	11,2850%	10,9598%	11,4835%	-0,0046%	NÃO
18/06/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	LIQUIDEZ	LTN	01/01/2026	Venda	11,2735%	11,2850%	10,9598%	11,4835%	-0,0115%	NÃO
18/06/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2028	Compra	6,4973%	6,5059%	6,3511%	6,6960%	-0,0086%	NÃO
18/06/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2028	Compra	6,4973%	6,5059%	6,3511%	6,6960%	-0,0086%	NÃO
19/06/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	LIQUIDEZ	LTN	01/01/2026	Venda	11,3302%	11,3490%	10,9608%	11,4839%	-0,0188%	NÃO
20/06/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	TERRA	LFT	01/09/2027	Compra	0,1046%	0,1180%	0,0833%	0,1228%	-0,0134%	NÃO
20/06/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	CAPITAL	LTN	01/01/2028	Venda	11,9143%	11,9547%	11,6478%	12,2712%	-0,0404%	NÃO
26/06/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	TERRA	LFT	01/03/2027	Compra	0,0641%	0,0797%	0,0622%	0,0856%	-0,0156%	NÃO
26/06/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	XP CCTVM	LTN	01/07/2026	Venda	11,4645%	11,5295%	11,0884%	11,7715%	-0,0650%	NÃO
26/06/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	LIQUIDEZ	LTN	01/07/2026	Venda	11,4596%	11,5295%	11,0884%	11,7715%	-0,0699%	NÃO

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO  
 Cliente: EMBRAER PREV  
 Período: 01 DE JUNHO DE 2024 À 30 DE JUNHO DE 2024



## FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI

DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	FONTE ANBIMA					FORA DO TÚNEL
							TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	
19/06/2024	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	BNP	RENASCEN	LFT	01/09/2024	Venda	0,0043%	0,0028%	-0,0247%	0,0360%	0,0015%	NÃO
19/06/2024	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	BNP	RENASCEN	LFT	01/09/2024	Venda	0,0043%	0,0028%	-0,0247%	0,0360%	0,0015%	NÃO
19/06/2024	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	BNP	RENASCEN	LFT	01/09/2025	Venda	-0,0052%	-0,0076%	-0,0140%	0,0160%	0,0024%	NÃO







# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JUNHO 2024

## RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE JUNHO DE 2024 À 28 DE JUNHO DE 2024



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
11-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	20,11	2.400,00	48.272,38	19,86	20,09	20,24	16.015,00
11-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	20,07	3.500,00	70.249,20	19,86	20,09	20,24	16.015,00
11-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	9,78	1.700,00	16.619,08	9,62	9,76	9,82	20.428,00
11-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	31,57	700,00	22.098,66	31,24	31,54	31,69	34.749,00
11-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	12,36	1.600,00	19.772,80	11,44	12,23	12,48	33.007,00
11-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	14,92	1.100,00	16.411,15	14,80	14,89	15,06	10.278,00
11-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	42,45	400,00	16.981,59	40,94	42,22	42,78	41.458,00
11-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	19,92	2.100,00	41.822,79	19,74	19,96	20,14	21.109,00
11-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	18,82	700,00	13.172,94	18,66	18,86	19,05	8.422,00
11-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	41,82	6.400,00	267.628,60	41,51	41,83	42,42	20.248,00
11-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	41,83	1.600,00	66.925,71	41,51	41,83	42,42	20.248,00
11-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	22,39	1.100,00	24.633,57	21,95	22,40	22,56	6.535,00
11-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	5,88	2.700,00	15.866,06	5,75	5,86	5,90	11.240,00
11-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	49,12	900,00	44.208,44	48,87	49,09	49,80	15.280,00
11-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	11,39	1.100,00	12.524,47	11,21	11,37	11,49	11.181,00
11-06-24	FIA RVA EMB IV	Venda	GMAT3	7,72	13.177,00	101.719,62	7,65	7,72	7,84	6.094,00
11-06-24	FIA RVA EMB IV	Venda	GMAT3	7,75	4.189,00	32.463,49	7,65	7,72	7,84	6.094,00
11-06-24	FIA RVA EMB IV	Venda	GMAT3	7,70	491,00	3.780,70	7,65	7,72	7,84	6.094,00
11-06-24	FIA RVA EMB IV	Compra	PRI03	42,29	4.444,00	187.938,76	40,94	42,22	42,78	41.458,00
11-06-24	FIA RVA EMB IV	Compra	PRI03	42,54	2.204,00	93.751,99	40,94	42,22	42,78	41.458,00
11-06-24	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	22,52	2.391,00	53.841,95	22,38	22,65	22,95	14.156,00
11-06-24	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	22,68	1.654,00	37.513,15	22,38	22,65	22,95	14.156,00
11-06-24	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	22,60	410,00	9.265,45	22,38	22,65	22,95	14.156,00
11-06-24	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	21,62	626,00	13.535,42	21,35	21,61	21,83	29.029,00
11-06-24	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	21,68	3.270,00	70.881,44	21,35	21,61	21,83	29.029,00
11-06-24	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	21,61	3.313,00	71.586,64	21,35	21,61	21,83	29.029,00
11-06-24	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	21,59	1.533,00	33.092,73	21,35	21,61	21,83	29.029,00
12-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	CXSE3	14,29	5.800,00	82.882,00	14,16	14,29	14,48	9.685,00
12-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	SBSF3	73,53	2.700,00	198.531,00	73,03	73,93	76,10	19.104,00
12-06-24	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	49,10	1.500,00	73.650,00	48,25	48,92	49,64	29.572,00
12-06-24	FIA RVA EMB II	Compra	TOTS3	29,05	8.200,00	238.210,00	28,34	28,80	29,51	17.995,00
12-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	20,97	1.800,00	37.745,87	20,73	20,98	21,63	16.364,00
12-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	21,00	8.300,00	174.312,57	20,73	20,98	21,63	16.364,00
12-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	20,98	1.400,00	29.366,73	20,73	20,98	21,63	16.364,00
12-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	26,59	500,00	13.294,44	26,46	26,64	27,30	51.422,00
12-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBDC4	12,71	1.800,00	22.885,08	12,65	12,72	13,01	259.196,00
12-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	32,42	600,00	19.449,48	32,28	32,45	32,87	19.007,00
12-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	32,46	2.600,00	84.384,79	32,28	32,45	32,87	19.007,00
12-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	31,82	900,00	28.634,57	31,59	31,89	32,74	29.638,00
12-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPL3	8,24	3.000,00	24.721,77	8,14	8,23	8,37	7.939,00
12-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	9,20	2.200,00	20.246,80	9,09	9,19	9,36	27.381,00
12-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	35,64	500,00	17.818,02	35,36	35,68	36,53	30.664,00
12-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,42	2.500,00	31.050,45	12,33	12,48	12,86	26.570,00
12-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	29,01	2.100,00	60.925,57	28,70	28,99	29,61	25.957,00
12-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	14,31	2.000,00	28.624,48	14,14	14,29	14,62	8.770,00
12-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	3,81	16.200,00	61.727,01	3,76	3,83	4,02	31.748,00
12-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	19,92	8.900,00	177.283,51	19,76	19,91	20,53	25.828,00
12-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	19,89	1.700,00	33.820,34	19,76	19,91	20,53	25.828,00
12-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	9,67	1.100,00	10.637,32	9,58	9,66	9,80	34.647,00
12-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	31,46	800,00	25.164,44	31,15	31,45	31,74	47.060,00
12-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	11,69	1.000,00	11.694,42	11,42	11,98	12,95	37.628,00
12-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	14,93	800,00	11.943,40	14,75	14,90	15,21	25.109,00
12-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	42,91	400,00	17.164,28	42,51	42,95	43,50	41.252,00
12-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	19,68	900,00	17.710,28	19,48	19,67	20,24	27.209,00
12-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	18,73	1.900,00	35.587,00	18,41	18,67	19,41	13.489,00
12-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	18,67	1.900,00	35.471,64	18,41	18,67	19,41	13.489,00
12-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	40,79	1.900,00	77.501,69	40,27	41,01	42,21	41.259,00
12-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	22,08	1.400,00	30.907,77	21,79	22,07	22,82	10.077,00
12-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	5,77	3.700,00	21.346,13	5,67	5,78	6,07	18.642,00
12-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	SRNA3	8,67	1.300,00	11.270,00	8,56	8,71	9,05	11.040,00
12-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	VIVA3	20,40	1.500,00	30.600,00	20,23	20,53	21,58	11.997,00
12-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	VIVA3	20,51	3.200,00	65.625,56	20,23	20,53	21,58	11.997,00
12-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	11,32	1.600,00	18.106,18	11,18	11,39	11,83	19.805,00
12-06-24	FIA RVA EMB IV	Compra	CPL3	8,26	14.193,00	117.252,51	8,14	8,23	8,37	7.939,00
12-06-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	45,19	3.915,00	176.915,34	44,66	45,03	46,47	11.340,00
12-06-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQLT3	29,07	1.214,00	35.290,98	28,70	28,99	29,61	25.957,00
12-06-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQLT3	29,05	1.934,00	56.186,78	28,70	28,99	29,61	25.957,00
12-06-24	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	22,15	402,00	8.904,15	21,83	22,06	22,90	25.011,00
12-06-24	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	22,21	402,00	8.927,57	21,83	22,06	22,90	25.011,00
12-06-24	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	22,16	402,00	8.908,47	21,83	22,06	22,90	25.011,00
12-06-24	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	22,11	402,00	8.888,62	21,83	22,06	22,90	25.011,00
12-06-24	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	22,11	2.311,00	51.102,36	21,83	22,06	22,90	25.011,00
13-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	20,70	3.500,00	72.456,05	20,50	20,70	21,07	12.029,00
13-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,51	3.900,00	48.772,83	12,30	12,47	12,58	6.234,00
13-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,73	27.400,00	102.135,54	3,68	3,75	3,80	19.464,00
13-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	19,60	4.600,00	90.149,30	19,32	19,60	19,89	18.218,00
13-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	40,28	1.300,00	52.360,84	40,10	40,29	41,10	23.970,00
13-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	VIVA3	19,92	2.700,00	53.791,16	19,75	19,95	20,28	15.367,00
13-06-24	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	12,12	3.611,00	43.753,21	12,04	12,12	12,20	4.782,00
13-06-24	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	12,09	492,00	5.949,81	12,04	12,12	12,20	4.782,00
13-06-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQLT3	29,04	300,00	8.710,88	28,82	29,06	29,38	13.991,00
13-06-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQLT3	29,00	2.097,00	60.813,00	28,82	29,06	29,38	13.991,00
13-06-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQLT3	29,03	682,00	19.798,32	28,82	29,06	29,38	13.991,00
13-06-24	FIA RVA EMB IV	Venda	GMAT3	7,41	954,00	7.067,45	7,30	7,40	7,54	7.844,00
13-06-24	FIA RVA EMB IV	Venda	GMAT3	7,44	9.816,00	73.016,85	7,30	7,40	7,54	7.844,00
13-06-24	FIA RVA EMB IV	Venda	GMAT3	7,41	1.907,00	14.132,40	7,30	7,40	7,54	7.844,00
13-06-24	FIA RVA EMB IV	Venda	GMAT3	7,43	2.459,00	18.262,86	7,30	7,40	7,54	7.844,00

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JUNHO 2024

## RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE JUNHO DE 2024 À 28 DE JUNHO DE 2024



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBovespa			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
13-06-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	22,33	1.359,00	30.346,47	22,25	22,46	22,75	15.636,00
13-06-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	22,39	2.371,00	53.090,88	22,25	22,46	22,75	15.636,00
13-06-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	22,35	865,00	19.332,75	22,25	22,46	22,75	15.636,00
14-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	20,79	1.400,00	29.103,92	20,54	20,81	20,99	12.520,00
14-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	20,93	7.600,00	159.068,00	20,54	20,81	20,99	12.520,00
14-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	20,82	9.400,00	195.687,33	20,54	20,81	20,99	12.520,00
14-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	B3SA3	10,34	1.500,00	15.512,00	10,05	10,28	10,42	26.874,00
14-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	26,43	500,00	13.216,68	26,31	26,44	26,66	26.611,00
14-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	BBDC4	12,80	2.000,00	25.604,53	12,63	12,75	12,86	145.515,00
14-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	32,50	500,00	16.250,82	32,21	32,47	32,63	10.016,00
14-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	31,72	600,00	19.031,45	31,48	31,74	31,99	23.313,00
14-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ3	8,31	2.900,00	24.093,43	8,15	8,32	8,37	11.050,00
14-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPLÉ6	9,34	1.800,00	16.819,26	9,13	9,30	9,40	15.358,00
14-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	35,13	100,00	3.512,52	34,78	35,35	35,69	19.080,00
14-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,50	1.800,00	22.498,76	12,27	12,49	12,62	8.764,00
14-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	14,23	2.100,00	29.891,38	14,14	14,22	14,38	3.362,00
14-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,75	11.700,00	43.817,08	3,70	3,74	3,81	22.938,00
14-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	19,65	9.500,00	186.662,80	19,30	19,57	19,72	18.276,00
14-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	19,61	1.900,00	37.259,34	19,30	19,57	19,72	18.276,00
14-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	19,62	4.600,00	90.268,55	19,30	19,57	19,72	18.276,00
14-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	19,63	2.400,00	47.101,49	19,30	19,57	19,72	18.276,00
14-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	31,16	900,00	28.045,56	30,94	31,13	31,37	25.793,00
14-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	42,00	400,00	16.800,29	41,71	42,00	42,33	16.383,00
14-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	19,68	2.700,00	53.129,23	19,24	19,63	19,80	18.513,00
14-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	18,24	200,00	3.647,39	18,00	18,17	18,44	4.852,00
14-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	18,16	800,00	14.528,00	18,00	18,17	18,44	4.852,00
14-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	SCAR3	22,70	100,00	2.270,01	22,54	22,68	23,49	86,00
14-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	21,78	500,00	10.889,98	21,52	21,75	22,00	5.173,00
14-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	5,87	5.100,00	29.920,63	5,79	5,90	5,98	11.664,00
14-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	5,89	2.800,00	16.495,49	5,79	5,90	5,98	11.664,00
14-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	5,93	9.600,00	56.965,92	5,79	5,90	5,98	11.664,00
14-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	VIVA3	20,37	1.600,00	32.588,81	19,81	20,22	20,45	7.560,00
14-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	VIVA3	20,38	900,00	18.343,57	19,81	20,22	20,45	7.560,00
14-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	11,22	1.200,00	13.460,04	11,08	11,23	11,46	6.586,00
14-06-24	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	12,17	11.380,00	138.462,92	12,10	12,17	12,24	7.548,00
14-06-24	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	12,18	2.438,00	29.682,93	12,10	12,17	12,24	7.548,00
14-06-24	FIA RVA EMB IV	Compra	CPLÉ3	8,35	8.785,00	73.354,75	8,15	8,32	8,37	11.050,00
14-06-24	FIA RVA EMB IV	Compra	CPLÉ3	8,32	628,00	5.225,14	8,15	8,32	8,37	11.050,00
14-06-24	FIA RVA EMB IV	Compra	CPLÉ6	9,34	2.079,00	19.416,06	9,13	9,30	9,40	15.358,00
14-06-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQT13	29,72	2.233,00	66.372,90	28,60	29,54	29,95	23.732,00
14-06-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQT13	28,90	470,00	13.583,00	28,60	29,54	29,95	23.732,00
14-06-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQT13	29,57	3.995,00	118.145,09	28,60	29,54	29,95	23.732,00
14-06-24	FIA RVA EMB IV	Venda	GMAT3	7,36	3.319,00	24.423,95	7,24	7,30	7,43	5.290,00
14-06-24	FIA RVA EMB IV	Venda	GMAT3	7,32	1.602,00	11.720,76	7,24	7,30	7,43	5.290,00
14-06-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	BPML11	91,53	1.792,00	164.029,60	91,00	92,37	96,78	591,00
14-06-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	EVBI11	9,73	699,00	6.802,74	9,13	9,73	9,90	23,00
14-06-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	FIGS11	55,10	1.033,00	56.918,30	55,10	55,17	55,43	112,00
14-06-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	GZIT11	60,19	4.154,00	250.015,50	59,77	60,31	60,98	4.066,00
14-06-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	HOFC11	28,58	91,00	2.600,78	28,58	29,22	29,93	1.071,00
14-06-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	MAXR11	81,84	874,00	71.531,56	81,84	81,85	82,00	40,00
14-06-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	PATC11	35,20	790,00	27.808,00	34,90	35,10	35,22	137,00
14-06-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	QAGR11	45,99	170,00	7.818,30	45,99	46,22	46,80	583,00
14-06-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	RBR111	77,30	264,00	20.407,20	77,30	77,68	77,99	2.136,00
14-06-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	TRXF11	105,54	4.738,00	500.047,91	105,37	105,57	105,90	11.914,00
14-06-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	XPIN11	74,71	1.339,00	100.035,09	74,50	74,85	75,56	2.156,00
17-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	20,74	1.000,00	20.735,13	20,46	20,68	20,87	10.283,00
17-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	20,71	3.900,00	80.759,54	20,46	20,68	20,87	10.283,00
17-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	20,74	600,00	12.444,20	20,46	20,68	20,87	10.283,00
17-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	B3SA3	10,47	23.100,00	241.841,86	10,29	10,48	10,57	30.559,00
17-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	31,67	400,00	12.669,62	31,37	31,62	31,89	17.176,00
17-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ3	8,25	2.300,00	18.967,33	8,21	8,24	8,32	4.461,00
17-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ3	8,25	2.900,00	23.911,87	8,21	8,24	8,32	4.461,00
17-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	35,03	400,00	14.013,19	34,79	35,16	35,59	15.440,00
17-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,41	1.100,00	13.649,39	12,29	12,36	12,50	11.675,00
17-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQT13	29,54	2.800,00	82.699,20	29,25	29,48	29,80	14.640,00
17-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	14,03	2.000,00	28.066,24	13,94	14,00	14,25	4.642,00
17-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,69	52.300,00	193.173,85	3,64	3,68	3,74	29.352,00
17-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	19,42	4.700,00	91.289,88	19,29	19,42	19,61	17.592,00
17-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	19,49	1.000,00	19.493,92	19,29	19,42	19,61	17.592,00
17-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	9,67	1.300,00	12.569,34	9,56	9,64	9,71	21.620,00
17-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	31,88	900,00	28.688,22	31,29	31,74	32,00	56.963,00
17-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	11,16	1.200,00	13.392,51	10,99	11,14	11,33	14.982,00
17-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	14,64	900,00	13.172,54	14,48	14,60	14,85	10.023,00
17-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	41,97	1.000,00	41.965,62	41,26	41,75	42,30	23.304,00
17-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	19,41	1.500,00	29.120,10	19,26	19,36	19,60	10.611,00
17-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	18,19	1.600,00	29.098,73	17,75	18,12	18,40	7.662,00
17-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	39,68	600,00	23.805,85	39,25	39,66	40,09	16.003,00
17-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	21,61	1.600,00	34.577,71	21,44	21,60	21,88	7.157,00
17-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	5,91	9.200,00	54.404,78	5,85	5,90	5,96	10.145,00
17-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	5,91	2.400,00	14.184,00	5,85	5,90	5,96	10.145,00
17-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	48,51	1.400,00	67.920,38	48,35	48,55	48,98	15.281,00
17-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	VIVA3	20,05	1.200,00	24.056,08	19,90	20,04	20,37	7.366,00
17-06-24	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	12,18	115,00	1.400,70	12,11	12,15	12,25	5.107,00
17-06-24	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	12,18	82,00	998,76	12,11	12,15	12,25	5.107,00
17-06-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	RBR111	76,96	2.866,00	220.572,00	76,95	77,03	77,80	998,00
17-06-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	TRXF11	105,64	2.083,00	220.044,57	105,45	105,67	106,35	6.900,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ABEV3	11,24	2.803,00	31.505,82	11,19	11,26	11,33	34.269,00

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JUNHO 2024

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL  
 Mês de Referência: 01 DE JUNHO DE 2024 À 28 DE JUNHO 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
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ALOS3	20,65	339,00	6.999,81	20,46	20,68	20,87	10.283,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ALPA4	9,00	106,00	954,18	9,00	9,06	9,21	4.343,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ARZ3	50,36	39,00	1.954,05	49,67	50,31	50,79	8.337,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ASAI3	11,26	860,00	9.683,32	11,23	11,37	11,57	12.208,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	AZUL4	9,00	212,00	1.908,07	8,91	9,02	9,14	7.302,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	B3SA3	10,56	3.574,00	37.741,58	10,29	10,48	10,57	30.559,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBAS3	26,45	1.813,00	47.953,70	26,22	26,38	26,48	30.456,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBDC3	11,42	950,00	10.849,60	11,32	11,42	11,48	11.140,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBDC4	12,97	3.276,00	42.489,72	12,81	12,94	13,01	181.099,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBSE3	32,39	428,00	13.862,96	32,31	32,41	32,53	11.288,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BEEF3	6,10	167,00	1.018,62	6,05	6,09	6,16	4.860,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BPAC11	31,67	734,00	23.244,86	31,37	31,62	31,89	17.176,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRAP4	17,83	160,00	2.852,74	17,50	17,67	17,97	11.248,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRFS3	18,19	533,00	9.695,27	18,13	18,30	18,61	12.903,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRKM5	17,47	170,00	2.969,62	17,43	17,77	18,28	8.030,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CCRO3	11,44	635,00	7.264,82	11,44	11,53	11,64	9.324,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CIEL3	5,65	699,00	3.949,31	5,61	5,62	5,65	6.722,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CMIG4	10,07	1.192,00	12.003,54	10,01	10,06	10,13	17.275,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CMIN3	4,86	708,00	3.441,10	4,80	4,85	4,90	6.428,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	COGN3	1,62	1.158,00	1.875,96	1,61	1,64	1,69	7.455,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CPFE3	32,36	119,00	3.851,09	32,25	32,39	32,70	3.366,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CPLE6	9,22	1.071,00	9.874,51	9,19	9,25	9,35	11.907,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CRFB3	9,15	341,00	3.121,05	9,15	9,33	9,49	8.178,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CSAN3	12,48	746,00	9.310,18	12,46	12,53	12,73	18.771,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CSNA3	11,91	384,00	4.573,11	11,79	11,93	12,07	12.134,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CVCB3	2,02	335,00	676,66	1,97	2,00	2,04	3.546,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CYRE3	18,70	170,00	3.178,82	18,70	18,81	19,04	10.622,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	DXCO3	6,58	193,00	1.269,90	6,53	6,61	6,68	4.169,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	EGIE3	43,84	162,00	7.102,23	43,69	43,90	44,41	4.029,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ELET3	35,24	1.241,00	43.608,84	34,79	35,16	35,59	15.440,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ELET6	39,39	171,00	6.736,49	39,10	39,43	39,71	5.024,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	EMBR3	37,68	469,00	17.671,58	36,74	37,47	37,90	16.580,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ENEV3	12,32	1.008,00	12.418,76	12,29	12,36	12,50	11.675,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ENGI11	44,35	405,00	9.223,92	44,06	44,42	45,09	6.470,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	EQLT3	29,25	737,00	21.558,05	29,25	29,48	29,80	14.640,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	EZTC3	12,99	58,00	753,32	12,98	13,07	13,33	2.754,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	FLRY3	13,98	154,00	2.152,74	13,94	14,00	14,25	4.642,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	GGBR4	16,89	795,00	13.427,19	16,68	16,80	16,95	14.263,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	GOAU4	9,90	421,00	4.167,90	9,84	9,88	9,98	9.041,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	HAPV3	3,66	2.803,00	10.258,98	3,64	3,68	3,74	29.352,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	HYPE3	28,70	261,00	7.490,80	28,50	28,69	28,86	4.431,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	IGTI11	19,31	139,00	2.683,79	19,29	19,42	19,61	17.592,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	IRBR3	31,37	52,00	1.631,24	31,14	31,45	31,95	2.656,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ITSA4	9,64	3.548,00	34.202,78	9,56	9,64	9,71	21.620,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ITUB4	31,90	3.024,00	96.465,72	31,29	31,74	32,00	56.963,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	JBSS3	27,83	724,00	20.148,83	27,77	27,99	28,68	15.771,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	KLBN11	20,34	503,00	10.231,08	20,18	20,33	20,50	11.011,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	LREN3	12,42	673,00	7.539,10	12,42	12,56	12,84	11.532,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	LWSA3	4,02	207,00	1.097,82	4,02	4,07	4,18	7.891,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	MGLU3	10,99	227,00	2.494,73	10,99	11,14	11,33	14.982,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	MRFG3	10,25	212,00	2.172,68	10,16	10,25	10,48	12.538,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	MRV3	6,77	240,00	1.624,87	6,71	6,79	6,88	10.273,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	MULT3	22,15	172,00	3.809,98	22,15	22,23	22,46	8.993,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	NTCO3	14,54	542,00	7.880,36	14,48	14,60	14,85	10.023,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PCAR3	2,93	242,00	709,06	2,93	2,97	3,07	6.167,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PETR3	36,65	1.372,00	50.283,87	36,24	36,48	36,72	33.651,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PETRA	34,81	2.913,00	101.401,51	34,27	34,75	35,13	58.821,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PETZ3	3,41	201,00	685,45	3,39	3,42	3,48	6.161,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PRIQ3	41,72	513,00	21.402,66	41,26	41,75	42,30	23.304,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RADL3	25,07	817,00	20.482,17	24,86	25,17	25,70	12.702,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RAIL3	19,27	777,00	14.972,55	19,26	19,36	19,60	10.611,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RAIZ4	2,78	773,00	2.149,00	2,72	2,76	2,81	13.505,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RDOR3	25,54	730,00	18.644,20	25,42	25,83	26,77	13.344,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RECV3	18,10	176,00	3.185,60	17,75	18,12	18,40	7.662,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RENT3	39,40	545,00	21.473,48	39,25	39,66	40,09	16.003,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RRR3	25,53	153,00	3.906,48	25,38	25,60	25,91	6.890,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SANB11	27,47	219,00	6.015,79	26,96	27,31	27,51	9.785,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SBS3	74,34	216,00	16.058,07	74,23	74,75	75,15	9.998,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SLCE3	17,60	124,00	2.182,24	17,44	17,58	17,71	3.454,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SMTQ3	31,15	91,00	2.834,25	30,51	30,97	31,15	7.134,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SOMA3	5,88	317,00	1.863,81	5,85	5,90	5,96	10.145,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SUZB3	48,51	423,00	20.520,09	48,35	48,55	48,98	15.281,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	TAEE11	33,23	139,00	4.619,37	33,23	33,31	33,47	5.608,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	TIMS3	15,53	515,00	7.997,39	15,44	15,55	15,80	15.115,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	TOTS3	30,42	328,00	9.977,48	30,02	30,46	30,92	14.668,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	TRPL4	25,27	252,00	6.368,04	25,10	25,33	25,50	10.783,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	UGPA3	21,57	694,00	14.970,03	21,40	21,60	21,83	10.956,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	USIM5	7,10	328,00	2.328,79	7,07	7,12	7,18	11.562,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VALE3	60,38	2.824,00	170.512,94	59,84	60,15	60,45	28.584,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VAMO3	7,06	319,00	2.252,78	7,06	7,13	7,29	9.348,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VBBR3	20,19	711,00	14.355,16	20,19	20,33	20,73	12.928,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VIVA3	19,95	80,00	1.595,92	19,90	20,04	20,37	7.366,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VIVT3	44,30	261,00	11.561,40	44,18	44,41	44,81	10.329,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	WEGE3	38,77	945,00	36.637,95	38,40	38,82	39,27	17.452,00
17-06-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	YDUQ3	10,78	184,00	1.983,22	10,74	10,85	11,12	8.083,00
18-06-24	FIA RVA EMB II	Compra	BBDC4	12,72	22.600,00	287.361,48	12,34	12,50	12,75	69.185,00
18-06-24	FIA RVA EMB II	Compra	NTCO3	14,83	11.600,00	172.020,41	14,48	14,78	14,94	17.533,00

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JUNHO 2024

## RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE JUNHO DE 2024 À 28 DE JUNHO 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
18-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	60,80	3.100,00	188.487,00	60,22	60,65	60,88	32.628,00
18-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	20,65	600,00	12.389,94	20,54	20,68	21,01	8.410,00
18-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	B3SA3	10,56	8.100,00	85.562,80	10,46	10,59	10,71	37.419,00
18-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	26,13	400,00	10.453,70	26,06	26,20	26,45	73.984,00
18-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBDC4	12,43	900,00	11.184,00	12,34	12,50	12,75	69.185,00
18-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	32,42	500,00	16.208,98	32,30	32,39	32,49	11.065,00
18-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ3	8,17	4.100,00	33.486,26	8,10	8,16	8,24	3.664,00
18-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ3	8,14	1.200,00	9.768,00	8,10	8,16	8,24	3.664,00
18-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	34,93	900,00	31.439,29	34,57	34,98	35,26	21.121,00
18-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,28	1.000,00	12.278,87	12,18	12,29	12,38	13.136,00
18-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	29,31	900,00	26.381,74	29,02	29,29	29,52	17.440,00
18-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	14,00	1.800,00	25.200,00	13,91	14,00	14,08	5.238,00
18-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	13,99	900,00	12.590,39	13,91	14,00	14,08	5.238,00
18-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,67	20.800,00	76.279,38	3,62	3,68	3,78	53.859,00
18-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	9,72	2.000,00	19.434,92	9,62	9,68	9,75	22.523,00
18-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	9,69	43.800,00	424.422,00	9,62	9,68	9,75	22.523,00
18-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	32,05	13.300,00	426.265,00	31,72	31,98	32,23	35.556,00
18-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	32,06	600,00	19.237,68	31,72	31,98	32,23	35.556,00
18-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	31,96	400,00	12.785,96	31,72	31,98	32,23	35.556,00
18-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	41,41	600,00	24.848,57	41,09	41,43	42,05	35.117,00
18-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	19,40	600,00	11.638,49	19,16	19,41	19,56	26.507,00
18-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	17,78	2.500,00	44.459,93	17,49	17,73	18,25	8.999,00
18-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	39,29	1.600,00	62.857,06	38,99	39,41	39,90	18.390,00
18-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	21,68	1.000,00	21.676,17	21,26	21,63	21,80	6.629,00
18-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	5,89	2.900,00	17.075,06	5,79	5,91	6,05	23.178,00
18-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	5,92	3.700,00	21.915,44	5,79	5,91	6,05	23.178,00
18-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	48,42	600,00	29.052,00	48,16	48,59	49,12	16.823,00
18-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	10,62	1.300,00	13.808,71	10,55	10,67	10,88	8.363,00
18-06-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	RBR11	76,80	1.817,00	139.545,60	76,80	76,94	77,26	797,00
18-06-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	XPIN11	73,88	2.313,00	170.875,94	73,61	73,82	74,40	2.042,00
19-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	ABEV3	11,20	22.100,00	247.520,00	11,04	11,13	11,23	25.754,00
19-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	B3SA3	10,46	48.000,00	502.080,00	10,29	10,41	10,54	29.355,00
19-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	BBAS3	26,27	24.400,00	640.988,00	26,03	26,20	26,34	25.195,00
19-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	BBDC4	12,44	36.100,00	449.084,00	12,18	12,32	12,46	45.979,00
19-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	BBSE3	32,57	5.800,00	188.906,00	32,33	32,58	32,72	11.369,00
19-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	BPAC11	32,25	16.600,00	535.350,00	31,49	31,95	32,25	17.301,00
19-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	CMIG4	10,20	40.000,00	408.000,00	10,08	10,13	10,20	7.451,00
19-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	CPLÉ6	9,15	14.400,00	131.760,00	8,97	9,06	9,15	17.532,00
19-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	CURY3	18,69	4.200,00	78.498,00	18,36	18,63	18,86	3.056,00
19-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	CXSE3	14,27	13.800,00	196.926,00	14,10	14,20	14,33	7.209,00
19-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	DIRR3	25,37	1.300,00	32.981,00	24,62	25,29	25,37	4.061,00
19-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	ELET3	35,05	14.400,00	504.720,00	34,39	34,82	35,22	14.293,00
19-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	ENEV3	12,38	25.900,00	320.642,00	12,22	12,30	12,38	6.416,00
19-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	EQLT3	28,95	12.600,00	364.770,00	28,75	28,89	29,19	11.395,00
19-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	GGBR4	17,23	10.700,00	184.361,00	16,83	17,10	17,34	11.743,00
19-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	GOAU4	10,13	5.700,00	57.741,00	9,89	10,04	10,15	9.953,00
19-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	HAPV3	3,70	37.700,00	139.490,00	3,61	3,74	3,90	39.503,00
19-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	ITSA4	9,81	47.700,00	467.937,00	9,64	9,73	9,83	17.541,00
19-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	ITUB4	32,13	40.600,00	1.304.478,00	31,60	31,99	32,29	24.068,00
19-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	JBSS3	29,41	9.800,00	288.218,00	28,70	29,32	29,60	13.300,00
19-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	KLBN11	20,51	6.700,00	137.417,00	20,25	20,44	20,56	6.492,00
19-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	MRFG3	10,88	26.700,00	290.496,00	10,55	10,90	11,09	18.336,00
19-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	NTCO3	15,12	14.900,00	225.288,00	14,58	14,89	15,13	9.428,00
19-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	PETR3	37,64	10.500,00	395.220,00	37,51	37,69	38,01	10.754,00
19-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	PETR4	35,93	40.000,00	1.437.200,00	35,57	35,84	36,12	38.140,00
19-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	PRI03	41,31	6.800,00	280.908,00	40,67	41,17	41,55	15.920,00
19-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	RADL3	24,77	11.000,00	272.470,00	24,32	24,61	24,89	8.475,00
19-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	RDOR3	26,15	7.000,00	183.050,00	25,57	25,92	26,22	10.688,00
19-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	RENT3	40,01	7.300,00	292.073,00	39,00	39,52	40,08	14.315,00
19-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	RRRP3	25,79	7.300,00	188.267,00	25,00	25,48	25,79	8.106,00
19-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	SBFG3	11,47	9.600,00	110.112,00	11,21	11,40	11,53	2.673,00
19-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	SBSP3	72,12	6.000,00	432.720,00	70,08	71,27	72,12	18.130,00
19-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	SUZB3	48,73	5.600,00	272.888,00	47,85	48,46	48,73	13.743,00
19-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	TIMS3	15,68	6.900,00	108.192,00	15,51	15,67	15,82	7.082,00
19-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	TOTS3	29,43	4.500,00	132.435,00	28,99	29,41	29,86	9.131,00
19-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	60,85	34.100,00	2.074.985,00	60,37	60,71	61,08	33.588,00
19-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	VBBR3	20,48	15.700,00	321.536,00	20,11	20,38	20,53	8.038,00
19-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	VIVT3	44,31	3.400,00	150.654,00	43,89	44,16	44,32	3.575,00
19-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	WEGE3	39,81	12.600,00	501.606,00	39,02	39,59	39,82	17.073,00
19-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	20,56	700,00	14.392,42	20,25	20,48	20,67	8.838,00
19-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	26,28	2.300,00	60.450,50	26,03	26,20	26,34	25.195,00
19-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	32,11	800,00	25.687,08	31,49	31,95	32,25	17.301,00
19-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ3	8,08	2.900,00	23.420,96	8,00	8,08	8,19	5.525,00
19-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ3	8,08	2.200,00	17.774,19	8,00	8,08	8,19	5.525,00
19-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ3	8,11	500,00	4.055,00	8,00	8,08	8,19	5.525,00
19-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPLÉ6	9,09	1.600,00	14.539,30	8,97	9,06	9,15	17.532,00
19-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	34,68	100,00	3.468,02	34,39	34,82	35,22	14.293,00
19-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,29	1.200,00	14.748,09	12,22	12,30	12,38	6.416,00
19-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	28,88	1.200,00	34.657,88	28,75	28,89	29,19	11.395,00
19-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	13,95	100,00	1.395,00	13,90	14,10	14,26	5.835,00
19-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	13,98	1.400,00	19.575,76	13,90	14,10	14,26	5.835,00
19-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,67	9.800,00	35.979,96	3,61	3,67	3,74	39.503,00
19-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	19,31	200,00	3.862,67	19,10	19,34	19,82	12.484,00
19-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	19,30	500,00	9.647,73	19,10	19,34	19,82	12.484,00
19-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	32,10	1.600,00	51.358,57	31,60	31,99	32,29	24.068,00
19-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	32,03	500,00	16.016,25	31,60	31,99	32,29	24.068,00
19-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	11,04	1.000,00	11.038,16	10,74	10,92	11,13	13.654,00

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JUNHO 2024

## RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE JUNHO DE 2024 À 28 DE JUNHO 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
19-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	41,07	700,00	28.748,19	40,67	41,17	41,55	15.920,00
19-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	19,45	1.400,00	27.226,71	19,22	19,39	19,54	21.970,00
19-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	17,65	1.200,00	21.180,82	17,57	17,72	17,93	4.712,00
19-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	39,32	100,00	3.931,53	39,00	39,52	40,08	14.315,00
19-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	21,35	500,00	10.675,00	21,20	21,34	21,80	6.564,00
19-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	21,31	1.300,00	27.696,50	21,20	21,34	21,80	6.564,00
19-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	21,33	600,00	12.799,69	21,20	21,34	21,80	6.564,00
19-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	5,79	1.800,00	10.430,00	5,71	5,80	5,97	15.648,00
19-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	5,79	1.600,00	9.271,76	5,71	5,80	5,97	15.648,00
19-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	5,81	4.100,00	23.803,26	5,71	5,80	5,97	15.648,00
19-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	48,39	200,00	9.677,05	47,85	48,46	48,73	13.743,00
19-06-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	GZIT11	59,87	1.670,00	99.980,33	59,18	59,87	61,32	5.967,00
20-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	EQTL3	29,15	7.900,00	230.306,00	28,70	28,92	29,24	18.338,00
20-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	KIBN11	20,69	6.100,00	126.239,00	20,43	20,54	20,75	9.128,00
20-06-24	FIA RVA EMB II	Compra	MRFG3	11,21	13.400,00	150.256,88	10,95	11,13	11,27	22.685,00
20-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	BBSA3	26,43	13.200,00	348.889,46	26,27	26,42	26,63	33.579,00
20-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	34,44	2.500,00	86.090,92	34,31	34,61	35,40	23.441,00
20-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	28,86	1.700,00	49.055,90	28,70	28,92	29,24	18.338,00
20-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,66	47.500,00	173.891,80	3,61	3,68	3,81	41.439,00
20-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	19,50	400,00	7.800,00	19,40	19,66	20,04	21.799,00
20-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	32,06	11.100,00	355.919,75	31,86	32,03	32,46	37.964,00
20-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	41,13	1.700,00	69.913,94	40,88	41,18	41,90	18.966,00
20-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	18,92	3.900,00	73.770,73	18,07	18,58	19,00	8.378,00
20-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	39,61	2.200,00	87.132,91	39,30	39,91	40,93	29.057,00
20-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	5,88	20.700,00	121.795,37	5,83	5,89	5,98	13.108,00
20-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	48,28	100,00	4.828,18	48,04	48,46	49,24	18.729,00
20-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	48,31	1.000,00	48.310,67	48,04	48,46	49,24	18.729,00
20-06-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	EVBI11	9,79	16.666,00	163.124,51	9,53	9,78	9,83	45,00
20-06-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	HOFCC1	29,10	7,00	203,70	29,10	29,18	29,62	1.505,00
21-06-24	FIA EMB VIII ETF	Compra	BOVA11	118,02	64.000,00	7.553.280,00	116,58	117,75	118,12	202.012,00
21-06-24	FIA EMB VIII ETF	Compra	BOWV11	123,63	60.600,00	7.491.978,00	123,35	123,49	123,87	39.140,00
21-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	B3SA3	10,36	48.200,00	499.566,34	10,28	10,37	10,44	52.574,00
21-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	CPFE3	32,51	7.900,00	256.805,00	32,36	32,56	32,69	7.559,00
21-06-24	FIA RVA EMB II	Compra	ELET3	34,58	9.200,00	318.139,22	34,15	34,60	34,84	22.233,00
21-06-24	FIA RVA EMB II	Compra	EQTL3	29,12	3.500,00	101.906,00	28,76	29,17	29,31	20.714,00
21-06-24	FIA RVA EMB II	Compra	RENT3	41,28	7.700,00	317.883,14	39,25	41,39	41,98	40.262,00
21-06-24	FIA RVA EMB II	Compra	SBSP3	74,43	2.400,00	178.621,39	73,02	74,79	75,55	27.060,00
21-06-24	FIA RVA EMB II	Compra	TOTS3	29,65	4.500,00	133.435,48	29,16	29,71	29,89	12.253,00
21-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	B3SA3	10,38	3.300,00	34.245,57	10,28	10,37	10,44	52.574,00
21-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	3,66	28.700,00	104.987,43	3,56	3,64	3,69	36.044,00
21-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	3,64	19.900,00	72.446,56	3,56	3,64	3,69	36.044,00
21-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	3,63	20.900,00	75.821,96	3,56	3,64	3,69	36.044,00
21-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	41,21	5.000,00	206.036,41	39,25	41,39	41,98	40.262,00
21-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	41,82	3.100,00	129.637,78	39,25	41,39	41,98	40.262,00
21-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	21,73	600,00	13.039,95	21,43	21,73	22,03	6.855,00
21-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	21,75	1.000,00	21.750,00	21,43	21,73	22,03	6.855,00
21-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	5,91	3.500,00	20.685,00	5,79	5,90	6,03	23.038,00
21-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	5,92	2.200,00	13.013,03	5,79	5,90	6,03	23.038,00
24-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	21,19	1.400,00	29.659,38	20,80	21,18	21,34	8.819,00
24-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	33,63	1.000,00	33.630,00	33,06	33,62	33,80	15.883,00
24-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	33,69	2.900,00	97.699,93	33,06	33,62	33,80	15.883,00
24-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	32,96	800,00	26.364,85	32,30	32,94	33,15	22.065,00
24-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLC3	8,23	1.800,00	14.817,15	8,17	8,25	8,35	10.765,00
24-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLC6	9,26	1.800,00	16.673,00	9,18	9,27	9,39	15.267,00
24-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	35,05	1.700,00	59.589,40	34,64	35,09	35,47	19.270,00
24-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,55	2.200,00	27.607,37	12,43	12,52	12,59	7.860,00
24-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	29,80	2.100,00	62.576,94	29,15	29,76	29,94	19.212,00
24-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	29,50	754,00	22.243,00	29,15	29,76	29,94	19.212,00
24-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	14,35	1.700,00	24.393,34	14,20	14,35	14,45	7.835,00
24-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	3,82	46.700,00	178.254,74	3,69	3,83	3,90	34.988,00
24-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	20,29	1.400,00	28.402,25	19,73	20,24	20,36	13.255,00
24-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	9,85	140.300,00	1.382.367,65	9,68	9,86	9,93	20.550,00
24-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	9,91	1.400,00	13.870,38	9,68	9,86	9,93	20.550,00
24-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	9,89	3.400,00	33.614,13	9,68	9,86	9,93	20.550,00
24-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	32,74	500,00	16.372,42	31,98	32,53	32,86	54.316,00
24-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	32,86	43.900,00	1.433.825,87	31,98	32,53	32,86	54.316,00
24-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	12,12	6.500,00	78.770,54	11,54	12,00	12,39	38.774,00
24-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	42,01	400,00	16.802,87	41,25	41,88	42,28	17.045,00
24-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	20,28	2.700,00	54.754,73	20,05	20,30	20,49	22.421,00
24-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	18,72	1.300,00	24.338,63	18,27	18,64	18,81	4.218,00
24-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	42,38	1.500,00	63.573,59	41,62	42,33	42,80	29.052,00
24-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	42,36	1.600,00	67.776,00	41,62	42,33	42,80	29.052,00
24-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	21,87	1.300,00	28.435,39	21,72	21,90	22,15	9.796,00
24-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	5,99	3.000,00	17.959,41	5,83	5,99	6,13	13.068,00
24-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	49,62	1.500,00	74.423,32	48,75	49,51	49,90	21.942,00
24-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	VIVA3	20,59	1.800,00	37.062,00	20,43	20,94	21,28	13.389,00
25-06-24	FIA RVA EMB II	Compra	ABEV3	11,37	30.100,00	342.296,29	11,21	11,35	11,41	39.030,00
25-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	CPFE3	32,57	8.100,00	263.833,93	32,49	32,62	32,92	5.290,00
25-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	21,27	1.100,00	23.400,04	21,06	21,27	21,47	9.411,00
25-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	BBDC4	12,36	1.200,00	14.826,40	12,31	12,37	12,45	22.904,00
25-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	33,47	500,00	16.734,21	33,25	33,44	33,79	12.119,00
25-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	32,84	600,00	19.703,76	32,62	32,83	33,25	15.025,00
25-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLC3	8,18	1.400,00	11.449,00	8,16	8,20	8,26	7.399,00
25-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLC6	9,21	1.400,00	12.889,07	9,17	9,22	9,30	15.579,00
25-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	34,76	1.300,00	45.183,51	34,57	34,76	34,95	15.294,00
25-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,53	1.800,00	22.555,61	12,38	12,51	12,61	12.217,00
25-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	29,41	1.700,00	49.992,93	29,21	29,45	29,88	14.704,00

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – JUNHO 2024

## RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE JUNHO DE 2024 À 28 DE JUNHO 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
25-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	14,44	1.400,00	20.212,39	14,30	14,41	14,50	5.681,00
25-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	3,86	20.900,00	80.597,90	3,81	3,86	3,94	27.654,00
25-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	20,16	2.200,00	44.361,01	20,09	20,20	20,44	10.944,00
25-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	9,84	32.800,00	322.752,00	9,82	9,88	9,96	26.356,00
25-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	32,58	9.400,00	306.252,00	32,24	32,50	32,68	43.474,00
25-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	MGLU3	11,93	900,00	10.735,00	11,61	11,91	12,27	28.345,00
25-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRIO3	41,99	400,00	16.794,11	41,57	41,91	42,25	16.984,00
25-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	20,28	1.200,00	24.339,90	20,10	20,29	20,47	24.275,00
25-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	18,53	800,00	14.821,28	18,41	18,51	18,68	3.596,00
25-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	42,57	4.800,00	204.313,88	41,12	42,46	42,91	32.662,00
25-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	21,85	1.300,00	28.409,91	21,46	21,84	22,01	5.177,00
25-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	21,87	1.200,00	26.249,50	21,46	21,84	22,01	5.177,00
25-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	6,03	2.800,00	16.890,12	5,97	6,03	6,11	10.978,00
25-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	49,81	900,00	44.830,00	49,50	49,83	50,26	16.285,00
25-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	VIVA3	21,26	1.600,00	34.010,02	20,93	21,27	21,51	13.246,00
25-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	10,83	1.800,00	19.494,51	10,76	10,87	11,12	9.991,00
26-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	32,24	2.300,00	74.162,55	31,92	32,27	32,57	23.768,00
26-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL3	8,21	3.200,00	26.265,29	8,02	8,16	8,25	4.081,00
26-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL3	8,23	3.100,00	25.504,97	8,02	8,16	8,25	4.081,00
26-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	34,51	3.600,00	124.231,13	34,02	34,52	34,83	15.816,00
26-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQL3	29,12	2.400,00	69.882,91	28,72	29,03	29,29	25.240,00
26-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	15,15	4.600,00	69.683,34	14,90	15,22	15,42	14.611,00
26-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	20,43	4.400,00	89.894,93	20,04	20,44	20,62	22.283,00
26-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	42,20	1.400,00	59.084,17	41,02	41,97	42,61	37.573,00
26-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	42,40	4.000,00	169.599,80	41,02	41,97	42,61	37.573,00
26-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	21,66	2.600,00	56.328,87	21,28	21,68	21,96	8.003,00
26-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	50,96	3.400,00	173.254,55	49,53	50,81	51,44	35.770,00
26-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	VIVA3	20,51	200,00	4.101,08	20,02	20,39	20,71	9.892,00
26-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	VIVA3	20,45	2.100,00	42.946,56	20,02	20,39	20,71	9.892,00
27-06-24	FIA RVA EMB II	Compra	ABEV3	11,50	14.200,00	163.335,00	11,38	11,43	11,54	24.736,00
27-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	CEAB3	9,71	16.700,00	162.100,00	9,60	9,73	9,84	5.833,00
27-06-24	FIA RVA EMB II	Compra	CPFE3	32,92	13.700,00	450.975,47	32,45	32,92	33,15	6.469,00
27-06-24	FIA RVA EMB II	Compra	NTCO3	15,62	4.500,00	70.297,00	15,30	15,69	15,88	12.459,00
27-06-24	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	57,93	5.800,00	336.007,36	56,51	57,67	59,09	69.469,00
27-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	60,98	6.000,00	365.872,57	60,86	61,26	61,56	27.260,00
27-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	VBBR3	21,03	10.200,00	214.472,36	20,74	20,93	21,39	16.622,00
27-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	21,08	5.000,00	105.416,00	20,93	21,13	21,36	10.552,00
27-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	32,33	4.900,00	158.392,81	32,12	32,29	32,59	16.296,00
27-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	13,04	4.100,00	53.464,00	12,72	12,96	13,16	15.212,00
27-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	13,09	1.300,00	17.016,09	12,72	12,96	13,16	15.212,00
27-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQL3	30,39	5.100,00	154.964,89	30,10	30,61	31,20	47.764,00
27-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQL3	30,43	1.800,00	54.777,02	30,10	30,61	31,20	47.764,00
27-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	14,96	3.300,00	49.357,64	14,48	14,78	15,06	10.518,00
27-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	20,74	5.200,00	107.834,01	20,42	20,79	20,99	15.393,00
27-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	9,83	36.200,00	355.846,00	9,78	9,83	9,92	14.540,00
27-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	32,44	1.700,00	55.152,41	32,28	32,44	32,61	23.440,00
27-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	32,44	11.500,00	373.060,00	32,28	32,44	32,61	23.440,00
27-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	42,19	2.200,00	92.814,96	41,71	42,25	42,88	28.986,00
27-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	58,71	2.300,00	135.024,89	56,51	57,67	59,09	69.469,00
28-06-24	FIA RVA EMB II	Venda	RENT1	8,80	88,00	774,40			9,00	
28-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	31,04	2.000,00	62.084,38	29,99	31,03	32,51	46.000,00
28-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	31,43	5.900,00	185.457,01	29,99	31,03	32,51	46.000,00
28-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	36,28	5.900,00	214.052,96	35,56	36,14	36,72	30.171,00
28-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,87	3.700,00	47.630,89	12,64	12,77	13,15	21.763,00
28-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITUB4	32,21	2.200,00	70.856,31	32,05	32,26	32,54	50.170,00
28-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	LREN3	12,55	21.300,00	267.377,64	12,39	12,53	12,69	23.161,00
28-06-24	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	11,94	22.600,00	269.830,64	11,65	11,92	12,20	24.908,00
28-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	56,67	1.100,00	62.335,88	56,23	57,03	57,56	45.214,00
28-06-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	56,94	1.000,00	56.943,42	56,23	57,03	57,56	45.214,00
28-06-24	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	12,36	2.202,00	27.222,03	12,27	12,38	12,45	9.061,00

## 7. RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS

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

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

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

## 8. GLOSSÁRIO

### **Administrador**

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

### **Carteira**

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

### **Dados Gerais**

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

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

### **Duration**

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

Vide também glossário de Valor Presente.

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

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

### **Fundo de Investimento**

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



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

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

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

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

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

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

## **Patrimônio de Cobertura**

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

## **Patrimônio Líquido (PL)**

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

## **Rating**

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

## **Stress Testing**

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

### ***Tracking Error***

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

### **Túnel de Preços**

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

### **Valor Presente**

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

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

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