



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO

Maio/2024

1. INTRODUÇÃO

Este relatório tem como objetivo apresentar os controles realizados pela EMBRAER PREV, com base nas informações disponibilizadas pelo administrador, referentes aos riscos de mercado, de crédito, operacionais, de liquidez e legal, bem como do desempenho dos investimentos da Entidade em relação aos seus índices de referência.

Os limites e critérios definidos para o controle e monitoramento dos riscos informados seguem as definições estabelecidas na Política de Investimento dos Planos administrados pela EMBRAER PREV, bem como na Resolução CMN Nº 4.994/2022.

2. RISCO DE MERCADO

Para o acompanhamento do risco de mercado da carteira de investimentos da EMBRAER PREV, a Entidade adotará a metodologia de avaliação de risco conhecida como o Valor em Risco (*VaR*), que indica a probabilidade de perda de uma carteira de investimentos para um determinado intervalo de confiança e prazo. O intervalo de confiança e prazos a serem utilizados serão definidos em Política de Investimento. Quando não houver essa definição, a Entidade deverá usar um intervalo de confiança de 95% e prazo de 21 dias úteis (um mês). O *VaR* poderá ser calculado de forma absoluta ou relativa. Para as carteiras de renda variável o *tracking error (TE)* pode ser empregado como uma alternativa ao *VaR*. Os seguintes relatórios elaborados pelo administrador são utilizados pela EMBRAER PREV para o controle de risco de mercado:

2.1 Relatório Detalhado de Risco

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – MAIO 2024



Data: 31/05/2024

Relatório de Risco de Mercado

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

Dados Gerais		Limite Fundo:		ENQUADRADO		0,00%		Dutação DC:	
PL:	4.827.948.089,66	VAR / PL:	1,0276%	Status:	ENQUADRADO	Dutação DC:	1,622,19	Dutação DU:	1,116,76
VAR:	49.611.234,00	ETL / PL:	1,2686%	Benchmark:					
ETL:	62.214.488,94	VAR / CDI:	0,0113%						

Cenários de STRESS										
Cenário Alta - 09999 (+):	148.060.411,42	Cenário Baixa - 10000 (+):	260.878.629,58	CENARIO BRADESCO 1 (+):	280.346.555,12	CENARIO BRADESCO 2 (+):	2.743.787.905,94			
Cenário Alta - 09999 (-):	-248.773.754,34	Cenário Baixa - 10000 (-):	-210.090.423,05	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-21.364.696,10	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-3.030.503.452,06			
Cenário Alta - 09999:	-100.713.342,93	Cenário Baixa - 10000:	50.788.206,53	CENARIO BRADESCO 1:	258.981.859,01	CENARIO BRADESCO 2:	-286.715.546,13			

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

Produto	MIM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
LFT20300301 - 210100	972.932,90	1.200,20	-786,47	0,00%	228.300,56	-228.300,56	111.562,88	-112.476,08
LIGHB4	4.114.345,11	0,00	0,00	0,00%	968.480,16	-968.480,16	283.958,38	-286.282,74
LIGHD3	986.269,51	260,40	212,73	0,00%	912.326,25	-789.513,10	257.205,82	-259.311,19
LIMPT17	2.608.416,91	240,37	146,56	0,00%	-4.073,79	3.375,44	5.263,74	-7.282,99
LORTA7	6.699.968,19	146.584,34	131.748,67	0,27%	-1.208.484,30	-361.769,83	296.144,09	-383.882,12
LRENS3	761.078,08	117.163,44	-47.505,67	-0,10%	637.378,07	-478.058,27	233.604,24	-235.516,42
LRENS1	694.654,74	2,83	-0,47	0,00%	6.273,67	-6.273,97	3.065,73	-3.090,63
LTM20260101 - 100000	594.219,78	3.242,73	2.416,63	0,00%	-1.330.389,34	-467.018,76	270.004,59	-351.652,99
LTM20260701 - 100000	25.220.863,86	189.397,98	151.193,82	0,30%	1.531.684,77	-1.276.403,98	748.483,29	-754.610,03
LTM20280101 - 100000	135.287,73	1.708,38	1.403,77	0,00%	-761.110,83	-207.683,79	180.324,51	-236.981,01
LWSA3	89.159,03	11.736,87	2.165,24	0,00%	3.469.648,88	-3.469.648,88	1.017.301,05	-1.028.628,21
MALL11	4.677.614,18	88.698,79	29.306,81	0,06%	1.896.496,00	-1.896.496,00	278.026,31	-280.302,11
MANT12	2.525.101,24	1.438,58	1.210,45	0,00%	791.876,25	-791.876,25	464.356,23	-468.157,24
MATD3	761.001,88	98.481,32	16.328,56	0,03%	-323.660,11	-127.762,77	54.153,37	-17.077,98
MAXR11	1.936.960,32	54.797,45	21.242,75	0,04%	-77.784,00	78.986,30	69.565,35	-94.097,02
MGLU3	1.754.473,56	287.572,35	206.552,56	0,42%	-390.272,98	396.305,39	349.036,77	-472.121,83
MOVI27	1.167.989,51	653,60	542,91	0,00%	-137.529,18	131.880,71	80.911,98	-108.726,07
MOVI37	9.025.653,56	189.794,24	170.252,01	0,34%	-819.667,03	839.593,24	665.608,78	-882.779,72
MRFG3	1.593.480,48	299.817,98	220.352,35	0,44%	-1.007.333,21	1.031.821,60	818.002,67	-1.084.895,81
MWV3	20.912,24	3.612,87	2.894,38	0,01%	-482.917,45	487.660,09	401.191,12	-528.124,61
MTRJ19	12.304.687,08	204.398,49	177.373,74	0,36%	-1.016.522,77	1.070.234,92	911.342,74	-1.184.891,85
MULT3	5.105.615,90	267.501,06	196.801,63	0,40%	-30.479,82	30.261,38	27.199,84	-35.119,53
NEWL11	6.939.297,76	328.258,84	-89.837,67	-0,18%	-1.397.983,42	1.394.234,49	1.262.913,97	-1.612.691,69
NEWU11	1.896.496,00	130.352,62	53.662,31	0,11%	-18.165.732,20	18.754.056,39	17.916.251,28	-21.934.689,48
NTCO3	3.167.505,00	388.275,42	13.549,04	0,03%	-2.924.294,26	2.990.244,60	2.918.248,66	-3.434.343,07
NTEN11	3.208.964,31	47.223,04	39.380,96	0,08%	-21.969.964,47	31.317.106,57	26.059.585,71	-29.678.751,49
NTNB20240815 - 760199_NEGOCIACAO	25.368.214,06	53.281,43	-23.783,38	-0,05%	-1.223.018,71	1.519.055,62	1.384.286,50	-1.528.570,80
NTNB20250515 - 760199_NEGOCIACAO	9.704.441,08	34.117,16	19.573,62	0,04%	-81.869.039,40	101.685.790,54	92.664.327,62	-102.327.328,31
NTNB20260815 - 760199_NEGOCIACAO	35.277.611,84	268.345,64	239.665,17	0,48%	-26.976.193,98	34.984.507,29	31.374.587,75	-33.852.856,82
NTNB20270515 - 760199_NEGOCIACAO	16.014.045,73	164.785,28	152.230,36	0,31%	-18.664,40	16.282,39	15.255,16	-32.544,97
NTNB20280815 - 760199_NEGOCIACAO	26.630.706,81	331.877,54	313.271,63	0,63%	-7.761,19	6.410,11	10.020,78	-13.956,83
NTNB20290515 - 760199_NEGOCIACAO	682.110,21	9.169,78	8.606,44	0,02%	-1.393.969,78	-913.527,24	5.770,91	-7.710,92
NTNB20300815 - 760199_NEGOCIACAO	10.638.599,31	198.168,02	189.265,11	0,38%	107.827,86	-107.827,86	31.615,13	-31.873,92
NTSD36	2.900.170,64	3.089,30	2.638,78	0,01%	0,00	0,00	0,00	0,00
OMGE13	4.087.544,91	1.236,30	1.016,06	0,00%	-680,28	551,22	912,58	-1.341,18
OULG11	215.655,72	12.793,47	-2.850,63	-0,01%	-337.729,95	-136.237,83	54.900,17	-71.966,93
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	2.105.007,49	-2.105.018,91	617.191,54	-622.243,59
OVSIA10	1.857.521,58	103,03	60,15	0,00%	4.672,97	-4.673,42	1.892,50	-1.907,99
PASN12	3.644.287,09	48.326,42	39.947,93	0,08%	-629.748,81	-179.590,51	156.441,05	-202.786,64
PATC11	4.210.037,82	152.905,67	85.722,79	0,17%	1.044.300,95	-1.253.161,14	1.612.378,08	-617.390,72
PCAR3	12.909,26	4.736,62	1.856,43	0,00%	3.247.062,41	-3.896.474,90	1.904.077,40	-1.919.663,30
PEJA11	5.149.614,33	99.341,83	88.892,38	0,18%	-107.846,13	-48.435,26	14.744,46	-19.973,16
PETR3	4.177.203,80	705.955,60	-434.885,89	-0,88%	21.695,63	-29.117,81	8.369,94	-8.438,46
PETRA	12.988.249,65	1.866.147,04	-1.145.754,37	-2,31%	10.273.084,58	-10.273.084,58	2.510.057,00	-2.530.603,17
PETZ3	57.093,75	21.015,22	-0.012,74	-0,01%	0,00	0,00	0,00	0,00
PRIO3	17.121.807,63	2.691.051,94	-1.148.684,06	-2,32%	2.664.161,28	-2.664.161,28	781.132,09	-787.526,07
PRLG14	1.161.848,00	0,00	0,00	0,00%	-346.591,92	-224.084,15	761,62	-1.030,12
QAGR11	5.328.322,56	177.224,45	120.124,98	0,24%	462.386,07	-462.386,07	336.928,99	-341.703,30
QUAT12	3.801.625,05	76.074,68	32.772,72	0,07%	-2.120.551,87	-645.841,60	576.921,75	-721.560,46
RAU3	2.311.930,33	207.945,24	150.799,75	0,30%	8.383.692,01	-6.146.217,99	2.731.217,29	-2.753.573,78
RAHD11	12.643.349,75	385.107,45	324.471,29	0,65%	-18.892,65	-18.892,65	7.913,32	-7.978,10
RAI3	18.630.404,46	1.016.541,05	509.807,21	1,03%	0,00	0,00	0,00	0,00
RAZ4	53.979,00	3.879,73	2.303,18	0,00%	1.095.282,60	-1.095.282,60	321.136,86	-323.765,54
RBCAPMZ	536.439,57	2.597,28	-43,19	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
RBRP11	2.190.565,20	106.099,00	-112,30	0,00%	-1.808,53	1.456,71	2.353,05	-3.427,85
RCRB11	6.257.944,00	153.994,57	26.445,65	0,05%	787.445,71	-787.455,27	384.798,47	-387.948,25
RDCO10	3.892.972,41	274,65	183,48	0,00%	-4.861,58	4.124,48	6.454,97	-8.579,86
RDR3	2.624.819,02	620.993,40	329.945,53	0,67%	-6.952,06	5.898,00	9.230,61	-12.269,20
RDR09	1.121.735,17	793,60	675,52	0,00%	-1.332.911,07	-462.145,44	315.623,85	-401.605,81
RDR09	1.604.081,29	1.134,85	966,00	0,00%	1.716.488,03	-1.716.488,03	419.395,24	-422.828,22
RDVE11	9.212.901,30	238.894,11	199.579,11	0,40%	3.688.950,55	-2.906.445,89	1.638.788,34	-1.652.202,70
RECV3	2.860.813,38	258.617,52	14.668,26	0,03%	-408.781,88	-113.207,94	109.263,25	-140.229,17
RENT3	11.178.638,03	946.715,52	-148.388,74	-0,30%	-96,64	62,53	149,42	-223,00
RIS412	2.888.853,24	76.982,69	65.700,78	0,13%	-2.492.818,88	-620.337,23	787.307,66	-955.697,23
RLOG11	1.015.307,08	15,59	4,34	0,00%	-18.675,24	15.842,15	24.698,64	-33.410,46
RMSA12	12.263.212,15	464.341,33	393.871,53	0,79%	225.391,32	-225.391,32	55.070,61	-55.521,40
ROB11	2.800.397,79	3.060,11	2.587,41	0,01%	-389,81	321,72	557,06	-824,27
RRRP3	3.765.622,20	97.254,19	-49.887,92	-0,10%	-780.431,46	-283.281,85	147.369,11	-192.954,69
RSAN24	1.865.649,87	59,18	28,21	0,00%	15.345,75	28,21	11.248,44	-11.340,51
RSAN44	7.682.318,76	108.457,78	92.711,86	0,19%	224.342,50	-224.342,50	65.777,22	-66.315,64
SANB11	76.728,75	5.967,24	1.649,09	0,00%	379.184,52	-399.141,60	146.285,40	-147.482,82
SARE11	448.685,00	32.958,76	-13.141,74	-0,03%	494.160,33	-494.160,33	289.775,62	-292.147,59
SBF3	997.854,00	147.838,79	116.877,77	0,24%	-25.297,47	-42.024,83	39.749,73	-53.654,33
SBSF3	1.976.641,32	206.910,88	-95.492,65	-0,19%	3.441,51	2.786,79	4.371,69	-6.237,36
SBSF3	2.460.410,75	540,75	420,76	0,00%	96.348,00	-96.348,00	23.541,03	-23.733,72
SCAR3	160.580,00	9.301,29	3.094,97	0,01%	16.588,64	-16.588,64	8.106,31	-8.172,67
SLE3	55.295,46	3.059,79	2.027,63	0,00%	1.655.981,60	-1.656.000,00	606.924,00	-611.892,00
SMFT3	4.140.000,00	475.693,57	-39.457,60	-0,08%	8.166,43	-8.166,53	3.990,66	-4.023,33
SMT03	27.221,42	2.623,85	-282,37	0,00%	-181,81	151,99	267,36	-397,39
SNGO18	1.262.951,73	28,46	11,03	0,00%	918.920,28	-918.920,28	449.045,71	-452.721,39
SOMA3	3.063.067,60	356.470,71	243.876,40	0,49%	0,00	0,00	127.522,80	-128.566,64
SRNA3	869.869,00	117.218,33	95.271,77	0,19%	2.790.254,33	-2.232.203,46	1.636.205,14	-1.649.598,36
SUZB3	11.161.017,30	2.950.944,66	-1.192.931,70	-2,40%	38.882,09	-38.882,09	22.800,46	-22.987,09
TAEI11	155.628,36	7.584,57	3.880,91	0,01%	-65.343,32	-17.220,89	13.056,86	-17.656,35
TBSP11	2.637.423,88	425,50	330,55	0,00%	-2.734,67	2.230,25	3.525,65	-5.016,45

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – MAIO 2024

Relatório de Risco de Mercado



Data: 31/05/2024

FUNDO: EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS
CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais		Limite Fundo:		ENQUADRADO		0,00%		Dutacion DC:	
PL:	4.827.948.089,66	VAR / PL:	1,0276%	Status:		Dutacion DC:			1.622,19
VAR:	49.611.234,00	ETL / PL:	1,2686%	Benchmark:		Dutacion DU:			1.116,76
ETL:	62.214.488,94	VAR / CDI:	0,0113%						

Cenários de STRESS										
Cenário Alta - 09999 (+):	148.060.411,42	Cenário Baixa - 10000 (+):	260.878.629,58	CENARIO BRADESCO 1 (+):	280.346.555,12	CENARIO BRADESCO 2 (+):	2.743.787.905,94			
Cenário Alta - 09999 (-):	-248.773.754,34	Cenário Baixa - 10000 (-):	-210.090.423,05	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-21.364.696,10	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-3.030.503.452,06			
Cenário Alta - 09999:	-100.713.342,93	Cenário Baixa - 10000:	50.788.206,53	CENARIO BRADESCO 1:	258.981.859,01	CENARIO BRADESCO 2:	-286.715.546,13			

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
TEPP11	4.900.892,92	136.480,56	92.393,98	0,19%	2.450.446,46	-2.450.446,46	718.470,90	-724.351,97
TIMS3	887.684,20	67.628,02	-7.671,23	-0,02%	284.058,94	-204.167,37	130.134,50	-131.199,73
TOTS3	952.872,16	96.281,86	65.745,98	0,13%	190.574,43	-190.574,43	139.691,06	-140.834,51
TRPL4	512.601,74	41.888,69	10.336,87	0,02%	102.520,35	-128.150,44	75.147,42	-75.762,54
TRXF11	10.583.337,60	108.750,13	9.299,17	0,02%	5.291.668,80	-5.291.668,80	1.551.517,29	-1.564.217,30
UGPA3	11.390.232,98	1.004.462,10	-171.033,63	-0,34%	2.847.558,25	-2.278.046,60	1.669.808,16	-1.683.476,43
UNEG11	10.489.524,28	391.633,26	321.285,69	0,65%	-2.061.771,36	-676.284,62	553.329,44	-692.100,51
USM5	171.437,79	37.321,67	-1.120,00	0,00%	66.860,74	-37.716,31	25.132,78	-25.338,51
UTPS21	6.179.877,90	224.392,59	195.906,04	0,37%	-1.187.183,88	-401.289,22	296.876,11	-378.187,34
VALES	22.631.730,40	1.985.937,87	325.684,38	0,66%	6.657.932,60	-6.657.932,60	3.317.811,68	-3.344.969,75
VAMO22	1.078.632,20	42,94	26,02	0,00%	-284,59	232,02	384,52	-563,74
VAMO3	41.839,49	8.200,77	7.027,95	0,01%	14.643,31	-16.735,80	6.133,67	-6.183,88
VAMO33	4.301.979,13	86.555,33	78.505,29	0,16%	-562.261,07	-167.210,84	137.703,64	-178.739,51
VAMO34	7.441.939,90	161.414,26	144.446,35	0,29%	-1.003.357,11	-295.741,68	249.010,79	-322.582,75
VBR3	4.132.168,98	348.924,34	41.448,21	0,08%	1.033.042,25	-1.033.042,25	605.775,97	-610.734,58
VCCS11	2.175.629,53	6.598,40	5.634,90	0,01%	-38.900,31	33.619,94	52.523,71	-67.904,35
VECS11	3.604.473,79	44,42	12,59	0,00%	-275,22	234,43	433,60	-647,80
VERDECS2	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
VERO12	8.413.740,00	122.615,56	104.210,91	0,21%	-881.298,77	-287.866,10	185.307,54	-243.353,70
VIMT13	5.993.244,16	282.087,63	235.076,82	0,47%	-1.523.138,54	-532.152,82	364.035,57	-464.372,15
VIV3	1.030.333,40	206.600,76	116.674,43	0,24%	309.100,02	-309.100,02	151.046,88	-152.283,28
VIVT3	2.476.456,90	158.782,41	-9.305,73	-0,02%	371.468,54	-371.468,54	363.048,58	-366.020,33
VIX14	2.156.522,83	91,22	45,80	0,00%	-594,09	491,08	638,79	-1.239,41
VRDN12	10.412.050,01	262.170,95	221.187,45	0,45%	-1.432.051,74	-458.244,88	348.256,94	-447.364,92
VVMR11	3.995.550,00	111.413,58	-20.534,00	-0,04%	0,00	0,00	585.747,63	-590.542,29
VVRT11	2.580.043,61	240,47	176,48	0,00%	-1.568,15	1.274,72	2.036,77	-2.929,52
WDON24	-38.603,20	177.231,40	116.989,48	0,24%	-561.757,02	570.827,83	-726.164,29	730.734,53
WEGE3	3.197.833,10	251.503,75	-35.851,10	-0,07%	799.458,28	-799.458,28	468.802,33	-472.639,73
XPIN11	2.373.140,00	56.649,83	11.042,26	0,02%	1.186.570,00	-1.186.570,00	347.902,32	-350.750,09
XPPR11	2.025.325,80	287.723,35	15.126,71	0,03%	1.012.662,90	-1.012.662,90	296.912,76	-299.343,15
YDIQ3	2.523.360,70	423.332,07	130.629,88	0,26%	984.110,67	-630.840,18	369.924,68	-372.952,71
Total Var:	4.936.775.125,44	95.075.034,24	49.611.234,00	99,92%	-100.713.342,92	50.788.206,52	258.981.859,02	-286.715.546,12

Relatório de Risco de Mercado



Data: 31/05/2024

FUNDO: EMBRAERPREV RENDA FIXA
CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais		Limite Fundo:		ENQUADRADO		0,00%		Dutacion DC:	
PL:	3.952.077.277,77	VAR / PL:	1,0567%	Status:		Dutacion DC:			1.901,61
VAR:	41.761.871,35	ETL / PL:	1,3252%	Benchmark:		Dutacion DU:			1.309,04
ETL:	52.371.071,50	VAR / CDI:	0,0116%						

Cenários de STRESS										
Cenário Alta - 09999 (+):	0,00	Cenário Baixa - 10000 (+):	198.941.629,36	CENARIO BRADESCO 1 (+):	196.574.571,83	CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00			
Cenário Alta - 09999 (-):	-228.205.183,36	Cenário Baixa - 10000 (-):	-18.134.695,46	CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-222.948.560,02			
Cenário Alta - 09999:	-228.205.183,36	Cenário Baixa - 10000:	180.806.933,90	CENARIO BRADESCO 1:	196.574.571,83	CENARIO BRADESCO 2:	-222.948.560,02			

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
CAIXA	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
FI RF EMB II	3.127.568.079,27	30.891.478,52	30.644.673,34	73,38%	-160.792.144,92	192.510.104,11	175.528.656,92	-197.266.570,79
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	136.360.155,77	1.546.799,22	1.260.159,37	3,02%	-8.670.031,49	-3.493.017,13	1.228.813,88	-1.618.354,47
FIM EMB II A	231.658.883,60	449.311,24	394.654,49	0,95%	-1.622.721,85	1.876.331,69	1.542.351,08	-2.136.393,73
FIM EMB VI A CRED PRIV	243.806.495,40	2.655.677,74	2.554.599,39	6,12%	-12.924.414,48	4.555.193,56	7.758.411,13	-8.528.863,27
FIM EMB VII A CRED PRIV	332.054.780,19	7.606.422,13	6.907.784,76	16,54%	-44.195.870,62	-14.641.678,33	10.516.338,83	-13.398.377,75
Total Var:	4.071.448.394,23	43.149.688,85	41.761.871,35	100,01%	-228.205.183,36	180.806.933,90	196.574.571,84	-222.948.560,02

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – MAIO 2024

Relatório de Risco de Mercado



Data: 31/05/2024

EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL									
CNPJ: 10679245000140									
Dados Gerais									
PL:	488.853.796,00	VAR / PL:	3,3522%	Limite Fundo:	0,00%	Duration DC:	4,08		
VAR:	16.387.365,82	ETL / PL:	4,2038%	Status:	ENQUADRADO	Duration DU:	1,75		
ETL:	20.550.417,86	VAR / CDI:	0,0367%	Benchmark:					
Cenários de STRESS									
Cenário Alta - 09999 (+):	118.334.557,04	Cenário Baixa - 10000 (+):	0,00	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	63.726.510,64	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	0,00		
Cenário Alta - 09999 (-):	0,00	Cenário Baixa - 10000 (-):	-116.453.673,38	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	-64.250.471,69		
Cenário Alta - 09999:	118.334.557,04	Cenário Baixa - 10000:	-116.453.673,38	CENÁRIO BRADESCO 1:	63.726.510,64	CENÁRIO BRADESCO 2:	-64.250.471,69		
Parâmetros do Cálculo									
Modelo:	VaR paramétrico	Modelo Volatilidade:	EWMA						
Int. Confiança:	95	Lambda:	0,94						
Horizonte:	21								
Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2	
CAIXA	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
FIA RVA EMB II	103.920.509,13	3.482.679,53	3.084.148,60	18,82%	26.321.688,23	-26.879.073,92	14.910.730,76	-15.032.831,48	
FIA RVA EMB III	103.696.815,22	5.116.001,35	4.445.125,50	27,13%	27.995.620,31	-26.456.461,55	13.558.496,97	-13.671.679,66	
FIA RVA EMB IV	100.672.614,59	4.240.363,61	3.669.125,60	22,39%	29.114.811,48	-27.642.419,89	13.925.520,82	-14.039.823,85	
FIC FIA EMB VIII ETF	68.571.287,42	2.219.086,62	2.028.346,49	12,38%	6.159.065,33	-6.159.065,30	5.016.222,29	-5.057.285,17	
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	111.992.754,11	3.719.548,26	3.160.619,63	19,29%	28.743.471,70	-29.316.652,74	16.315.539,80	-16.448.851,53	
Total Var:	488.853.980,47	18.777.679,38	16.387.365,82	100,01%	118.334.557,04	-116.453.673,38	63.726.510,64	-64.250.471,69	

Relatório de Risco de Mercado



Data: 31/05/2024

FI RF EMB II									
CNPJ: 11005764000196									
Dados Gerais									
PL:	3.063.001.631,34	VAR / PL:	1,0085%	Limite Fundo:	0,00%	Duration DC:	2,117,21		
VAR:	30.891.454,46	ETL / PL:	1,2647%	Status:	ENQUADRADO	Duration DU:	1,456,98		
ETL:	38.739.130,16	VAR / CDI:	0,011%	Benchmark:					
Cenários de STRESS									
Cenário Alta - 09999 (+):	0,00	Cenário Baixa - 10000 (+):	194.035.070,96	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	175.528.520,17	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	0,00		
Cenário Alta - 09999 (-):	-160.792.019,65	Cenário Baixa - 10000 (-):	-1.525.116,83	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	-197.266.417,11		
Cenário Alta - 09999:	-160.792.019,65	Cenário Baixa - 10000:	192.509.954,13	CENÁRIO BRADESCO 1:	175.528.520,17	CENÁRIO BRADESCO 2:	-197.266.417,11		
Parâmetros do Cálculo									
Modelo:	VaR paramétrico	Modelo Volatilidade:	EWMA						
Int. Confiança:	95	Lambda:	0,94						
Horizonte:	21								
Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2	
CSMGC3	8.517.367,30	84.982,17	43.631,37	0,14%	0,00	0,00	0,00	0,00	
ELET42	14.790.799,33	215.525,03	160.344,68	0,52%	0,00	0,00	0,00	0,00	
ENTV12	14.267.593,02	228.422,35	190.791,26	0,62%	-32.680,16	33.331,79	114.587,86	-174.412,34	
GASP17	49.495.234,84	947.854,25	705.186,14	2,28%	0,00	0,00	0,00	0,00	
IGSN15	2.777.897,80	66.049,40	55.491,00	0,18%	-329.709,94	-186.818,10	9.082,61	-12.241,25	
NEOE16	7.767.374,23	113.265,83	85.285,54	0,28%	0,00	0,00	0,00	0,00	
NTNB20240815 - 760199_VENCIMENTO	127.282.331,67	267.333,95	-106.593,36	-0,35%	-1.457.314,61	-407.025,54	338.154,52	-444.540,85	
NTNB20250815 - 760199_VENCIMENTO	43.354.567,83	329.784,49	289.713,19	0,94%	-1.629.994,01	-532.669,94	352.981,69	-451.791,19	
NTNB20300815 - 760199_VENCIMENTO	26.643.152,41	374.521,34	364.632,95	1,18%	-1.280.118,23	1.457.662,29	1.046.901,31	-1.381.804,92	
NTNB20350515 - 760199_VENCIMENTO	234.074.840,23	3.919.009,72	3.884.229,37	12,57%	-365.482,87	-118.683,52	86.285,04	-110.908,26	
NTNB20400815 - 760199_VENCIMENTO	29.529.920,98	488.400,73	487.700,65	1,58%	-761.110,83	-207.693,79	180.324,51	-236.981,01	
NTNB20450515 - 760199_VENCIMENTO	221.892.311,92	3.824.637,73	3.817.044,72	12,36%	-390.272,98	396.305,39	349.036,77	-472.121,83	
NTNB20500815 - 760199_VENCIMENTO	712.149.291,24	13.265.394,41	13.239.347,13	42,86%	-1.007.333,21	1.031.821,60	818.002,67	-1.084.895,81	
NTNB20550515 - 760199_VENCIMENTO	220.881.887,95	4.397.304,11	4.387.249,96	14,20%	-1.397.383,42	1.394.234,49	1.262.913,97	-1.612.689,69	
PETRA5	9.692.100,57	57.349,47	-22.927,98	-0,07%	-18.165.732,20	18.754.066,39	17.916.251,28	-21.934.689,48	
SBSPC2	4.937.954,67	31.129,14	9.989,76	0,03%	-2.924.294,26	2.980.244,60	2.918.248,66	-3.434.343,07	
BBTOPIND	258.954.838,00	3.346.155,79	3.298.890,78	10,68%	-21.969.964,47	31.317.106,57	26.059.585,71	-29.678.751,49	
CAIXA	5.000,00	0,00	0,00	0,00%	-81.869.039,40	101.685.790,54	92.664.327,62	-102.322.738,31	
COMPROMISSADA_PRE	1.140.614.256,70	10.663,33	1.447,29	0,00%	-26.976.193,98	34.984.507,29	31.374.587,75	-33.852.856,82	
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-63.078,24	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-107.846,13	-48.435,26	14.744,46	-19.973,16	
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-127.548,97	-23.791,76	22.503,74	-30.375,64	
Total Var:	3.127.565.642,65	31.967.783,24	30.891.454,46	100,00%	-160.792.019,65	192.509.954,13	175.528.520,17	-197.266.417,11	

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – MAIO 2024



bradesco

Data: 31/05/2024

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FI RF EMB V CREDITO PRIVADO
CNPJ: 20726178000121

Dados Gerais							
PL:	130.021.681,27	VAR / PL:	1,1896%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	651,45
VAR:	1.546.799,22	ETL / PL:	1,4919%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	450,06
ETL:	1.939.748,62	VAR / CDI:	0,013%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	0,00	Cenário Baixa - 1000	301.636,66	CENARIO BRADESCO	1.254.270,86	CENARIO BRADESCO	34.630,91
Cenário Alta - 09999 (-):	-8.670.031,49	Cenário Baixa - 1000	-3.794.653,79	CENARIO BRADESCO	-25.456,98	CENARIO BRADESCO	-1.652.985,38
Cenário Alta - 09999:	-8.670.031,49	Cenário Baixa - 1000	-3.493.017,13	CENARIO BRADESCO	1.228.813,88	CENARIO BRADESCO	-1.618.354,47

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	CENARIO BRADESCO
17H0164854	7.233.140,31	93.492,00	84.822,24	5,48%	-552.460,69	-284.576,58	45.250,57	-60.358,96
AEGP23	15.919.655,48	198.716,76	177.347,91	11,47%	-731.329,85	-476.468,07	-6.049,70	8.242,94
CCRDD1	3.199.402,50	39.214,11	18.100,08	1,17%	0,00	0,00	0,00	0,00
CMDT33	713.120,38	4.495,55	1.772,95	0,11%	-60.101,71	-16.394,26	11.394,36	-15.398,06
ENJG21	1.750.051,28	22.127,78	20.491,81	1,32%	-18.420,13	-3.435,92	3.249,90	-4.386,73
ENMI21	1.118.694,69	14.669,86	13.509,80	0,87%	-50,36	51,36	176,56	-268,74
ENTV12	18.755.939,99	300.280,21	272.678,93	17,63%	0,00	0,00	0,00	0,00
ERDV17_VENCIMENTO	13.928.725,18	188.565,65	173.732,43	11,23%	0,00	0,00	0,00	0,00
ERDV36	2.194.468,20	26.896,93	12.414,84	0,80%	-123.074,47	-66.737,65	8.137,84	-10.861,83
GASP17	10.240.393,42	196.107,78	114.467,21	7,40%	-81.752,16	-44.391,58	5.408,31	-7.217,18
GRRB24_VENCIMENTO	16.941.680,89	244.027,45	198.103,82	12,81%	-2.142.762,96	-700.237,58	464.023,84	-607.063,00
LFSN16000GM	15.410.400,10	108.513,05	54.621,47	3,53%	-598.032,24	-400.952,90	-12.759,62	17.353,17
LFSN18000DC5	5.345.435,52	133.479,96	120.324,28	7,78%	-41.223,73	-11.244,81	7.815,39	-10.561,52
OMGE31	13.726.944,28	295.866,49	264.562,87	17,10%	-264.852,05	301.585,30	216.600,27	-285.890,67
SBSPC2	3.784.253,85	23.856,15	9.408,36	0,61%	-1.674.584,21	-474.486,16	386.340,99	-508.114,82
TAE33	4.353.784,09	32.330,26	10.440,07	0,67%	-346.816,62	-49.273,85	69.799,07	-94.217,92
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	-477.508,72	-317.473,23	-6.647,67	9.034,80
COMPROMISSADA_PRE	1.757.511,55	16,43	0,15	0,00%	-1.393.969,78	-913.527,24	5.770,91	-7.710,92
CONTAS_A PAGAR_RECEBER	-14.445,97	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-97.748,50	-18.233,07	17.245,98	-23.278,69
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-65.343,32	-17.220,89	13.056,86	-17.656,35
Total Var:	136.360.155,75	1.922.656,42	1.546.799,22	99,98%	-8.670.031,49	-3.493.017,13	1.228.813,88	-1.618.354,47



Data: 31/05/2024

Relatório de Risco de Mercado

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

Dados Gerais									
PL:	245.017.003,19	VAR / PL:	1,1681%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	1.040,70		
VAR:	2.862.137,08	ETL / PL:	1,4649%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	717,88		
ETL:	3.559.235,37	VAR / CDI:	0,0128%	Benchmark:					

Cenários de STRESS									
Cenário Alta - 09999 (+):	350.534,69	Cenário Baixa - 10000 (+):	8.452.498,17	CENARIO BRADESCO 1 (+):	8.720.590,98	CENARIO BRADESCO 2 (+):	126.369.800,39		
Cenário Alta - 09999 (-):	-14.279.726,99	Cenário Baixa - 10000 (-):	-3.543.171,94	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-359.020,66	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-135.561.719,81		
Cenário Alta - 09999:	-13.929.192,30	Cenário Baixa - 10000:	4.909.326,23	CENARIO BRADESCO 1:	8.361.570,32	CENARIO BRADESCO 2:	-9.191.919,42		

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
RDORC3	1.604.081,29	1.134,85	835,99	0,03%	-6.952,06	5.598,00	9.230,61	-12.269,20
RIS412	2.898.853,24	76.982,89	67.207,83	2,35%	-408.781,88	-113.207,94	109.283,25	-140.229,17
RLOG11	1.015.307,08	15,69	1,82	0,00%	-96,64	82,53	149,42	-223,00
RODB11	2.800.397,79	3.060,11	2.226,79	0,08%	-18.875,24	15.843,15	24.698,64	-33.410,46
RSAN24	1.865.649,87	59,18	18,72	0,00%	-389,81	321,72	557,06	-824,27
SNGO18	1.262.951,73	28,46	6,39	0,00%	-181,81	151,99	267,36	-397,39
TBSP11	2.637.423,88	425,50	273,69	0,01%	-2.734,67	2.230,25	3.525,65	-5.016,45
UNEG11	5.023.606,29	187.559,63	156.656,93	5,47%	-987.416,33	-324.841,70	264.998,60	-331.458,36
VAMO33	2.957.525,43	59.573,82	54.927,79	1,92%	-386.543,35	-114.954,14	94.668,53	-122.879,87
VCCS11	2.175.629,53	6.598,40	4.944,20	0,17%	-38.900,31	33.619,94	52.523,71	-67.904,35
VECS11	3.604.473,79	44,42	5,36	0,00%	-275,22	234,43	433,60	-647,80
VERDECS2	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
VIXL14	2.156.522,83	91,22	31,31	0,00%	-594,09	491,08	838,79	-1.239,41
VVRT11	2.590.043,61	240,47	142,84	0,00%	-1.568,15	1.274,72	2.036,77	-2.929,52
Total Var:	262.760.650,55	3.618.313,06	2.862.137,08	99,99%	-13.929.192,30	4.909.326,23	8.361.570,32	-9.191.919,42

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – MAIO 2024

Relatório de Risco de Mercado



Data: 31/05/2024

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

Dados Gerais			
PL: 293.302.363,44	VAR / PL: 2,7581%	Limite Fundo: 0,00%	Dutacion DC: 1.839,22
VAR: 8.069.537,16	ETL / PL: 3,4588%	Status: ENQUADRADO	Dutacion DU: 1.267,03
ETL: 10.144.605,96	VAR / CDI: 0,0302%	Benchmark:	

Cenários de STRESS			
Cenário Alta - 09999 (+): 0,00	Cenário Baixa - 10000 (+): 281,72	CENARIO BRADESCO 1 (+): 11.193.780,50	CENARIO BRADESCO 2 (+): 12.928,11
Cenário Alta - 09999 (-): -47.002.931,42	Cenário Baixa - 10000 (-): -15.571.913,02	CENARIO BRADESCO 1 (-): -9.505,92	CENARIO BRADESCO 2 (-): -14.262.291,73
Cenário Alta - 09999:	Cenário Baixa - 10000:	CENARIO BRADESCO 1:	CENARIO BRADESCO 2:

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
ANEM11	11.607.751,39	356.507,65	354.153,07	4,38%	-1.932.797,87	-646.055,84	492.907,80	-619.908,01
ANET11	1.965.255,71	23.717,03	21.601,64	0,27%	-166.367,37	-70.800,40	23.344,93	-30.859,25
APPSA2	3.477.636,52	67.376,29	65.072,44	0,80%	-447.942,09	-133.727,96	108.604,52	-141.143,02
ASAB11	6.555.441,90	127.153,36	126.422,26	1,56%	-724.579,94	-209.309,91	178.952,38	-230.822,07
ASER12	2.932.930,89	112.250,40	110.138,45	1,36%	-610.437,54	-139.247,43	201.486,06	-245.315,87
BRKP28	10.923.888,09	386.710,97	381.682,12	4,72%	-1.769.469,16	-467.481,54	506.833,71	-645.533,33
CAEC21	9.346.004,55	134.163,47	112.370,13	1,39%	-940.444,64	-342.592,99	172.102,71	-227.131,71
CAIXA	999,97	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CART13	10.610.064,99	273.169,38	273.014,37	3,37%	-1.520.541,04	-508.988,05	359.230,67	-461.265,24
CBAN32	16.973.567,88	429.747,97	429.068,13	5,30%	-2.395.265,65	-709.422,21	612.989,55	-788.234,26
CBAN72	4.989.786,72	134.301,38	134.030,96	1,66%	-727.772,59	-213.612,24	189.259,67	-242.997,31
CJEN13	7.557.280,70	195.647,95	195.429,18	2,42%	-1.087.054,24	-382.800,56	247.777,27	-317.830,03
CNRD11	10.796.345,49	331.244,07	329.053,19	4,07%	-1.739.170,63	-602.548,54	416.119,70	-531.806,75
COMPROMISSADA_PRE	9.640.330,47	90,13	4,52	0,00%	-276,21	281,72	968,48	-1.474,11
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	3.486.372,11	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CRMG15	9.832.217,25	162.150,11	156.558,70	1,94%	-1.079.544,57	-426.556,54	189.688,86	-247.636,22
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ERDV17	10.376.900,26	140.481,41	102.253,89	1,26%	-445.534,02	-298.709,91	-9.505,92	12.928,11
ERDV38	6.056.223,01	107.293,19	89.943,71	1,11%	-431.001,00	-231.631,41	22.339,41	-30.159,18
GBSP11	5.355.941,92	180.035,85	176.774,33	2,19%	-1.015.320,78	-209.091,37	344.454,32	-417.937,29
GRRB24	9.753.883,05	140.494,63	111.453,67	1,38%	-964.113,22	-273.177,29	222.429,22	-292.538,42
HARG11	10.716.095,47	336.156,69	333.396,04	4,12%	-1.807.079,74	-659.819,69	423.342,04	-538.686,23
HVRD15	12.038.406,11	342.734,97	341.210,13	4,22%	-1.933.776,78	-623.245,51	482.738,38	-619.430,73
IPIL11	8.401.321,90	184.021,17	183.837,10	2,27%	-1.071.642,71	-392.428,87	227.995,88	-293.534,11
IRBR12	12.416.769,36	211.279,61	176.292,36	2,18%	-1.218.585,23	-707.107,66	59.844,10	-80.279,78
ITPO14	9.760.817,56	325.441,45	323.110,55	3,99%	-1.758.256,49	-602.005,80	435.494,77	-554.288,83
LCAMD1	11.489.543,89	246.323,66	241.206,61	2,98%	-1.560.429,88	-462.325,57	386.427,67	-500.754,02
LORTA7	6.699.968,19	146.584,34	143.500,82	1,77%	-942.294,81	-290.763,99	227.524,00	-295.119,06
MOV37	9.025.653,56	189.794,24	185.884,80	2,30%	-1.208.484,30	-361.769,83	296.144,09	-383.882,12
MTRJ19	9.355.352,00	155.405,61	151.056,22	1,87%	-1.011.505,66	-355.078,10	205.256,65	-267.364,58
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PASN12	3.644.287,09	48.326,42	45.249,14	0,56%	-337.129,95	-135.237,83	54.800,17	-71.960,93
PEJA11	5.149.614,33	99.341,83	97.411,75	1,20%	-629.748,81	-179.590,51	156.441,05	-202.786,64
QUAT12	3.601.825,05	76.074,68	53.910,37	0,67%	-346.591,92	-224.084,15	761,62	-1.030,12
RAHD11	9.133.208,81	278.191,05	276.344,45	3,42%	-1.531.828,46	-466.538,25	416.752,44	-521.235,47
RDVE11	9.212.901,30	238.894,11	238.287,47	2,95%	-1.332.911,07	-462.145,44	315.623,85	-401.605,81
RMSA12	12.263.212,15	464.341,33	456.872,51	5,65%	-2.492.818,88	-620.337,23	787.307,66	-965.697,23
RSAN44	7.682.318,76	108.457,78	104.272,31	1,29%	-780.431,46	-283.281,85	147.369,11	-192.954,69
TCIH11	10.863.599,52	311.536,78	309.115,78	3,82%	-1.764.679,96	-499.404,26	505.584,83	-626.726,69
UNEG11	5.465.917,99	204.073,63	200.643,56	2,48%	-1.074.355,03	-353.442,92	288.330,84	-360.642,16
UTPS21	6.779.877,90	224.392,59	222.533,65	2,75%	-1.187.183,88	-401.289,22	296.876,11	-378.187,34
VAMO33	1.344.453,70	27.081,51	26.128,72	0,32%	-175.717,72	-62.256,70	43.035,12	-55.859,64
VAMO34	7.441.939,90	161.414,26	158.631,14	1,96%	-1.003.357,11	-295.741,68	249.010,79	-322.582,75
VERO12	8.413.740,00	122.615,56	109.016,08	1,35%	-881.298,77	-287.866,10	185.307,54	-243.353,70
VIMT13	9.593.244,16	282.087,63	280.728,42	3,47%	-1.523.138,64	-532.152,82	364.035,57	-464.372,15
VRDN12	10.412.050,01	262.170,95	261.672,51	3,24%	-1.432.051,74	-458.244,88	345.259,94	-447.364,92
Total Var:	353.144.939,59	8.349.576,27	8.069.537,16	100,01%	-47.002.931,42	-15.571.913,30	11.184.274,59	-14.249.363,61

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – MAIO 2024

Relatório de Risco de Mercado



Data: 31/05/2024

FUNDO: FIRF EMB II A CRED PRIV
CNPJ: 20725957000102

Dados Gerais							
PL:	220.734.598,53	VAR / PL:	0,1922%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	719,13
VAR:	424.319,28	ETL / PL:	0,2411%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	497,55
ETL:	532.113,50	VAR / CDI:	0,0021%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	1.128.460,74	Cenário Baixa - 10000 (+):	2.823.966,65	CENARIO BRADESCO 1 (+):	2.910.288,43	CENARIO BRADESCO 2 (+):	33.438.197,59
Cenário Alta - 09999 (-):	-2.660.922,23	Cenário Baixa - 10000 (-):	-1.052.001,82	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-1.453.727,26	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-35.455.759,08
Cenário Alta - 09999:	-1.532.461,49	Cenário Baixa - 10000:	1.771.964,83	CENARIO BRADESCO 1:	1.456.561,17	CENARIO BRADESCO 2:	-2.017.561,49

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
CAIXA	8.996,59	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CDB323R5ITI	6.631.628,15	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	4.351.905,44	40,68	12,29	0,00%	-124,69	127,17	437,20	-665,45
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-24.881,02	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPGT16	148.275,10	3,26	1,05	0,00%	13,85	-14,13	-41,45	63,12
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DHF26	2.922,15	14.656,61	9.064,02	2,14%	-93.316,67	70.183,69	112.442,47	-162.388,61
DHF27	-23.902,63	105.475,81	-69.573,34	-16,40%	640.338,56	-499.421,22	-781.774,97	1.090.030,89
DHF28	-431,80	1.851,99	-1.186,71	-0,28%	11.094,54	-8.993,41	-14.157,63	19.026,58
DHF29	-10.799,73	44.288,30	-27.606,76	-6,51%	263.722,51	-219.608,95	-348.387,51	451.454,71
DHF33	-9.135,01	31.859,56	-18.425,21	-4,34%	186.715,35	-168.149,66	-277.199,40	310.531,95
DHN26	-909,99	4.329,43	-2.841,16	-0,67%	26.567,83	-20.517,22	-32.148,61	45.639,43
DHV24	6.715,92	75.359,29	9.003,95	2,12%	-388.525,60	367.949,14	755.706,21	-1.137.835,26
IDIN24P400700	-3,30	9,44	4,42	0,00%	3,30	-10.396,38	3,30	-18.896.015,54
IDIN24P400800	3,30	14,98	-7,01	0,00%	-3,30	34.342,02	-3,30	18.928.639,98
IDIN24P410200	-4,80	20,67	-0,87	0,00%	4,80	-124.900,87	4,80	-12.569.929,04
IDIN24P410300	14,40	58,05	2,45	0,00%	-14,40	147.036,21	-14,40	12.592.810,94
LF002200J5M	10.594.057,62	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002200J5N	11.107.226,86	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306J15	11.014.447,35	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306J55	6.618.426,89	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024000XE	10.593.819,83	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024000XG	10.574.805,82	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024000XN	10.551.589,82	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024002C7	6.575.222,31	64.419,03	42.478,92	10,01%	-381.771,13	312.486,37	477.870,18	-666.026,56
LF0024002SX	4.537.511,35	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024002TZ	10.538.373,71	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF00240033U	6.749.443,19	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024003QF	11.104.065,54	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024006I2	11.147.988,01	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024007F1	6.800.095,04	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024009LF	6.691.961,62	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20250301 - 210100	625.330,70	62,18	-27,65	-0,01%	-1.259,31	1.527,89	8,58	-13,06
LFT20260301 - 210100	193.442,00	10,95	0,04	0,00%	-893,50	1.457,36	31,50	-47,95
LFT20260901 - 210100	322.217,76	74,82	-21,02	0,00%	-5.294,81	9.346,12	240,19	-365,56
LFT20300301 - 210100	972.932,90	1.200,20	-842,66	-0,20%	-13.919,69	32.645,10	2.493,98	-3.784,76
LTN20260101 - 100000	594.219,78	3.242,73	1.922,35	0,45%	-20.858,43	16.051,01	25.437,96	-36.733,08
LTN20260701 - 100000	562.937,95	4.200,09	2.655,12	0,63%	-25.961,27	21.123,79	32.277,96	-45.807,20
LTN20280101 - 100000	135.287,73	1.708,38	1.004,52	0,24%	-10.681,29	9.406,65	14.231,13	-19.106,69
NTNB20240815 - 760199_NEGOCIACAO	14.068.457,05	29.548,30	-10.034,15	-2,36%	-43.136,69	43.803,45	38.578,87	-52.183,41
NTNB20250515 - 760199_NEGOCIACAO	9.104.077,96	32.006,51	25.062,40	5,91%	-129.020,97	123.721,94	75.906,37	-101.999,75
NTNB20260815 - 760199_NEGOCIACAO	13.804.094,40	105.003,38	102.948,46	24,26%	-320.734,89	328.532,00	260.452,05	-345.430,83
NTNB20270515 - 760199_NEGOCIACAO	11.043.285,94	113.635,93	110.088,36	25,94%	-333.019,87	336.290,40	276.661,39	-364.194,73
NTNB20280815 - 760199_NEGOCIACAO	18.396.411,00	229.259,99	219.646,99	51,76%	-702.210,82	739.315,02	629.552,79	-818.519,53
NTNB20290515 - 760199_NEGOCIACAO	682.110,21	9.169,78	8.722,62	2,06%	-30.479,82	30.261,38	27.198,94	-35.119,53
NTNB20500815 - 760199_NEGOCIACAO	1.389.130,08	25.875,70	22.270,87	5,25%	-159.695,09	198.349,97	180.752,56	-199.692,41
OUTRAS DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
Total Var:	218.773.363,17	897.386,04	424.319,28	100,00%	-1.532.461,49	1.771.964,82	1.456.561,17	-2.017.561,49

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – MAIO 2024

Relatório de Risco de Mercado



Data: 31/05/2024

FUNDO: FIM EMB III A IMOBILIÁRIO
CNPJ: 3271198000162

Dados Gerais			
PL: 71.285.185,14	VAR / PL: 1,0766%	Limite Fundo: 0,00%	Dutacion DC: 3,00
VAR: 767.421,69	ETL / PL: 1,3500%	Status: ENQUADRADO	Dutacion DU: 1,00
ETL: 962.377,76	VAR / CDI: 0,0118%	Benchmark:	

Cenários de STRESS			
Cenário Alta - 09999 (+): 35.003.359,64	Cenário Baixa - 10000 (+): 29,16	CENARIO BRADESCO 1 (+): 9.436.392,91	CENARIO BRADESCO 2 (+): 0,00
Cenário Alta - 09999 (-): -28,59	Cenário Baixa - 10000 (-): -35.003.371,06	CENARIO BRADESCO 1 (-): 0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-): -9.513.686,39
Cenário Alta - 09999: 35.003.331,05	Cenário Baixa - 10000: -35.003.341,90	CENARIO BRADESCO 1: 9.436.392,91	CENARIO BRADESCO 2: -9.513.686,39

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
AIEC11	1.978.392,00	143.262,72	31.085,67	4,05%	989.196,00	-989.196,00	290.032,27	-292.406,34
BMLC11	3.477.737,85	241.125,68	154.669,13	20,15%	3.477.737,85	-3.477.737,85	609.836,37	-614.009,65
BPML11	4.424.647,60	355.117,03	-77.268,60	-10,07%	4.424.647,60	-4.424.647,60	648.653,32	-653.962,90
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CEOC11	640.437,60	12.127,86	2.090,18	0,27%	320.218,80	-320.218,80	93.888,15	-94.656,68
CNES11	291.897,04	338.021,05	137.132,03	17,87%	145.948,52	-145.948,52	42.792,11	-43.142,38
COMPROMISSADA_PRE	997.826,56	9,33	3,35	0,00%	-28,59	29,16	100,24	-162,58
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-339.202,91	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	98.794,08	1.025,75	585,76	0,08%	98.794,08	-98.794,08	14.483,21	-14.601,77
FIGS11	119.105,19	3.370,83	1.417,86	0,18%	59.552,60	-59.552,60	17.460,82	-17.603,75
FVPQ11	883.254,40	36.284,55	12.962,74	1,69%	441.627,20	-441.627,20	129.485,10	-130.545,00
GZIT11	468.470,15	17.304,86	1.819,91	0,24%	234.235,08	-234.235,08	68.677,72	-69.239,89
HOFC11	263.000,44	78.904,16	1.081,30	0,14%	0,00	0,00	38.555,87	-38.871,47
MALL11	4.677.614,18	88.698,79	27.701,74	3,61%	2.338.807,09	-2.338.807,09	685.738,24	-691.351,38
MAXR11	1.936.960,32	54.797,45	15.845,71	2,06%	968.480,16	-968.480,16	283.968,38	-286.282,74
NEWL11	6.939.297,76	328.258,84	-4.123,31	-0,54%	3.469.648,88	-3.469.648,88	1.017.301,05	-1.025.628,21
NEWU11	1.896.496,00	130.352,62	32.819,56	4,28%	1.896.496,00	-1.896.496,00	278.026,31	-280.302,11
OULG11	215.655,72	12.793,47	165,41	0,02%	107.827,86	-107.827,86	31.615,13	-31.873,92
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PATC11	4.210.037,82	152.905,67	83.213,86	10,84%	2.105.007,49	-2.105.018,91	617.191,54	-622.243,59
OAGR11	5.328.322,56	177.224,45	78.129,75	10,18%	2.664.161,28	-2.664.161,28	781.132,09	-787.526,07
RBRP11	2.190.565,20	106.099,00	-8.908,66	-1,16%	1.095.282,60	-1.095.282,60	321.136,86	-323.765,54
RCRB11	6.257.944,00	153.994,57	88.618,74	11,55%	0,00	0,00	0,00	0,00
SARE11	448.685,00	32.958,76	10.467,29	1,36%	224.342,50	-224.342,50	65.777,22	-66.315,64
TEPP11	4.900.892,92	136.480,56	76.197,05	9,93%	2.450.446,46	-2.450.446,46	718.470,90	-724.351,97
TRXF11	10.583.337,60	108.750,13	43.731,88	5,70%	5.291.668,80	-5.291.668,80	1.551.517,29	-1.564.217,30
VVMR11	3.995.550,00	111.413,58	10.244,94	1,33%	0,00	0,00	585.747,63	-590.542,29
XPIN11	2.373.140,00	56.649,83	30.419,02	3,96%	1.186.570,00	-1.186.570,00	347.902,32	-350.750,09
XPPR11	2.025.325,80	287.723,35	17.299,49	2,25%	1.012.662,90	-1.012.662,90	296.912,76	-299.343,15
Total Var:	71.285.184,78	3.165.654,78	767.421,69	99,97%	35.003.331,05	-35.003.341,90	9.436.392,91	-9.513.686,39

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – MAIO 2024



Relatório de Risco de Mercado



Data: 31/05/2024

FUNDO: FIA RVA EMB II
CNPJ: 13294268000125

Dados Gerais					
PL:	103.920.509,42	VAR / PL:	3,3613%	Limite Fundo:	0,00%
VAR:	3.462.679,53	ETL / PL:	4,2027%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	4.367.420,64	VAR / CDI:	0,0367%	Benchmark:	
				Dutacion DC:	3,00
				Dutacion DU:	1,00

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	26.321.715,05	Cenário Baixa - 10000 (+):	27,37	CENARIO BRADESCO 1 (+):	14.910.730,75
Cenário Alta - 09999 (-):	-26,83	Cenário Baixa - 10000 (-):	-26.879.101,27	CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00
Cenário Alta - 09999:	26.321.688,21	Cenário Baixa - 10000:	-26.879.073,90	CENARIO BRADESCO 1:	14.910.730,75
				CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	-15.032.831,47
				CENARIO BRADESCO 2:	-15.032.831,47

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
ABEV3	1.735.213,80	82.812,14	71.423,31	2,05%	242.929,93	-520.564,14	254.392,34	-256.464,60
B3SA3	2.004.420,30	152.918,75	78.961,98	2,27%	501.105,08	-501.105,08	293.848,02	-296.253,32
BBAS3	3.411.696,00	98.349,36	18.023,34	0,52%	852.924,00	-852.924,00	500.154,63	-504.248,67
BBDC4	2.493.202,60	155.677,91	22.535,36	0,65%	623.300,65	-623.300,65	365.503,50	-368.495,34
BBSB3	717.060,00	31.418,72	17.581,02	0,50%	143.412,00	-143.412,00	105.121,00	-105.981,47
BPAC11	3.632.850,00	305.748,43	252.744,80	7,26%	1.089.855,00	-1.271.497,50	532.575,81	-536.935,23
BRFS3	774.786,00	51.938,87	9.041,65	0,26%	193.696,50	-193.696,50	113.583,63	-114.513,37
BRIT3	536.400,00	84.547,04	776,44	0,02%	252.108,00	-252.108,00	78.636,24	-79.279,92
CAIXA	10.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CEAB3	702.491,00	198.606,30	3.775,97	0,11%	210.747,30	-281.003,71	102.985,18	-103.828,17
CMGM4	2.355.463,50	119.645,21	30.356,91	0,87%	588.865,88	-706.639,05	345.310,95	-348.137,51
COMPROMISSADA_PRE	936.561,62	8,76	-1,37	0,00%	-26,83	27,37	94,09	-143,21
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	1.264.284,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPFE3	545.600,00	47.629,19	13.634,86	0,39%	109.120,00	-109.120,00	79.984,96	-80.639,68
CPLES	1.497.292,00	101.847,10	58.959,79	1,69%	329.404,24	-329.404,24	219.503,01	-221.289,76
CURY3	593.446,00	53.046,68	32.762,60	0,94%	178.033,50	-178.033,50	86.999,19	-87.711,32
CXSE3	1.110.789,00	100.731,10	51.431,61	1,48%	222.157,80	-222.157,80	162.841,67	-164.174,61
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DIRR3	1.353.012,00	169.042,08	95.148,43	2,73%	405.903,60	-405.903,60	198.351,56	-199.975,17
ELET3	2.884.856,38	211.366,40	123.764,98	3,55%	865.456,91	-865.465,21	422.919,95	-426.381,77
ENEV3	321.937,00	14.768,17	9.016,97	0,26%	119.116,69	-164.187,87	47.195,96	-47.882,29
ENGH1	959.910,00	50.959,94	25.129,06	0,72%	163.184,70	-211.180,20	140.722,81	-141.874,70
EQTL3	2.811.926,00	113.229,80	83.875,08	2,41%	562.385,20	-562.385,20	412.228,35	-415.602,66
GGBR4	1.867.503,20	87.472,58	28.285,47	0,81%	466.875,80	-466.875,80	273.775,97	-276.016,97
GMAT3	1.020.736,00	128.889,48	34.236,62	0,98%	183.732,48	-163.317,76	149.639,90	-150.864,78
GOAU4	714.357,00	34.613,82	14.540,26	0,42%	214.307,10	-178.589,25	104.724,74	-105.581,97
HAPV3	849.423,12	167.268,18	95.090,16	2,73%	288.803,86	-288.803,86	124.525,43	-125.544,74
IGT11	317.925,00	18.661,85	8.744,38	0,25%	63.585,00	-63.585,00	46.607,81	-46.989,32
INTB3	478.470,00	133.814,07	72.996,75	2,10%	239.236,00	-167.464,50	70.143,70	-70.717,87
ITSA4	2.616.825,12	228.811,19	127.252,27	3,65%	497.196,77	-497.196,77	383.626,56	-386.766,75
ITUB4	9.164.307,11	595.162,90	412.065,49	11,83%	1.832.851,42	-1.741.218,35	1.343.487,42	-1.354.494,59
JBS33	2.491.776,00	690.645,96	255.599,05	7,37%	872.121,60	-872.121,60	365.294,36	-368.284,49
KLBN11	520.192,00	51.554,67	-14.200,35	-0,41%	130.048,00	-104.038,40	76.260,15	-76.884,38
LEN3	583.194,00	89.777,70	-3.090,39	-0,09%	116.636,80	-116.636,80	85.494,77	-86.194,60
MRF33	1.512.648,00	284.609,11	29.377,97	0,84%	605.045,79	-453.807,81	221.754,20	-223.669,37
NTCO3	1.539.945,00	188.767,75	64.193,69	1,84%	384.986,25	-384.986,25	225.755,94	-227.503,87
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PETR3	2.771.670,00	468.417,64	85.082,32	2,44%	692.917,50	-831.501,00	406.326,82	-409.652,83
PETRA	9.587.297,61	1.377.499,47	239.472,67	6,88%	2.396.824,40	-2.876.189,28	1.405.497,83	-1.417.002,59
PRIO3	1.868.289,00	293.640,88	-18.809,44	-0,54%	1.120.973,40	-1.120.973,40	273.891,17	-276.133,11
RADL3	2.020.541,72	181.736,46	121.481,83	3,49%	404.108,34	-404.108,34	296.211,42	-298.636,07
RAIL3	622.836,00	33.984,14	898,09	0,03%	280.276,20	-205.539,04	91.307,76	-92.055,16
RDOR3	1.263.160,00	298.844,99	206.953,78	5,94%	378.948,00	-378.952,60	185.179,26	-186.695,05
RENT3	2.444.156,00	206.994,84	38.582,30	1,11%	806.571,48	-635.480,56	358.313,27	-361.246,26
RRRP3	304.560,00	78.848,63	-13.501,85	-0,39%	182.736,00	-182.736,00	44.648,50	-45.013,97
SBF33	997.854,00	147.838,79	62.206,13	1,79%	379.184,52	-399.141,60	146.285,40	-147.482,82
SBSF3	1.720.938,00	180.144,37	-2.949,09	-0,08%	430.234,50	-430.234,50	282.289,51	-254.354,64
SRIA3	689.117,00	92.861,27	38.832,71	1,12%	0,00	0,00	101.024,55	-101.851,49
SUZB3	2.182.640,00	569.126,11	-191.187,55	-5,49%	538.135,00	-430.508,00	316.562,36	-318.145,41
TIMS3	785.070,00	59.810,38	17.108,04	0,49%	251.222,40	-180.566,10	115.091,26	-116.033,35
TOTS3	275.712,00	27.889,00	14.247,50	0,41%	55.142,40	-55.142,40	40.419,38	-40.750,23
VALE3	14.244.964,00	1.249.997,81	656.974,98	18,86%	3.561.241,00	-3.561.241,00	2.088.311,72	-2.105.405,68
VBBR3	1.486.260,00	125.501,23	41.342,23	1,19%	371.565,00	-371.565,00	217.885,72	-219.669,23
VIVT3	1.662.720,00	106.608,23	6.079,90	0,17%	249.408,00	-249.408,00	243.754,75	-245.750,02
WEGE3	2.692.335,00	211.747,25	54.840,83	1,57%	673.083,75	-673.083,75	394.696,31	-397.927,11
Total Var:	103.920.509,08	10.545.602,89	3.462.679,53	99,99%	26.321.688,21	-26.879.073,90	14.910.730,75	-15.032.831,47

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – MAIO 2024

Relatório de Risco de Mercado



Data: 31/05/2024

FUNDO: FIA RVA EMB III
CNPJ: 38452593000108

Dados Gerais	
PL: 103.695.921,01	VAR / PL: 4,9337%
VAR: 5.116.001,35	ETL / PL: 6,1870%
ETL: 6.415.672,10	VAR / CDI: 0,054%
Limite Fundo: 0,00%	Dutacion DC: 3,00
Status: ENQUADRADO	Dutacion DU: 1,00
Benchmark:	

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	28.820.701,55	Cenário Baixa - 10000 (+):	838.506,00	CENARIO BRADESCO 1 (+):	14.625.050,77	CENARIO BRADESCO 2 (+):	1.073.266,33
Cenário Alta - 09999 (-):	-825.181,24	Cenário Baixa - 10000 (-):	-27.294.967,55	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-1.066.553,80	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-14.744.946,00
Cenário Alta - 09999:	27.995.520,31	Cenário Baixa - 10000:	-26.456.461,55	CENARIO BRADESCO 1:	13.558.496,97	CENARIO BRADESCO 2:	-13.671.679,66

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
ALOS3	5.394.616,38	618.640,09	290.497,49	5,68%	0,00	0,00	790.850,76	-797.324,30
B3SA3	1.128.850,00	86.120,82	34.349,62	0,67%	282.212,50	-282.212,50	165.489,41	-166.844,03
BBAS3	1.924.055,52	55.464,97	19.893,12	0,39%	481.013,88	-481.013,88	282.066,54	-284.375,41
BBDC4	1.667.372,00	104.112,27	41.397,61	0,81%	416.843,00	-416.843,00	244.436,74	-246.437,58
BBSE3	2.648.600,00	116.051,12	6.388,58	0,12%	529.720,00	-529.720,00	388.284,76	-391.463,08
BPAC11	3.432.916,89	288.921,63	237.391,78	4,64%	1.029.875,07	-1.201.520,91	503.265,62	-507.385,12
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	3.511.902,50	32,83	9,54	0,00%	-100,62	102,63	352,81	-537,01
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	481.416,40	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPLE3	1.711.622,22	110.971,06	52.699,04	1,03%	376.556,89	-376.556,89	250.923,82	-252.977,76
CPLE6	2.079.392,64	141.442,09	58.415,34	1,14%	457.466,38	-457.466,38	304.838,96	-307.334,23
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DOLN24	-56.296,34	258.462,46	172.963,12	3,38%	-819.228,98	832.457,25	-1.058.989,59	1.065.654,52
ELET3	7.232.423,52	529.902,04	427.237,61	8,35%	2.169.727,06	-2.169.747,85	1.060.273,29	-1.065.952,20
ENEV3	4.062.310,45	188.349,84	123.486,10	2,41%	1.503.854,87	-2.071.778,33	595.534,71	-600.409,49
EQTL3	8.738.396,19	351.875,13	183.713,69	3,59%	1.747.679,24	-1.747.679,24	1.281.048,88	-1.291.534,96
EQTL9	130.161,19	4.323,62	3.017,41	0,06%	0,00	0,00	19.081,63	-19.237,82
FLRY3	3.619.280,00	256.491,83	51.621,45	1,01%	723.856,00	-723.856,00	530.596,45	-534.929,58
HAPV3	3.261.948,69	642.342,08	221.558,18	4,33%	1.109.062,56	-1.109.062,56	478.201,68	-482.116,02
IGTI11	6.571.266,75	385.726,14	340.256,41	6,65%	1.314.253,35	-1.314.253,35	963.347,71	-971.233,23
ITSA4	1.401.120,00	122.511,79	70.186,06	1,37%	266.212,80	-266.212,80	205.404,19	-207.085,54
ITUB4	3.965.634,00	257.542,46	194.841,56	3,81%	793.126,80	-753.470,46	581.361,94	-586.120,71
MGLU3	1.678.522,86	275.123,42	211.212,92	4,13%	872.831,89	-755.335,29	246.071,45	-248.085,68
NTCO3	1.423.654,65	174.512,78	132.957,22	2,60%	355.913,66	-355.913,66	208.707,77	-210.416,16
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PRIO3	2.334.321,00	366.887,61	124.611,29	2,44%	1.400.592,60	-1.400.592,60	342.211,46	-345.012,64
RAIL3	7.533.043,74	411.029,63	227.066,04	4,44%	3.389.869,68	-2.485.942,65	1.104.344,21	-1.113.383,87
RECV3	2.587.501,66	233.910,14	132.154,68	2,58%	1.552.501,00	-1.552.501,00	379.327,74	-382.432,75
RENT3	7.110.314,73	602.170,43	384.515,11	7,52%	2.346.403,86	-1.848.681,83	1.042.372,14	-1.050.904,52
SCAR3	160.580,00	9.301,29	965,35	0,02%	96.348,00	-96.348,00	23.541,03	-23.733,72
SMFT3	4.140.000,00	475.693,57	317.280,28	6,20%	1.655.981,60	-1.656.000,00	806.924,00	-811.892,00
SOMIA3	3.030.930,00	352.719,00	237.892,70	4,65%	909.249,00	-909.249,00	444.319,68	-447.956,67
SRNA3	180.752,00	24.357,05	9.499,86	0,19%	0,00	0,00	26.498,24	-26.715,15
SUZB3	7.271.250,90	1.922.600,29	574.443,52	11,23%	1.817.812,73	-1.454.250,18	1.065.965,38	-1.074.690,88
VIVA3	882.900,00	177.037,66	1.270,13	0,02%	264.870,00	-264.870,00	129.433,14	-130.492,62
WDON24	-402,12	1.846,16	1.235,45	0,02%	-5.851,64	5.946,12	-7.564,21	7.611,82
YDUQ3	2.455.556,81	411.956,94	230.983,09	4,51%	957.667,16	-613.889,20	359.984,63	-362.931,30
Total Var:	103.696.815,23	9.956.330,27	5.116.001,35	99,99%	27.995.520,31	-26.456.461,55	13.558.496,96	-13.671.679,67

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – MAIO 2024

Relatório de Risco de Mercado



Data: 31/05/2024

FUNDO: FIA RVA EMB IV
CNPJ: 38452613000132

Dados Gerais	
PL: 100.672.616,79	VAR / PL: 4,2120%
VAR: 4.240.363,61	ETL / PL: 5,2821%
ETL: 5.317.597,04	VAR / CDI: 0,0461%
Limite Fundo: 0,00%	Dutacion DC: 3,00
Status: ENQUADRADO	Dutacion DU: 1,00
Benchmark:	

Cenários de STRESS			
Cenário Alta - 09999 (+): 29.114.986,37	Cenário Baixa - 10000 (+): 178,38	CENARIO BRADESCO 1 (+): 13.925.520,82	CENARIO BRADESCO 2 (+): 0,00
Cenário Alta - 09999 (-): -174,89	Cenário Baixa - 10000 (-): -27.642.598,26	CENARIO BRADESCO 1 (-): 0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-): -14.039.823,85
Cenário Alta - 09999: 29.114.811,48	Cenário Baixa - 10000: -27.642.419,89	CENARIO BRADESCO 1: 13.925.520,82	CENARIO BRADESCO 2: -14.039.823,85

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
AURE3	2.488.785,54	201.225,14	-2.662,90	-0,05%	822.196,39	-771.544,36	364.855,96	-367.842,50
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	6.104.064,25	57,07	22,99	0,00%	-174,89	178,38	613,22	-933,38
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-418.176,80	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPLE3	2.339.729,04	151.693,64	74.079,92	1,75%	514.740,39	-514.740,39	343.004,28	-345.811,95
CPLE6	4.749.675,36	323.077,04	150.112,46	3,54%	1.044.928,58	-1.044.928,58	696.302,41	-702.002,02
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ENGH1	10.279.950,45	545.744,54	157.560,82	3,72%	1.747.591,58	-2.261.589,10	1.507.040,74	-1.519.376,68
ENGH4	15,58	0,87	0,32	0,00%	12,46	-12,46	2,28	-2,30
EQTL3	10.411.521,39	419.248,04	213.773,94	5,04%	2.082.304,28	-2.082.304,28	1.526.329,04	-1.538.822,86
EQTL9	138.784,04	4.610,05	3.057,19	0,07%	0,00	0,00	20.345,74	-20.512,28
GGPS3	5.990.589,18	523.015,53	389.129,93	9,18%	2.695.765,13	-2.695.765,13	878.220,37	-885.409,08
GMAT3	8.208.094,90	1.036.445,31	896.603,00	21,14%	1.477.457,01	-1.313.295,12	1.203.306,65	-1.213.196,37
HAPV3	6.243.691,65	1.229.505,12	548.760,20	12,94%	2.122.855,16	-2.122.855,16	915.325,20	-922.817,63
ITUB4	5.438.690,16	353.208,00	262.825,61	6,20%	1.067.738,03	-1.033.351,13	797.311,98	-803.838,41
MATD3	761.001,88	98.481,32	15.438,13	0,36%	228.300,56	-228.300,56	111.562,88	-112.476,08
MULT3	4.969.166,20	260.351,99	165.084,64	3,89%	1.490.749,86	-1.242.291,55	728.479,77	-734.442,76
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PRI03	11.172.784,32	1.756.037,89	489.756,15	11,55%	6.703.670,59	-6.703.670,59	1.637.930,18	-1.651.337,52
RAIL3	9.241.821,90	504.266,63	350.979,32	8,28%	4.158.819,86	-3.049.848,12	1.354.851,09	-1.365.941,28
UGPA3	11.195.095,24	987.253,63	442.989,40	10,45%	2.798.773,81	-2.239.019,05	1.641.200,96	-1.654.635,08
VBBR3	1.356.330,72	114.529,88	82.852,49	1,95%	339.082,68	-339.082,68	198.838,08	-200.465,68
Total Var:	100.672.614,60	8.508.752,68	4.240.363,61	100,00%	29.114.811,48	-27.642.419,89	13.925.520,83	-14.039.823,85

Relatório de Risco de Mercado



Data: 31/05/2024

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

Dados Gerais	
PL:	111.993.462,42
VAR:	3.719.548,27
ETL:	4.664.463,99
VAR / PL:	3,3212%
ETL / PL:	4,1649%
VAR / CDI:	0,0364%
Limite Fundo:	0,00%
Status:	ENQUADRADO
Benchmark:	Dutacion DC: 7,71 Dutacion DU: 4,28

Cenários de STRESS			
Cenário Alta - 09999 (+):	28.747.619,81	Cenário Baixa - 10000 (+):	5.653,23
Cenário Alta - 09999 (-):	-4.148,02	Cenário Baixa - 10000 (-):	-29.322.306,05
Cenário Alta - 09999:	28.743.471,79	Cenário Baixa - 10000:	-29.316.652,82
CENARIO BRADESCO 1 (+):	16.315.539,85	CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00
CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-16.448.851,58
CENARIO BRADESCO 1:	16.315.539,85	CENARIO BRADESCO 2:	-16.448.851,58

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
TAEF11	402.447,20	19.625,93	4.653,56	0,12%	100.611,80	-100.611,80	58.998,76	-59.481,70
TIMS3	688.244,70	52.433,77	14.170,74	0,38%	220.238,30	-158.296,28	100.896,67	-101.722,57
TOTS3	793.102,80	80.138,15	39.582,94	1,06%	158.620,56	-158.620,56	116.268,87	-117.220,59
TRPL4	534.263,80	43.658,87	4.432,58	0,12%	106.852,76	-133.565,95	78.323,07	-78.964,19
UGPA3	1.353.081,66	119.323,22	-138,92	0,00%	338.270,42	-270.616,33	198.361,77	-199.965,47
USIM5	209.454,33	45.597,80	-23.742,88	-0,64%	81.687,19	-46.079,95	30.706,01	-30.957,35
VALE3	15.028.644,00	1.318.765,85	739.727,52	19,89%	3.757.161,00	-3.757.161,00	2.203.199,21	-2.221.233,58
VAM03	217.307,45	42.593,46	11.144,96	0,30%	76.054,93	-86.922,98	31.857,27	-32.118,04
VBBR3	1.289.578,26	108.893,23	32.749,90	0,88%	322.394,57	-322.394,57	189.052,17	-190.699,67
VVA3	147.433,40	29.563,10	14.805,40	0,40%	44.230,02	-44.230,02	21.613,74	-21.790,66
VVIT3	949.698,90	60.891,62	2.580,69	0,07%	142.454,84	-142.454,84	139.225,86	-140.365,50
WEGE3	2.989.317,95	235.104,42	58.153,58	1,56%	747.329,49	-747.329,49	438.234,01	-441.821,19
YDUQ3	188.213,62	31.575,69	15.770,40	0,42%	73.403,31	-47.053,41	27.592,12	-27.817,97
Total Var:	111.992.754,45	11.037.048,62	3.719.548,27	100,00%	28.743.471,79	-29.316.652,82	16.315.539,85	-16.448.851,58

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 – MAIO 2024



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/05/2024

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	671.951,14	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	248.658,22	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	149.194,93	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	20/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	497.146,68	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB II	25/08/17	25/08/17	15/08/24	PETR	9.685.554,76	AAA	Aaa.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	18/12/17	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	2.927.183,71	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	21/12/17	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	854.441,06	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/01/18	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	3.033.357,79	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB II	19/02/18	19/02/18	15/02/25	SABESP	4.888.466,59	brAAA	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/02/18	19/02/18	15/02/25	SABESP	3.033.827,54	brAAA	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	13/03/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	13.096.089,78	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB II	23/05/18	23/05/18	15/05/28	COMGAS	25.892.227,88	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	644.898,60	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	644.898,60	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	644.898,60	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	643.718,24	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	644.898,60	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	04/07/18	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	13.264.399,46	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/07/18	26/07/18	15/07/25	AEGEA SA	15.256.860,91	brA	Aa1.br	AA(bra)
FI RF EMB II	26/07/18	26/07/18	15/07/25	CSMG	8.263.010,91	-	Aa3.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/02/13	15/02/25	CEMIG	694.358,50	brA+	A1.br	AA-(bra)
FIM EMB IA	12/02/19	09/01/19	15/01/25	ITAUUBB	2.604.761,27	-	AAA.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	563.843,84	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	3.570.107,39	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	2.033.090,77	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	6.146.711,09	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	751.534,46	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	6.080.597,01	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	9.018.413,54	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	929.169,88	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	616.704,20	-	-	AA(bra)
FIM EMB IA	30/09/20	28/09/20	22/09/25	HAPVIDA	172.108,16	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB II A CRED PRIV	05/02/21	07/08/19	15/07/24	COPEL GT	148.213,88	-	-	AA+(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	6.352.183,52	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	6.364.056,96	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	4.406.161,51	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/07/19	15/06/29	NEOENERG	655.406,90	brAA+	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/07/19	15/06/29	NEOENERG	6.515.071,63	brAA+	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	1.824.572,40	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	3.497.030,04	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	3.741.472,94	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	31/07/20	15/07/34	IGUA SAN	2.673.760,83	brAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	23/05/18	15/05/28	COMGAS	22.549.281,92	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	250.156,35	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	440.275,18	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	500.312,71	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	250.156,35	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	306.191,38	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	258.185,80	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	749.088,38	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	26/10/16	27/01/25	BRADESCO	15.179.026,75	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	12/12/17	15/11/24	CCR	3.185.318,90	brAAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	14/12/17	15/11/24	ECORODOV	2.184.226,44	brAA	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	19/02/18	15/02/25	SABESP	712.491,53	brAAA	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	23/05/18	15/05/28	COMGAS	10.021.782,35	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	28/06/18	15/06/27	JAGUARA	1.643.423,68	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	28/06/18	15/06/27	ENERGMIR	1.047.857,91	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	31/07/18	01/08/25	BRADESCO	4.888.166,81	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	194.394,32	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	22/12/20	15/12/26	IRB	2.785.689,05	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	895.292,47	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	1.433.079,60	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	07/04/21	15/03/31	LOCALIZA	5.481.919,46	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	1.757.897,09	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/06/21	06/01/21	15/11/25	QUATA	579.904,28	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	19.398,22	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	209.637,03	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	523.751,88	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	329.071,96	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	329.071,96	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	250.097,62	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	508.328,50	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	500.703,57	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	851.433,60	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	212.610,60	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	130.937,97	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	327.691,32	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	986.538,77	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	14/06/21	19/06/19	19/06/24	BNBBM	601.756,24	brAAA	AAbr	AA(bra)

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – MAIO 2024



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/05/2024

Fundo	INFORMAÇÕES DOS ATIVOS					INFORMAÇÕES DE RATING		
	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	14/06/21	12/06/19	12/06/24	BNBBM	911.857,49	brAAA	AAbr	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	16/06/21	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	377.248,60	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	17/06/21	18/03/21	15/02/26	CORSAN	520.635,08	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	18/06/21	18/06/21	15/12/30	MG050	534.813,37	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	820.873,10	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	93.780,99	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	25/06/21	25/06/21	20/06/26	OURO VER	1.498.028,12	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	3.473.369,96	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	01/07/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	3.038.040,92	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/07/21	01/03/21	18/02/25	RENNER	570.635,22	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/07/21	01/03/21	18/02/25	RENNER	120.681,29	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/07/21	07/04/21	15/03/29	CAGECE	1.273.542,36	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	08/07/21	08/07/21	15/06/31	VAMOS	273.166,63	brAAA	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/07/21	07/04/21	15/03/29	CAGECE	2.902.464,79	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	12/07/21	12/07/21	12/07/26	BRADESCO	4.554.915,63	brAAA	Aa1.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	2.188.041,22	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	242.098,45	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	1.062.762,88	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	552.636,70	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	2.036.966,23	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	318.425,05	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	4.376.082,45	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	376.601,51	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	376.601,51	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	1.342.666,26	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	862.652,32	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/07/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	2.089.015,76	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/07/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	765.481,75	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.100.663,91	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	889.040,41	-	-	AA-(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	20/09/19	20/08/26	VAMOS	1.060.293,51	brAAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	23/07/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.604.440,10	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/07/21	07/11/19	15/10/24	BKBR	1.027.366,85	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/07/21	23/12/20	15/12/26	RD COLIN	2.190.579,93	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	04/08/21	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	372.281,06	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	06/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	672.424,48	brAAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	11/08/21	11/08/21	15/08/31	CSAN	1.063.882,83	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	11/08/21	19/11/19	15/06/27	AUTOPIST	1.161.557,94	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	17/08/21	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	2.808.498,90	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	18/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	1.247.260,51	brAAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	18/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	967.863,46	brAAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	27/08/21	27/08/21	20/08/31	S LUIZ A	1.049.711,11	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	696.676,57	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	62.388,95	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	311.944,73	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/06/19	15/06/24	PROLAGOS	1.160.810,66	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	12/05/21	15/04/26	ELETROB	2.009.459,61	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/09/21	22/10/19	21/10/26	AUTOBAN	453.874,92	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/09/21	20/09/21	15/09/29	MOV_PART	1.051.573,23	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.069.626,74	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.069.626,74	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	1.112.221,74	brAAA	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	827.559,73	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	854.106,28	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	283.932,63	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	283.932,63	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	789.209,64	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	789.209,64	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	1.014.140,88	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	393.954,73	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	393.954,73	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	23/09/21	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	4.110.872,43	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	23/09/21	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	4.368.621,08	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	30/09/21	30/09/21	15/09/31	SIMPAN	873.131,75	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	04/10/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	660.393,02	brAAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/10/21	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	2.586.163,80	-	-	AA-(bra)
FIM EMB I A	20/10/21	20/10/21	20/10/25	DAYCOVAL	2.917.698,37	brAAA	AA.br	AA(bra)
FIM EMB I A	20/10/21	20/10/21	20/10/24	DAYCOVAL	1.611.669,11	brAAA	AA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/10/21	22/10/21	15/12/35	CART	2.427.168,18	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	22/10/21	22/10/21	15/12/35	CART	911.668,05	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	25/10/21	22/04/21	15/03/26	VIX LOGI	115.390,22	-	-	A-(bra)
FIM EMB I A	27/10/21	27/10/21	15/10/29	CONT GLO	1.910.043,77	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/10/21	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	882.419,00	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	04/11/21	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	3.368.257,19	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/11/21	10/11/21	15/10/28	LIGHT	361.250,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	12/11/21	12/11/21	15/10/31	VAMOS	2.140.859,09	brAAA	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/11/21	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	12.334,02	-	-	AA(bra)

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – MAIO 2024



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/05/2024

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	26/11/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	2.246.712,11	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/11/21	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	2.400.200,69	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	03/12/21	11/06/19	11/06/24	BNBBM	602.162,67	brAAA	AAbr	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/12/21	06/12/21	15/12/35	TESC	2.834.030,39	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/12/21	06/01/21	15/11/25	QUATA	2.597.566,90	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	20/12/21	20/12/21	15/11/35	ORIZON	2.165.598,10	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/01/22	22/04/21	15/03/26	VIX LOGI	664.011,99	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/01/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	378.634,14	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/01/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	2.251.793,93	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	378.875,03	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	367.035,19	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	3.060.654,47	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	876.148,52	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	781.429,76	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/03/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	1.101.428,17	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	19/04/22	19/04/22	16/04/29	VERT-10	363.144,84	-	-	AAAs(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	26/04/22	26/04/22	15/04/50	LIGHT	994.500,40	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	-	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	682.793,41	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	12/05/22	12/05/22	15/04/27	BRKA	1.912.160,21	-	A+ br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	12/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.476.617,24	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	26/05/22	26/05/22	10/05/27	GUAR	2.488.682,41	-	-	A
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	2.518.884,13	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	560.559,43	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.135.657,67	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	03/03/22	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	3.408.569,01	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/03/22	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	2.494.726,14	brAAA	A2 br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/03/22	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	1.113.324,64	brAAA	A2 br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/03/22	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	3.445.346,50	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/03/22	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	2.757.753,62	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/06/22	06/12/21	15/12/35	TESC	881.994,90	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	448.447,54	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	06/12/21	15/12/35	TESC	553.218,26	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	281.215,70	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	13/06/22	30/09/21	15/09/31	SIMPAR	1.879.530,98	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	13/06/22	08/07/21	15/06/31	VAMOS	930.067,32	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	13/06/22	08/07/21	15/06/31	VAMOS	75.879,62	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	13/06/22	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	739.547,96	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	13/06/22	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	836.278,37	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/06/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	1.382.014,62	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	27/06/22	27/06/22	07/07/24	LAGE	2.569.196,95	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	3.388.775,57	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	12/11/21	15/10/31	VAMOS	2.070.210,74	brAA+	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	12/11/21	15/10/31	VAMOS	1.552.122,84	brAA+	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	27/07/22	25/03/22	15/03/44	GBS PART	-	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	28/07/22	28/07/22	18/07/25	1V11	1.713.108,71	-	AAA br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	29/07/22	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	1.880.148,76	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/08/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	1.263,41	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	460.165,07	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	07/04/21	15/03/29	CAGECE	1.574.158,94	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	07/04/21	15/03/29	CAGECE	2.622.821,45	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	02/09/22	02/09/22	02/09/29	AEGEA SA	1.749.073,58	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	27/09/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	54.326,55	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	28/09/22	28/09/22	28/09/27	B.BRASIL	4.739.928,53	-	AAA br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/10/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	37.902,24	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	03/11/22	06/04/21	15/03/29	ANET	1.744.853,58	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/11/22	08/11/22	15/06/42	BRK AMBI	5.540.654,26	-	AA- br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/11/22	02/05/22	15/04/38	RDVE	1.854.989,24	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	11/11/22	11/11/22	15/10/40	RAHOLD	2.792.440,66	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	11/11/22	11/11/22	15/10/40	RAHOLD	7.265.789,07	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	4.008.279,94	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	1.804.331,46	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	1.477.372,06	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.456.173,52	-	Aa3 br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.772.585,05	-	Aa3 br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.451.637,15	-	Aa3 br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	01/12/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	1.744.030,71	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	2.156.050,80	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	2.287.230,18	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	1.668.332,60	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/12/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	3.095.409,15	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	15/12/21	15/11/36	ITAPOA T	1.301.457,30	-	AA br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	02/05/22	15/04/38	RDVE	2.146.685,98	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	3.277.149,65	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	26/01/23	26/01/23	20/01/26	CELG	2.440.938,72	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/03/23	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	307.404,67	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	1.254.711,52	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	15/12/21	15/11/36	ITAPOA T	3.951.443,18	-	AA br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	27/07/22	15/04/36	BRV_VDR	9.224.204,67	-	A br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	17/04/23	17/04/23	17/03/30	VERO	2.999.783,57	brA+	-	-



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/05/2024

Fundo	INFORMAÇÕES DOS ATIVOS					INFORMAÇÕES DE RATING			
	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/04/23	12/05/22	15/04/27	BRKA	1.135.566,32	-	A+.br	-	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/04/23	12/05/22	15/04/27	BRKA	31.346,89	-	A+.br	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/04/23	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	2.251.729,75	brAAA	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	1.920.395,66	-	-	AAA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	2.284.788,82	brAAA	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	18/06/21	15/12/30	MG050	3.244.177,89	brAAA+	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	08/11/22	15/06/42	BRK AMBI	1.390.873,72	-	AA-.br	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	08/07/21	15/06/31	VAMOS	1.068.818,62	brAAA+	-	AAA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	781.802,42	brAAA	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	22/10/21	15/12/35	CART	1.562.859,51	brAAA+	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	2.404.389,39	brAAA+	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	02/10/20	15/09/34	BRKA	301.668,35	-	Aa3.br	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	02/10/20	15/09/34	BRKA	2.879.458,38	-	Aa3.br	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	18/03/21	15/02/31	CORSAN	1.628.572,92	-	-	AA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	22/10/21	15/12/35	CART	674.871,15	brAAA+	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	10/02/21	15/12/31	METRORIO	5.275.123,23	brAAA	-	AA-(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/05/23	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	222.050,39	brAAA	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/05/23	08/11/22	15/06/42	BRK AMBI	2.433.127,41	-	AA-.br	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/05/23	22/10/21	15/12/35	CART	2.225.890,82	brAAA+	-	-	
FIM EMB IA	16/05/23	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.143.126,06	-	-	AAA(bra)	
FIM EMB IA	16/05/23	23/12/20	15/12/27	SABESP	2.389.677,77	brAAA	-	-	
FIM EMB IA	16/05/23	21/07/21	15/07/31	CACHOEIR	1.853.271,09	brAAA	-	-	
FIM EMB IA	16/05/23	29/10/21	15/10/26	COELBA	1.846.054,08	brAAA	-	-	
FIM EMB IA	16/05/23	04/05/22	15/04/27	LOCALIZA	2.858.611,64	-	-	AAA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/05/23	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	59.830,88	brA	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/06/23	25/06/21	20/06/26	OURO VER	300.451,97	-	-	AA-(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/06/23	25/03/22	15/03/44	GBS PART	314.579,53	-	-	AAA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/06/23	26/07/21	15/06/33	ASA BRAN	2.792.955,16	-	-	AA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	23/06/23	23/06/23	15/05/43	IGUA RJ	1.374.970,00	brAAA+	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/06/23	08/07/21	15/06/31	VAMOS	1.072.070,60	brAAA+	-	AAA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/06/23	28/07/22	18/07/25	1V11	388.723,75	-	AAA.br	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/07/23	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	1.037.525,18	-	-	AAA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/07/23	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	1.037.525,18	-	-	AAA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/07/23	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	660.355,69	brA	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/07/23	28/07/22	18/07/25	1V11	1.178.744,52	-	AAA.br	-	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/07/23	28/07/22	18/07/25	1V11	288.137,55	-	AAA.br	-	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/07/23	23/12/20	15/12/26	RD COLIN	1.632.175,71	brAAA+	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	1.551.330,00	brAAA	A2.br	AA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	1.551.330,00	brAAA	A2.br	AA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	15/12/21	15/11/36	ITAPOA T	2.557.115,52	-	AA.br	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	26/07/21	15/06/33	ASA BRAN	2.749.091,75	-	-	AA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	01/08/23	31/07/23	25/07/28	TIMSA	2.584.224,79	-	-	AAA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/23	17/04/23	17/03/30	VERO	1.324.268,09	brA+	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/23	06/12/21	15/12/35	TESC	2.070.928,89	-	-	A+(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/23	02/05/22	15/04/38	RDVE	3.192.248,33	-	-	A2(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/08/23	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.226.932,97	-	-	AAA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/08/23	05/06/18	05/06/28	BRADESCO	4.222.498,26	brAAA	AAA.br	AAA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/08/23	08/08/23	15/01/34	SPERIO4	2.444.026,26	brAAA+	-	-	
FIRF EMB II A CRED PRIV	29/08/23	29/08/23	29/08/25	BRADESCO	10.972.134,21	brAAA	AAA.br	AAA(bra)	
FIRF EMB II A CRED PRIV	30/08/23	30/08/23	01/09/25	VOLKSWAG	6.578.641,64	brAAA	AAA.br	-	
FIRF EMB II A CRED PRIV	08/09/23	08/09/23	08/09/25	B VOTORA	6.564.702,62	brAAA	AA.br	AAA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/09/23	06/01/21	15/11/25	QUATA	2.526,82	-	-	A(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	19/09/23	13/09/23	15/09/25	PANAMERI	5.414.154,61	brAAA	AAA.br	AAA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/09/23	21/09/23	15/09/28	ELETROB	2.630.319,55	brAAA	-	AA-(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/09/23	28/09/23	15/09/30	CSMG	2.602.318,59	-	AAA.br	-	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/09/23	19/05/21	10/05/30	RODO BR	2.512.435,52	-	-	AA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/09/23	06/09/21	20/08/31	S LUIZ A	1.499.228,45	-	-	AAA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/09/23	13/09/23	15/09/25	B VOTORA	5.407.430,63	brAAA	AA.br	AAA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/10/23	14/11/22	10/10/31	CORREDOR	2.315.804,23	-	-	AAA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/10/23	20/10/23	20/10/28	SANTANDER	4.288.663,27	-	AAA.br	A-(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/11/23	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	3.055.850,44	brAAA	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/11/23	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	3.111.449,40	brAAA	A2.br	AA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/11/23	18/03/21	15/02/31	CORSAN	3.040.156,67	-	-	AA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/11/23	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	3.114.265,82	-	-	AAA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/11/23	18/06/21	15/12/30	MG050	973.360,33	brAAA+	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	17/11/23	23/08/22	15/08/32	PETRJ	4.604.459,06	brAAA	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	23/11/23	29/09/22	15/09/28	VERT5	2.515.005,39	-	-	AAA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	23/11/23	10/12/21	17/11/28	DESKTOP	2.569.699,49	-	A.br	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/12/23	12/02/21	15/12/35	MS 306	1.083.691,43	-	A.br	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/12/23	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.026.352,83	-	Aa3.br	-	
FIRF EMB II A CRED PRIV	26/12/23	27/12/22	02/06/26	BRADESCO	10.568.817,88	brAAA	AAA.br	AAA(bra)	
FIRF EMB II A CRED PRIV	08/01/24	08/01/24	08/01/26	DAYCOVAL	10.473.372,30	brAAA+	AA.br	AA(bra)	
FIRF EMB II A CRED PRIV	08/01/24	08/01/24	08/01/26	B.ALFA	10.480.651,32	-	AAA.br	AA+(bra)	
FIRF EMB II A CRED PRIV	08/01/24	08/01/24	08/01/26	ABC	10.497.977,64	brAAA	AA+.br	AAA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	17/04/23	17/03/30	VERO	2.909.244,65	brA+	-	-	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	2.156.226,55	-	-	AA-(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	2.156.226,55	-	-	AA-(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	25/03/22	15/03/44	GBS PART	2.068.530,13	-	-	AAA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	25/03/22	15/03/44	GBS PART	2.042.503,77	-	-	AAA(bra)	
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	967.265,96	brA	-	-	



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/05/2024

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	09/01/24	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	1.935.639,90	brA	-	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	11/01/24	27/12/22	02/06/26	BRADESCO	11.110.929,30	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	18/01/24	18/01/24	04/01/27	TOYOTA	6.434.840,19	brAAA	-	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	24/01/24	24/01/24	26/01/26	ABC	10.441.296,38	brAAA	AA+.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	24/01/24	24/01/24	25/01/27	BTG PACT	4.448.132,61	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	25/01/24	25/01/24	26/01/26	BTG PACT	6.678.587,26	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/01/24	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	1.079.863,13	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/01/24	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.272.747,40	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/01/24	22/04/21	15/03/26	VIX LOGI	1.332.169,74	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	30/01/24	28/04/21	15/04/31	MANAUSEN	2.402.912,08	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	30/01/24	01/06/23	25/05/26	LM TRANS	2.522.405,01	-	AA+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	30/01/24	27/10/21	15/10/29	CONT GLO	2.423.422,04	-	-	AA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	31/01/24	31/01/24	02/02/26	B.ALFA	11.025.225,57	-	AAA.br	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/02/24	08/02/24	15/09/31	PLANALTO	3.057.280,47	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	15/02/24	15/02/24	15/12/43	AGUAS SE	2.175.104,78	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/02/24	12/11/21	30/04/29	HAPVIDA	541.368,70	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/02/24	18/03/21	15/02/26	CORSAN	1.306.794,04	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/02/24	19/05/22	13/05/28	CEA MODA	1.392.394,51	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/02/24	07/11/19	15/10/24	BKBR	1.496.558,01	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/02/24	19/04/22	16/04/29	VERT-10	1.408.429,92	-	-	AAAsf(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/02/24	07/04/21	15/03/26	CAGECE	2.500.573,18	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/02/24	24/03/22	11/03/27	ARTERIS	2.521.003,12	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/02/24	16/02/24	15/02/34	NTRASSUD	2.670.498,72	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	285.858,67	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	18/06/21	15/12/30	MG050	304.843,62	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	02/05/22	15/04/38	RDVE	806.901,38	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	811.343,67	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	285.858,67	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	12/02/21	15/12/35	MS 306	318.392,25	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	1.022.952,59	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	511.476,29	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	10/02/21	15/12/31	METRORIO	507.994,63	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	15/12/21	15/11/36	ITAPOA T	398.197,59	-	AA.br	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	26/02/24	26/02/24	01/03/27	BTG PACT	10.918.646,01	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	05/03/24	05/03/24	24/08/26	B VOTORA	6.680.448,38	brAAA	AA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	12/03/24	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	2.037.961,73	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/03/24	23/06/23	15/05/43	IGUA RJ	1.219.140,07	brAA+	-	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	05/04/24	05/04/24	06/04/26	PSA	6.601.782,81	-	Aaa.br	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	16/05/24	16/05/24	18/05/26	BANSICRE	3.314.357,64	brAAA	AAA.br	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/05/24	10/11/21	30/10/31	DASA	1.553.359,98	-	-	AA(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	VERDECARD FIDC SN6	933.785,92	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	FIDC VERDECARD SN8	1.375.637,34	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	RB CAP CREDIT AL SN3	567.254,77	brAA-(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	INSS CONS PDL I FIDC	914.131,03	-	-	AAAsf(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	-	-	-	DRIVER SIX FIDC SN	915.918,04	-	AAA.br	-

Observação: Em maio 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 **4.913.604.628,11**

Tópico do Enquadramento	Limite	Aplicação Atual	Valor Limite	% Aplicado	Status
% do Segmento RF/PL PLANO	100,00%	4.330.189.774,39	4.913.604.628,11	88,13%	Enquadrado
% do PL em Títulos de Emissão do Tesouro Nacional e/ou do BACEN	100,00%	3.497.259.719,36	4.913.604.628,11	71,18%	Enquadrado
% do PL em Títulos RF1, exceto títulos do Tesouro Nacional	80,00%	832.930.055,02	3.930.883.761,06	16,95%	Enquadrado
% do PL em FIDC	20,00%	Verificar Rel. de Diversificação de FIDC's	982.720.940,27	0,00%	Enquadrado
% do PL em uma mesma pessoa jurídica não-financeira	10,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Não Financ.	491.360.470,13	0,00%	Enquadrado
% do PL em Instituições Financeiras	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Financ.	1.228.401.157,03	0,00%	Enquadrado
% de uma mesma Série de Debêntures	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Debêntures	1.228.401.157,03	0,00%	Enquadrado
% do PL em RV	70,00%	473.575.493,28	3.439.523.181,10	9,64%	Enquadrado
% do capital votante de uma empresa	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação RV	1.228.401.157,03	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Imobiliários	20,00%	78.304.632,10	982.720.940,27	1,59%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Empréstimos	15,00%	25.698.019,54	737.040.723,50	0,52%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Estruturados	20,00%	0,00	982.720.940,27	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos no Exterior	10,00%	0,00	491.360.470,13	0,00%	Enquadrado

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

6.2. Relatório de Túnel de Preços

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE MAIO DE 2024 À 31 DE MAIO DE 2024



FIM EMB I A		FONTE ANBIMA										
DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
06/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	6,1595%	6,2157%	6,0201%	6,3263%	-0,0562%	NÃO
08/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2024	Compra	7,8391%	9,2187%	7,1759%	10,2850%	-1,3796%	NÃO
08/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2024	Compra	7,8091%	9,2187%	7,1759%	10,2850%	-1,4096%	NÃO
08/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2024	Compra	7,8291%	9,2187%	7,1759%	10,2850%	-1,3896%	NÃO
08/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2024	Compra	7,8391%	9,2187%	7,1759%	10,2850%	-1,3796%	NÃO
08/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2024	Compra	7,8291%	9,2187%	7,1759%	10,2850%	-1,3896%	NÃO
08/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2024	Compra	7,7991%	9,2187%	7,1759%	10,2850%	-1,4196%	NÃO
08/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2024	Compra	7,8391%	9,2187%	7,1759%	10,2850%	-1,3796%	NÃO
08/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2024	Compra	7,8291%	9,2187%	7,1759%	10,2850%	-1,3896%	NÃO
08/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2024	Compra	7,7991%	9,2187%	7,1759%	10,2850%	-1,4196%	NÃO
08/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2024	Compra	7,7991%	9,2187%	7,1759%	10,2850%	-1,4196%	NÃO
08/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2024	Compra	7,8091%	9,2187%	7,1759%	10,2850%	-1,4096%	NÃO
08/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2024	Compra	7,8091%	9,2187%	7,1759%	10,2850%	-1,4096%	NÃO
08/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	6,1795%	6,1742%	6,0244%	6,3460%	0,0053%	NÃO
08/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	6,1795%	6,1742%	6,0244%	6,3460%	0,0053%	NÃO
10/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2024	Venda	9,0914%	9,3993%	8,4967%	10,2445%	-0,3079%	NÃO
10/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2024	Venda	9,0512%	9,3993%	8,4967%	10,2445%	-0,3481%	NÃO
10/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2024	Venda	9,0512%	9,3993%	8,4967%	10,2445%	-0,3481%	NÃO
10/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2024	Venda	9,0512%	9,3993%	8,4967%	10,2445%	-0,3481%	NÃO
10/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2024	Venda	9,0512%	9,3993%	8,4967%	10,2445%	-0,3481%	NÃO
10/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2024	Venda	9,0613%	9,3993%	8,4967%	10,2445%	-0,3380%	NÃO
10/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2024	Venda	9,0613%	9,3993%	8,4967%	10,2445%	-0,3380%	NÃO
10/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2024	Venda	9,0613%	9,3993%	8,4967%	10,2445%	-0,3380%	NÃO
10/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2024	Venda	9,0613%	9,3993%	8,4967%	10,2445%	-0,3380%	NÃO
10/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2024	Venda	9,0914%	9,3993%	8,4967%	10,2445%	-0,3079%	NÃO
10/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2024	Venda	9,0914%	9,3993%	8,4967%	10,2445%	-0,3079%	NÃO
10/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2024	Venda	9,1811%	9,3993%	8,4967%	10,2445%	-0,2182%	NÃO
10/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2024	Venda	9,1811%	9,3993%	8,4967%	10,2445%	-0,2182%	NÃO
10/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2024	Venda	9,1811%	9,3993%	8,4967%	10,2445%	-0,2182%	NÃO
10/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2024	Venda	9,1811%	9,3993%	8,4967%	10,2445%	-0,2182%	NÃO
10/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2024	Venda	9,1811%	9,3993%	8,4967%	10,2445%	-0,2182%	NÃO
10/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2024	Venda	9,1811%	9,3993%	8,4967%	10,2445%	-0,2182%	NÃO
10/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2024	Venda	9,1811%	9,3993%	8,4967%	10,2445%	-0,2182%	NÃO
10/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2024	Venda	9,1811%	9,3993%	8,4967%	10,2445%	-0,2182%	NÃO
10/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2024	Venda	9,1811%	9,3993%	8,4967%	10,2445%	-0,2182%	NÃO
10/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2024	Venda	9,1811%	9,3993%	8,4967%	10,2445%	-0,2182%	NÃO
10/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2024	Venda	9,1811%	9,3993%	8,4967%	10,2445%	-0,2182%	NÃO
10/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2024	Venda	9,1811%	9,3993%	8,4967%	10,2445%	-0,2182%	NÃO
10/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	6,1495%	6,1842%	6,0045%	6,3105%	-0,0347%	NÃO
10/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	6,1495%	6,1842%	6,0045%	6,3105%	-0,0347%	NÃO
13/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1842%	6,1926%	6,0353%	6,3413%	-0,0084%	NÃO
13/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1842%	6,1926%	6,0353%	6,3413%	-0,0084%	NÃO
13/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1842%	6,1926%	6,0353%	6,3413%	-0,0084%	NÃO
20/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1305%	6,1541%	5,9913%	6,2553%	-0,0236%	NÃO
20/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1305%	6,1541%	5,9913%	6,2553%	-0,0236%	NÃO
20/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1305%	6,1541%	5,9913%	6,2553%	-0,0236%	NÃO
20/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1305%	6,1541%	5,9913%	6,2553%	-0,0236%	NÃO
20/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1305%	6,1541%	5,9913%	6,2553%	-0,0236%	NÃO
22/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1605%	6,1796%	6,0077%	6,2717%	-0,0191%	NÃO
22/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1605%	6,1796%	6,0077%	6,2717%	-0,0191%	NÃO
22/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1605%	6,1796%	6,0077%	6,2717%	-0,0191%	NÃO
27/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1705%	6,1943%	6,0210%	6,2853%	-0,0238%	NÃO
27/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1705%	6,1943%	6,0210%	6,2853%	-0,0238%	NÃO
27/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,1705%	6,1943%	6,0210%	6,2853%	-0,0238%	NÃO
28/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	6,1895%	6,1822%	6,0452%	6,3094%	0,0073%	NÃO
28/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	6,1895%	6,1822%	6,0452%	6,3094%	0,0073%	NÃO
29/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2024	Compra	8,9992%	9,0383%	8,3404%	10,1297%	-0,0391%	NÃO
31/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,2105%	6,1782%	6,0607%	6,3252%	0,0323%	NÃO
31/05/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,2105%	6,1782%	6,0607%	6,3252%	0,0323%	NÃO

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – MAIO 2024

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE MAIO DE 2024 À 31 DE MAIO DE 2024



FIRF EMB II A CRED PRIV

DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	FONTE ANBIMA				FORA DO TÚNEL
								TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	
06/05/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	LFT	01/03/2030	Venda	0,1763%	0,1760%	0,1601%	0,1851%	0,0003%	NÃO
14/05/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2028	Compra	6,0978%	6,1135%	5,9153%	6,3465%	-0,0157%	NÃO
14/05/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2028	Compra	6,0978%	6,1135%	5,9153%	6,3465%	-0,0157%	NÃO
15/05/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2024	Venda	8,8857%	9,1034%	8,4583%	10,2397%	-0,2177%	NÃO
15/05/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2024	Venda	8,8857%	9,1034%	8,4583%	10,2397%	-0,2177%	NÃO
15/05/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2027	Compra	6,0644%	6,0731%	5,8673%	6,3014%	-0,0087%	NÃO
15/05/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2027	Compra	6,0925%	6,0731%	5,8673%	6,3014%	0,0194%	NÃO
15/05/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2028	Compra	6,1135%	6,0900%	5,8989%	6,3301%	0,0235%	NÃO
15/05/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2028	Compra	6,1135%	6,0900%	5,8989%	6,3301%	0,0235%	NÃO
15/05/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2028	Compra	6,0778%	6,0900%	5,8989%	6,3301%	-0,0122%	NÃO
15/05/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2029	Compra	6,0694%	6,0839%	5,8991%	6,3277%	-0,0145%	NÃO
16/05/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	LFT	01/03/2030	Venda	0,1675%	0,1740%	0,1619%	0,1831%	-0,0065%	NÃO
16/05/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	LFT	01/03/2030	Venda	0,1675%	0,1740%	0,1619%	0,1831%	-0,0065%	NÃO
16/05/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2050	Compra	6,1595%	6,1226%	6,0240%	6,3299%	0,0369%	NÃO
22/05/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	LTN	01/07/2026	Venda	11,0011%	11,0447%	10,4868%	11,1505%	-0,0436%	NÃO

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE MAIO DE 2024 À 31 DE MAIO DE 2024



FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO

DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	FONTE ANBIMA				FORA DO TÚNEL
								TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	
23/05/2024	FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	ICATU VA	RENASCEN	NTN-B	15/08/2026	Venda	6,1610%	6,1700%	5,9098%	6,3489%	-0,0090%	NÃO
23/05/2024	FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	ICATU VA	RENASCEN	NTN-B	15/08/2026	Venda	6,1610%	6,1700%	5,9098%	6,3489%	-0,0090%	NÃO
23/05/2024	FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	ICATU VA	RENASCEN	NTN-B	15/08/2026	Venda	6,1610%	6,1700%	5,9098%	6,3489%	-0,0090%	NÃO
23/05/2024	FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	ICATU VA	RENASCEN	NTN-B	15/08/2026	Venda	6,1610%	6,1700%	5,9098%	6,3489%	-0,0090%	NÃO
23/05/2024	FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	ICATU VA	GUIDE CT	NTN-B	15/08/2028	Venda	6,1810%	6,1536%	5,9811%	6,3368%	0,0274%	NÃO
23/05/2024	FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	ICATU VA	GUIDE CT	NTN-B	15/08/2028	Venda	6,1810%	6,1536%	5,9811%	6,3368%	0,0274%	NÃO
23/05/2024	FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	ICATU VA	GUIDE CT	NTN-B	15/08/2028	Venda	6,1810%	6,1536%	5,9811%	6,3368%	0,0274%	NÃO
23/05/2024	FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	ICATU VA	GUIDE CT	NTN-B	15/08/2028	Venda	6,1810%	6,1536%	5,9811%	6,3368%	0,0274%	NÃO
23/05/2024	FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	ICATU VA	GUIDE CT	NTN-B	15/08/2028	Venda	6,1810%	6,1536%	5,9811%	6,3368%	0,0274%	NÃO

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL
Mês de Referência: 01 DE MAIO DE 2024 À 31 DE MAIO 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
07-05-24	FIA RVA EMB II	Compra	SRNA3	9,00	4.900,00	44.083,53	8,87	9,00	9,13	4.534,00
07-05-24	FIA RVA EMB II	Compra	SRNA3	9,01	32.000,00	288.167,60	8,87	9,00	9,13	4.534,00
07-05-24	FIA RVA EMB II	Venda	SUZB3	55,33	6.200,00	343.046,00	51,56	53,73	59,95	100.364,00
07-05-24	FIA RVA EMB II	Venda	SUZB3	55,27	1.600,00	88.432,00	51,56	53,73	59,95	100.364,00
07-05-24	FIA RVA EMB II	Compra	VALE3	65,05	10.000,00	650.475,26	64,30	64,79	65,18	42.553,00
07-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALPA4	9,75	900,00	8.773,84	9,58	9,71	9,92	5.337,00
07-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	B3SA3	11,65	1.400,00	16.309,00	11,58	11,66	11,77	24.611,00
07-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	28,47	900,00	25.624,97	28,29	28,45	28,66	24.495,00
07-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	BBDC4	13,77	12.600,00	173.449,14	13,71	13,77	13,85	30.887,00
07-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	32,96	1.800,00	59.328,00	32,80	33,03	33,47	15.194,00
07-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	35,55	700,00	24.884,00	35,13	35,52	35,90	18.391,00
07-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLE3	8,63	1.400,00	12.086,66	8,59	8,65	8,77	7.808,00
07-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLE6	9,57	1.500,00	14.351,00	9,50	9,57	9,66	19.152,00
07-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLE6	9,61	4.100,00	39.400,53	9,50	9,57	9,66	19.152,00
07-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	39,32	2.000,00	78.638,65	39,18	39,38	39,70	15.848,00
07-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,80	2.900,00	37.115,41	12,69	12,77	12,89	9.674,00
07-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQT13	31,61	1.600,00	50.577,83	31,30	31,55	31,76	12.724,00
07-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	14,93	2.400,00	35.832,00	14,88	14,96	15,07	7.624,00
07-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,05	8.200,00	33.210,00	3,95	4,05	4,14	39.759,00
07-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,07	39.600,00	161.313,53	3,95	4,05	4,14	39.759,00
07-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,08	5.800,00	23.642,00	3,95	4,05	4,14	39.759,00
07-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGT11	21,71	2.000,00	43.418,63	21,61	21,75	21,99	14.525,00
07-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	9,99	9.600,00	95.930,28	9,84	9,97	10,08	25.541,00
07-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,00	4.300,00	42.980,26	9,84	9,97	10,08	25.541,00
07-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	1,61	9.900,00	15.893,64	1,57	1,61	1,65	35.613,00
07-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	MULT3	24,13	1.000,00	24.127,00	23,96	24,12	24,52	23.059,00
07-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	17,40	1.100,00	19.135,11	17,20	17,37	17,61	10.692,00
07-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	46,95	400,00	18.781,00	46,65	47,05	47,46	17.236,00
07-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	20,95	2.700,00	56.568,44	20,74	20,95	21,20	13.942,00
07-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	21,57	800,00	17.254,00	21,37	21,60	21,87	5.190,00
07-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	49,35	1.400,00	69.096,24	48,63	49,41	49,80	19.567,00
07-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	6,11	4.500,00	27.474,00	6,03	6,11	6,19	11.002,00
07-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	SRNA3	9,09	2.500,00	22.713,73	8,87	9,00	9,13	4.534,00
07-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	SRNA3	9,01	8.800,00	79.265,67	8,87	9,00	9,13	4.534,00
07-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	SRNA3	9,00	3.300,00	29.683,50	8,87	9,00	9,13	4.534,00
07-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	54,08	4.700,00	254.197,92	51,56	53,73	59,95	100.364,00
07-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	24,18	2.100,00	50.770,92	23,50	24,02	24,47	24.003,00
07-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	24,40	1.100,00	26.840,00	23,50	24,02	24,47	24.003,00
07-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	24,12	700,00	16.883,00	23,50	24,02	24,47	24.003,00
07-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	16,25	1.300,00	21.119,00	16,12	16,34	16,70	8.597,00
07-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	HAPV3	4,04	46.057,00	186.069,70	3,95	4,05	4,14	39.759,00
07-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	HAPV3	4,01	23.813,00	95.562,46	3,95	4,05	4,14	39.759,00
07-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	HAPV3	4,11	36.225,00	148.884,75	3,95	4,05	4,14	39.759,00
07-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	23,51	916,00	21.535,16	23,32	23,48	23,74	11.132,00
07-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	23,36	916,00	21.400,61	23,32	23,48	23,74	11.132,00
07-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	23,42	2.670,00	62.527,40	23,32	23,48	23,74	11.132,00
07-05-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	HOF13	30,97	3.200,00	99.288,83	30,72	31,06	31,50	1.949,00
08-05-24	FIA RVA EMB II	Compra	BRFS3	18,90	19.800,00	374.145,75	17,92	18,66	19,19	58.379,00
08-05-24	FIA RVA EMB II	Venda	MULT3	23,77	12.400,00	294.775,94	23,57	23,77	23,97	12.065,00
08-05-24	FIA RVA EMB II	Compra	NTCO3	17,47	6.300,00	110.081,94	17,19	17,54	17,62	8.603,00
08-05-24	FIA RVA EMB II	Venda	ONCO3	6,55	30.900,00	202.376,22	6,05	6,44	7,25	41.587,00
08-05-24	FIA RVA EMB II	Venda	RENT3	49,42	5.400,00	266.871,02	48,90	49,75	50,25	18.492,00
08-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALPA4	9,75	3.600,00	35.100,00	9,50	9,74	9,87	4.258,00
08-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,11	42.100,00	172.844,42	4,02	4,08	4,14	23.482,00
08-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	21,20	2.200,00	46.634,12	20,95	21,29	21,61	14.391,00
08-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	6,08	22.000,00	133.654,06	5,97	6,05	6,16	6.073,00
08-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	6,06	6.800,00	41.174,57	5,97	6,05	6,16	6.073,00
08-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	6,05	7.700,00	46.605,26	5,97	6,05	6,16	6.073,00
08-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	6,04	1.600,00	9.664,00	5,97	6,05	6,16	6.073,00
08-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	HAPV3	4,09	22.241,00	90.858,80	4,02	4,08	4,14	23.482,00
08-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	HAPV3	4,10	60.194,00	246.494,43	4,02	4,08	4,14	23.482,00
08-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	HAPV3	4,08	14.978,00	61.128,08	4,02	4,08	4,14	23.482,00
08-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	HAPV3	4,06	30.097,00	122.193,82	4,02	4,08	4,14	23.482,00
08-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	23,70	1.273,00	30.175,39	23,57	23,77	23,97	12.065,00
08-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	23,63	1.812,00	42.817,53	23,57	23,77	23,97	12.065,00
08-05-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	PVBI11	98,20	1.349,00	132.331,66	97,51	97,88	98,40	6.080,00
09-05-24	FIA RVA EMB II	Compra	BRFS3	18,85	21.900,00	412.820,38	18,23	18,78	19,00	26.508,00
09-05-24	FIA RVA EMB II	Venda	CSAN3	14,42	14.600,00	210.553,00	14,26	14,46	14,65	14.184,00
09-05-24	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	46,78	4.700,00	219.861,00	46,08	46,66	47,31	11.364,00
09-05-24	FIA RVA EMB II	Venda	IGT11	20,90	6.600,00	137.957,41	20,76	20,93	21,23	10.843,00
09-05-24	FIA RVA EMB II	Compra	KLBN11	21,76	25.600,00	556.973,27	21,23	21,65	21,89	15.685,00
09-05-24	FIA RVA EMB II	Venda	MRF13	10,36	46.400,00	480.823,70	10,23	10,37	10,54	18.139,00
09-05-24	FIA RVA EMB II	Venda	MULT3	23,48	9.000,00	211.284,18	23,25	23,41	23,73	14.187,00
09-05-24	FIA RVA EMB II	Compra	PETRA4	41,24	15.000,00	618.574,00	40,94	41,41	41,84	51.288,00
09-05-24	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	52,18	3.500,00	182.638,40	51,70	52,49	53,00	51.986,00
09-05-24	FIA RVA EMB II	Compra	VALE3	64,21	10.000,00	642.115,00	63,78	64,53	64,93	50.445,00
09-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALPA4	9,90	300,00	2.970,00	9,55	9,80	9,97	4.952,00
09-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALPA4	9,83	3.900,00	38.337,00	9,55	9,80	9,97	4.952,00
09-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	27,17	400,00	10.866,85	27,05	27,27	28,29	113.379,00
09-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	32,62	500,00	16.311,32	32,40	32,59	32,75	15.282,00
09-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	33,25	3.300,00	109.732,37	32,83	33,25	34,62	35.118,00
09-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLE6	9,20	26.600,00	244.670,72	9,05	9,21	9,47	27.664,00
09-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	37,78	5.300,00	200.246,69	37,14	37,87	39,11	35.254,00
09-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	37,93	1.200,00	45.518,77	37,14	37,87	39,11	35.254,00
09-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,53	2.500,00	31.322,24	12,27	12,43	12,64	12.485,00
09-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQT13	30,66	1.800,00	55.190,98	30,24	30,67	31,21	25.041,00
09-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	14,75	1.400,00	20.644,72	14,58	14,71	14,87	7.870,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – MAIO 2024

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

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

DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
09-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,07	4.700,00	19.151,14	4,00	4,09	4,15	20.780,00
09-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	20,94	1.800,00	37.696,61	20,76	20,93	21,23	10.843,00
09-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	9,92	3.700,00	36.720,47	9,83	9,91	10,05	20.585,00
09-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	1,65	22.600,00	37.320,27	1,56	1,62	1,70	27.092,00
09-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	1,67	57.000,00	95.304,00	1,56	1,62	1,70	27.092,00
09-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRIO3	46,76	400,00	18.702,59	45,82	46,72	47,30	35.777,00
09-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	20,43	2.200,00	44.940,81	20,00	20,40	20,56	18.259,00
09-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	21,32	800,00	17.058,84	21,13	21,34	21,62	10.656,00
09-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	49,30	1.000,00	49.302,89	48,92	49,41	50,12	24.203,00
09-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	23,40	3.700,00	86.568,54	23,03	23,46	24,14	16.461,00
09-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	23,30	2.100,00	48.930,00	23,03	23,46	24,14	16.461,00
09-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	5,78	43.600,00	252.126,92	5,56	5,77	5,92	19.988,00
09-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	SRNA3	8,96	4.200,00	37.632,00	8,81	8,93	9,06	6.821,00
09-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	SRNA3	8,97	1.300,00	11.661,00	8,81	8,93	9,06	6.821,00
09-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	SRNA3	8,95	500,00	4.474,07	8,81	8,93	9,06	6.821,00
09-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	52,38	1.600,00	83.815,75	51,70	52,49	53,00	51.986,00
09-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	15,44	1.300,00	20.066,86	14,85	15,46	16,12	15.128,00
09-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	HAPV3	4,11	5.489,00	22.572,69	4,00	4,09	4,15	20.780,00
09-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	HAPV3	4,11	65.873,00	270.738,03	4,00	4,09	4,15	20.780,00
09-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	HAPV3	4,08	21.884,00	89.237,69	4,00	4,09	4,15	20.780,00
09-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	HAPV3	4,05	3.701,00	14.987,80	4,00	4,09	4,15	20.780,00
09-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	23,40	905,00	21.177,00	23,25	23,41	23,73	14.187,00
09-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	23,41	4.952,00	115.905,19	23,25	23,41	23,73	14.187,00
09-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	23,44	804,00	18.845,76	23,25	23,41	23,73	14.187,00
09-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	25,10	1.668,00	41.866,80	24,38	24,80	25,51	43.999,00
09-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	23,21	3.870,00	89.833,82	22,56	23,18	23,80	36.245,00
09-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	23,20	910,00	21.112,00	22,56	23,18	23,80	36.245,00
09-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	22,90	3.640,00	83.348,29	22,56	23,18	23,80	36.245,00
09-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	22,84	704,00	16.077,98	22,56	23,18	23,80	36.245,00
09-05-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	BPML11	98,65	1.727,00	170.360,62	96,51	98,33	100,60	404,00
09-05-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	HOFC11	30,77	3.132,00	96.381,09	30,29	30,75	31,05	1.728,00
09-05-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	PVBI11	98,04	6.694,00	656.281,77	97,78	98,03	98,40	7.881,00
10-05-24	FIA RVA EMB II	Venda	CSAN3	14,36	22.400,00	321.614,89	14,28	14,36	14,63	15.074,00
10-05-24	FIA RVA EMB II	Venda	ELET3	37,74	7.200,00	271.722,70	37,08	37,60	38,09	16.817,00
10-05-24	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	47,71	9.200,00	438.973,11	46,41	47,42	47,97	10.453,00
10-05-24	FIA RVA EMB II	Venda	PLPL3	10,32	17.100,00	176.508,77	9,83	10,35	10,76	5.775,00
10-05-24	FIA RVA EMB II	Compra	RDR3	30,74	3.800,00	116.822,77	30,03	30,65	30,93	30.845,00
10-05-24	FIA RVA EMB II	Venda	RENT3	47,96	4.800,00	230.210,99	46,60	48,68	52,44	57.324,00
10-05-24	FIA RVA EMB II	Compra	VBBR3	23,86	16.900,00	403.294,52	23,54	23,81	24,00	28.125,00
10-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	21,54	1.600,00	34.464,00	20,92	21,33	21,76	18.181,00
10-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALPA4	10,44	7.000,00	73.099,18	10,18	10,54	11,03	19.152,00
10-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALPA4	10,75	5.700,00	61.271,86	10,18	10,54	11,03	19.152,00
10-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	BBDC4	13,38	14.000,00	187.308,71	13,35	13,40	13,58	22.099,00
10-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,03	18.700,00	187.478,76	9,92	10,01	10,05	16.403,00
10-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	1,72	8.100,00	13.932,00	1,53	1,60	1,75	36.286,00
10-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	21,14	1.200,00	25.368,00	20,81	21,10	21,44	27.280,00
10-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	21,24	1.600,00	33.980,00	20,81	21,10	21,44	27.280,00
10-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	21,14	2.500,00	52.846,93	20,81	21,10	21,44	27.280,00
10-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	47,13	2.100,00	98.978,68	46,60	48,68	52,44	57.324,00
10-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	47,40	3.900,00	184.869,49	46,60	48,68	52,44	57.324,00
10-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	5,72	17.700,00	101.227,33	5,61	5,72	5,92	15.777,00
10-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	5,72	9.700,00	55.484,00	5,61	5,72	5,92	15.777,00
10-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	5,77	1.400,00	8.077,83	5,61	5,72	5,92	15.777,00
10-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	51,43	1.800,00	92.567,43	50,05	52,00	53,35	55.859,00
10-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	15,73	600,00	9.440,23	15,47	15,77	16,38	11.323,00
10-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	GGPS3	19,54	3.341,00	65.292,99	18,95	19,53	19,86	8.448,00
10-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	ITUB4	32,86	15.892,00	522.196,06	32,31	32,77	33,02	33.062,00
10-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	24,67	4.266,00	105.234,74	24,40	24,58	25,03	18.161,00
10-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	24,50	6.838,00	167.560,17	24,40	24,58	25,03	18.161,00
10-05-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	PVBI11	98,02	418,00	40.970,31	97,36	97,74	98,20	18.648,00
13-05-24	FIA RVA EMB II	Compra	BBSE3	33,66	13.000,00	437.563,00	33,06	33,73	34,35	25.661,00
13-05-24	FIA RVA EMB II	Compra	NTCO3	17,49	18.200,00	318.399,65	17,30	17,69	17,99	13.537,00
13-05-24	FIA RVA EMB II	Venda	SUZB3	50,54	10.900,00	550.861,96	50,12	50,57	51,84	33.644,00
13-05-24	FIA RVA EMB II	Compra	VIVT3	45,60	2.000,00	91.193,00	44,97	45,59	45,94	14.776,00
13-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	21,43	1.300,00	27.862,21	21,16	21,47	21,74	13.312,00
13-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALPA4	10,21	600,00	6.123,67	10,08	10,21	10,35	7.124,00
13-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALPA4	10,22	3.200,00	32.705,24	10,08	10,21	10,35	7.124,00
13-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	B3SA3	11,20	1.500,00	16.794,22	10,92	11,17	11,29	51.722,00
13-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	27,79	500,00	13.896,59	27,65	27,80	27,97	40.796,00
13-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	33,59	700,00	23.510,25	33,06	33,73	34,35	25.661,00
13-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	34,06	800,00	27.248,00	33,72	34,05	34,56	27.008,00
13-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL66	9,18	3.800,00	34.884,00	9,13	9,19	9,25	15.314,00
13-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL66	9,21	1.300,00	11.968,78	9,13	9,19	9,25	15.314,00
13-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL66	9,20	3.000,00	27.585,27	9,13	9,19	9,25	15.314,00
13-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	38,01	1.600,00	60.821,60	37,73	38,03	38,38	13.169,00
13-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,42	3.400,00	42.214,96	12,40	12,41	12,57	5.763,00
13-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	30,66	2.400,00	73.581,91	30,53	30,64	30,97	11.790,00
13-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	14,37	1.400,00	20.122,76	14,31	14,40	14,50	6.761,00
13-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	14,38	3.200,00	46.029,45	14,31	14,40	14,50	6.761,00
13-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,06	8.100,00	32.886,00	4,03	4,06	4,12	40.090,00
13-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,07	29.100,00	118.315,94	4,03	4,06	4,12	40.090,00
13-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,06	6.300,00	25.584,02	4,03	4,06	4,12	40.090,00
13-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,08	8.100,00	33.048,00	4,03	4,06	4,12	40.090,00
13-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	21,16	3.500,00	74.074,18	21,09	21,21	21,45	10.395,00
13-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,10	4.900,00	49.491,32	10,04	10,10	10,16	26.595,00
13-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	1,54	11.700,00	18.023,56	1,53	1,57	1,62	25.800,00
13-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	1,57	52.200,00	81.934,60	1,53	1,57	1,62	25.800,00

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

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



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
13-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	1,54	8.100,00	12.474,00	1,53	1,57	1,62	25.800,00
13-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	17,50	1.200,00	20.998,94	17,30	17,49	17,69	13.537,00
13-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	46,51	500,00	23.254,51	46,27	46,74	47,66	23.243,00
13-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	20,88	3.000,00	62.636,55	20,80	20,90	21,17	18.989,00
13-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	21,46	1.000,00	21.455,81	21,35	21,53	21,83	4.950,00
13-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	46,17	600,00	27.702,88	45,76	46,23	47,39	47.855,00
13-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	23,07	2.600,00	59.992,10	22,74	23,01	23,35	8.726,00
13-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	22,99	400,00	9.195,16	22,74	23,01	23,35	8.726,00
13-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	5,57	3.400,00	18.928,66	5,55	5,59	5,70	9.683,00
13-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	SRNA3	8,82	8.400,00	74.115,30	8,60	8,80	8,99	7.230,00
13-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	SRNA3	8,76	1.300,00	11.385,00	8,60	8,80	8,99	7.230,00
13-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	SRNA3	8,79	900,00	7.908,02	8,60	8,80	8,99	7.230,00
13-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	50,90	14.600,00	743.201,83	50,12	50,57	51,84	33.644,00
13-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	23,03	800,00	18.425,79	22,88	23,05	23,27	8.392,00
13-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	23,11	4.900,00	113.262,81	22,88	23,05	23,27	8.392,00
13-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	23,11	700,00	16.177,00	22,88	23,05	23,27	8.392,00
13-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	13,89	1.700,00	23.620,31	13,74	14,02	15,07	28.262,00
13-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	GGP3	19,35	900,00	17.417,00	18,93	19,17	19,46	4.174,00
13-05-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	PVBI11	97,86	812,00	79.462,75	96,50	97,04	97,94	10.968,00
14-05-24	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	47,41	4.700,00	222.815,43	46,28	47,36	47,55	9.488,00
14-05-24	FIA RVA EMB II	Compra	HAPV3	4,36	15.000,00	65.381,32	4,26	4,37	4,49	64.943,00
14-05-24	FIA RVA EMB II	Compra	JBSS3	25,30	2.000,00	50.597,00	24,96	25,14	25,34	13.059,00
14-05-24	FIA RVA EMB II	Venda	ONCO3	5,70	15.000,00	85.500,00	5,55	5,77	6,05	18.599,00
14-05-24	FIA RVA EMB II	Venda	PETRA	40,57	12.200,00	494.954,00	40,16	40,82	41,30	82.139,00
14-05-24	FIA RVA EMB II	Venda	PETRA	40,76	13.700,00	558.417,48	40,16	40,82	41,30	82.139,00
14-05-24	FIA RVA EMB II	Compra	RDR03	31,15	4.600,00	143.308,20	30,56	30,88	31,30	22.106,00
14-05-24	FIA RVA EMB II	Compra	SBFG3	12,72	5.600,00	71.224,00	12,25	12,62	12,95	9.031,00
14-05-24	FIA RVA EMB II	Compra	TOTS3	28,82	9.600,00	276.655,00	28,14	28,37	28,91	6.795,00
14-05-24	FIA RVA EMB II	Compra	VBBR3	24,20	9.000,00	217.759,00	23,62	24,03	24,28	24.844,00
14-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALPA4	10,21	5.800,00	59.208,07	9,97	10,14	10,39	8.729,00
14-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALPA4	10,28	1.700,00	17.476,43	9,97	10,14	10,39	8.729,00
14-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	34,90	3.700,00	129.145,27	34,20	34,78	35,37	25.711,00
14-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	9,44	7.000,00	66.083,31	9,23	9,41	9,49	13.218,00
14-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,49	4.900,00	61.217,33	12,37	12,48	12,55	8.560,00
14-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,45	3.300,00	41.068,50	12,37	12,48	12,55	8.560,00
14-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,49	2.400,00	29.964,57	12,37	12,48	12,55	8.560,00
14-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	31,09	700,00	21.765,39	30,54	30,95	31,29	10.720,00
14-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	31,03	1.400,00	43.440,91	30,54	30,95	31,29	10.720,00
14-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,43	12.900,00	57.114,75	4,26	4,37	4,49	64.943,00
14-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,25	3.700,00	37.913,29	10,13	10,23	10,28	30.609,00
14-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,23	19.900,00	203.587,04	10,13	10,23	10,28	30.609,00
14-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	1,60	67.800,00	108.706,00	1,56	1,60	1,64	40.690,00
14-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	46,36	400,00	18.544,35	45,70	46,38	47,00	38.134,00
14-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	46,39	1.600,00	74.229,61	45,70	46,38	47,00	38.134,00
14-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	23,26	4.800,00	111.647,64	22,78	23,32	23,55	6.763,00
14-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	5,65	3.900,00	22.035,00	5,48	5,57	5,70	17.374,00
14-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	5,62	10.300,00	57.879,53	5,48	5,57	5,70	17.374,00
14-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	5,60	5.800,00	32.470,87	5,48	5,57	5,70	17.374,00
14-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	SRNA3	8,86	1.400,00	12.403,23	8,70	8,85	8,95	6.009,00
14-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	SRNA3	8,86	1.600,00	14.175,22	8,70	8,85	8,95	6.009,00
14-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	SRNA3	8,86	1.100,00	9.743,35	8,70	8,85	8,95	6.009,00
14-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	50,54	7.500,00	379.050,84	49,80	50,29	51,49	35.542,00
14-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	4,40	35.585,00	156.586,60	4,26	4,37	4,49	64.943,00
14-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	4,45	11.701,00	52.069,45	4,26	4,37	4,49	64.943,00
14-05-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	BPML11	98,22	304,00	29.857,67	95,97	98,46	99,99	597,00
14-05-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	EBVI11	97,59	76,00	7.416,57	96,51	97,34	97,89	30,00
14-05-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	FIGS11	56,24	940,00	52.861,07	56,07	56,23	56,35	82,00
14-05-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	HOCF11	30,89	580,00	17.916,56	30,86	30,91	31,05	48,00
14-05-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	OULG11	29,13	1.133,00	33.003,09	29,10	29,14	29,49	71,00
14-05-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	SARE11	45,20	691,00	31.233,20	44,75	45,98	46,84	2.192,00
14-05-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	XPPR11	19,73	2.078,00	40.995,77	19,70	19,75	19,99	685,00
15-05-24	FIA RVA EMB II	Compra	LREN3	14,83	3.000,00	44.485,00	14,75	15,00	15,61	25.596,00
15-05-24	FIA RVA EMB II	Compra	MRFG3	10,54	7.300,00	76.970,00	10,13	10,58	10,85	21.354,00
15-05-24	FIA RVA EMB II	Compra	NTCO3	16,36	9.400,00	153.808,00	15,44	16,16	16,48	23.639,00
15-05-24	FIA RVA EMB II	Venda	PETRA	38,41	2.700,00	103.700,65	37,50	38,18	38,81	256.501,00
15-05-24	FIA RVA EMB II	Venda	PETRA	38,21	5.400,00	206.340,89	37,50	38,18	38,81	256.501,00
15-05-24	FIA RVA EMB II	Compra	SRNA3	8,88	12.500,00	111.040,23	8,76	8,86	8,97	4.389,00
15-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	22,12	2.100,00	46.453,98	21,37	22,08	22,43	19.326,00
15-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	22,12	1.300,00	28.759,81	21,37	22,08	22,43	19.326,00
15-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	22,12	1.600,00	35.393,02	21,37	22,08	22,43	19.326,00
15-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	27,66	6.800,00	188.107,96	27,38	27,59	27,79	39.257,00
15-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	8,61	3.300,00	28.413,00	8,46	8,61	8,75	4.031,00
15-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	8,48	1.700,00	14.413,01	8,46	8,61	8,75	4.031,00
15-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	8,49	1.900,00	16.123,50	8,46	8,61	8,75	4.031,00
15-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	9,57	3.900,00	37.320,65	9,41	9,61	9,74	19.247,00
15-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	9,48	3.400,00	32.227,32	9,41	9,61	9,74	19.247,00
15-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,62	9.800,00	123.676,00	12,48	12,64	12,96	15.681,00
15-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	14,53	900,00	13.073,84	14,35	14,42	14,65	6.601,00
15-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	14,50	2.800,00	40.591,40	14,35	14,42	14,65	6.601,00
15-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,55	11.300,00	51.415,00	4,39	4,46	4,57	29.590,00
15-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,44	3.200,00	14.208,00	4,39	4,46	4,57	29.590,00
15-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,55	1.700,00	7.735,00	4,39	4,46	4,57	29.590,00
15-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,27	3.500,00	35.935,00	10,22	10,28	10,34	26.611,00
15-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,27	14.600,00	149.959,52	10,22	10,28	10,34	26.611,00
15-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	48,22	4.600,00	221.797,71	46,70	48,23	48,66	26.494,00
15-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	47,96	1.700,00	81.526,94	46,70	48,23	48,66	26.494,00
15-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	SRNA3	8,86	700,00	6.205,11	8,76	8,86	8,97	4.389,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – MAIO 2024

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL
Mês de Referência: 01 DE MAIO DE 2024 À 31 DE MAIO 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
15-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	SRNA3	8,81	400,00	3.524,00	8,76	8,86	8,97	4.389,00
15-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	50,14	400,00	20.057,34	49,71	50,29	51,09	29.555,00
15-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	4,43	175.000,00	774.663,00	4,39	4,46	4,57	29.590,00
15-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	24,08	6.511,00	156.797,40	23,64	24,04	24,22	14.748,00
15-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	24,01	1.302,00	31.261,91	23,64	24,04	24,22	14.748,00
15-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	24,09	3.935,00	94.801,17	23,64	24,04	24,22	14.748,00
15-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	24,13	845,00	20.386,50	23,64	24,04	24,22	14.748,00
15-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	RAI13	20,60	47.700,00	982.695,00	20,35	20,52	20,74	20.184,00
15-05-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	EVBI11	97,77	4,00	391,09	96,53	97,58	97,89	5,00
15-05-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	HOF11	30,95	1.140,00	35.287,90	30,65	30,96	31,49	168,00
15-05-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	SARE11	45,14	154,00	6.951,85	45,00	46,68	47,11	4.275,00
16-05-24	FIA RVA EMB II	Compra	BBSE3	34,31	9.200,00	315.689,78	34,12	34,31	34,45	11.263,00
16-05-24	FIA RVA EMB II	Compra	CPFE3	34,10	4.300,00	146.630,00	33,94	34,09	34,36	4.287,00
16-05-24	FIA RVA EMB II	Venda	MULT3	24,02	13.800,00	331.531,93	23,87	24,04	24,44	11.133,00
16-05-24	FIA RVA EMB II	Venda	PETR3	38,97	5.500,00	214.323,81	38,82	39,25	40,17	25.988,00
16-05-24	FIA RVA EMB II	Venda	PETR4	37,98	5.200,00	197.500,62	37,24	37,65	38,65	130.938,00
16-05-24	FIA RVA EMB II	Compra	PRIO3	47,47	3.200,00	151.898,00	46,70	47,46	47,99	30.723,00
16-05-24	FIA RVA EMB II	Compra	RADL3	27,45	3.900,00	107.053,14	27,15	27,46	27,70	9.276,00
16-05-24	FIA RVA EMB II	Compra	RDO3	31,53	5.400,00	170.271,82	30,81	31,21	31,76	21.947,00
16-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	22,05	1.700,00	37.491,49	21,89	22,12	22,42	11.552,00
16-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	27,72	400,00	11.086,38	27,65	27,73	27,96	24.263,00
16-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	34,31	500,00	17.153,84	34,12	34,31	34,45	11.263,00
16-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	35,66	700,00	24.959,62	35,17	35,57	35,85	20.858,00
16-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	9,66	1.300,00	12.557,85	9,62	9,67	9,75	11.580,00
16-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	38,38	1.300,00	49.888,75	38,02	38,36	38,66	14.911,00
16-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,71	2.600,00	33.040,05	12,61	12,70	12,80	10.433,00
16-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQL3	31,51	2.000,00	63.011,60	31,00	31,40	31,90	12.267,00
16-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	14,64	1.600,00	23.416,60	14,42	14,65	14,76	8.855,00
16-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,46	4.700,00	20.966,28	4,36	4,44	4,53	46.575,00
16-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	20,85	2.100,00	43.784,79	20,75	20,88	21,34	14.495,00
16-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	10,32	3.600,00	37.138,67	10,23	10,31	10,37	26.192,00
16-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	MGLU3	1,60	9.100,00	14.593,85	1,58	1,60	1,63	14.718,00
16-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	MULT3	24,06	17.400,00	418.669,35	23,87	24,04	24,44	11.133,00
16-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRIO3	47,61	400,00	19.044,07	47,46	47,99	30.723,00	
16-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAI13	21,07	2.400,00	50.560,36	20,53	20,98	21,17	15.974,00
16-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	21,09	800,00	16.873,23	20,77	21,07	21,65	5.907,00
16-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	48,58	1.400,00	68.015,61	47,60	48,36	48,93	20.325,00
16-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	23,32	1.000,00	23.319,21	23,14	23,28	23,90	4.661,00
16-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	5,74	7.300,00	41.924,91	5,62	5,74	5,82	10.420,00
16-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	5,80	3.700,00	21.453,41	5,62	5,74	5,82	10.420,00
16-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	5,71	3.200,00	18.272,97	5,62	5,74	5,82	10.420,00
16-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	SRNA3	9,39	800,00	7.514,77	8,87	9,20	9,45	7.131,00
16-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	SRNA3	9,09	10.600,00	96.307,89	8,87	9,20	9,45	7.131,00
16-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	51,19	900,00	46.072,31	50,54	51,25	51,78	24.424,00
16-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	23,12	3.300,00	76.296,00	22,95	23,24	23,52	6.046,00
16-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	13,16	1.400,00	18.425,47	13,04	13,23	13,84	18.327,00
16-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	4,42	8.080,00	35.676,30	4,36	4,44	4,53	46.575,00
16-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	4,39	468,00	2.054,72	4,36	4,44	4,53	46.575,00
16-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	4,46	12.687,00	56.526,73	4,36	4,44	4,53	46.575,00
16-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	4,47	44.024,00	196.693,22	4,36	4,44	4,53	46.575,00
16-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	4,44	6.215,00	27.594,60	4,36	4,44	4,53	46.575,00
16-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	24,07	1.348,00	32.440,57	23,87	24,04	24,44	11.133,00
16-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	24,06	7.373,00	177.399,35	23,87	24,04	24,44	11.133,00
16-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	23,85	4.533,00	108.112,46	23,60	23,82	24,07	15.338,00
17-05-24	FIA RVA EMB II	Compra	ABEV3	12,38	19.500,00	241.410,00	12,28	12,36	12,41	44.181,00
17-05-24	FIA RVA EMB II	Compra	JBSS3	28,93	6.300,00	182.276,66	28,20	28,86	29,28	33.260,00
17-05-24	FIA RVA EMB II	Venda	ONCO3	7,23	43.900,00	317.280,00	6,31	6,96	7,55	10.412,00
17-05-24	FIA RVA EMB II	Venda	PETR4	36,69	4.600,00	168.774,00	36,51	36,80	37,42	84.661,00
17-05-24	FIA RVA EMB II	Venda	SBS3	78,75	2.600,00	204.742,05	78,51	78,78	79,59	11.590,00
17-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,75	7.400,00	94.366,61	12,56	12,72	12,79	13.872,00
17-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,56	3.300,00	15.048,00	4,49	4,53	4,59	31.102,00
17-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,55	48.200,00	219.473,22	4,49	4,53	4,59	31.102,00
17-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAI13	20,66	2.400,00	49.592,00	20,46	20,66	20,87	13.413,00
17-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAI13	20,63	6.700,00	138.202,97	20,46	20,66	20,87	13.413,00
17-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	5,77	1.800,00	10.393,64	5,68	5,78	5,87	11.465,00
17-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	5,85	5.700,00	33.331,66	5,68	5,78	5,87	11.465,00
17-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	5,75	1.500,00	8.625,00	5,68	5,78	5,87	11.465,00
17-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	23,18	1.600,00	37.088,00	22,92	23,16	23,49	5.772,00
17-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	23,12	600,00	13.869,46	22,92	23,16	23,49	5.772,00
17-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	11,89	54.872,00	652.153,72	11,73	11,85	12,02	13.101,00
17-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	11,86	14.431,00	171.204,45	11,73	11,85	12,02	13.101,00
17-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	11,77	7.297,00	85.882,41	11,73	11,85	12,02	13.101,00
17-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	23,52	2.806,00	65.990,24	23,36	23,67	23,91	22.461,00
17-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	23,69	3.228,00	76.481,86	23,36	23,67	23,91	22.461,00
17-05-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	FIGS11	56,28	334,00	18.798,32	56,05	56,25	56,41	119,00
17-05-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	HOF11	31,02	395,00	12.253,35	30,75	30,82	31,32	1.355,00
20-05-24	FIA RVA EMB II	Venda	SUZB3	51,05	7.200,00	367.560,00	51,05	51,75	52,59	34.498,00
20-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	14,58	1.000,00	14.575,06	14,34	14,76	15,00	8.611,00
20-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,59	20.800,00	95.385,28	4,50	4,57	4,67	35.648,00
20-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	7,80	12.300,00	95.972,54	7,25	7,75	8,05	16.877,00
20-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	47,95	1.400,00	67.130,00	47,40	47,99	48,48	24.536,00
20-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	47,93	1.300,00	62.310,76	47,40	47,99	48,48	24.536,00
20-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	5,90	13.000,00	76.645,49	5,75	5,89	5,96	11.923,00
20-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	SRNA3	9,51	12.100,00	115.071,00	9,29	9,59	9,73	7.290,00
20-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	SRNA3	9,65	1.000,00	9.652,53	9,29	9,59	9,73	7.290,00
20-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	23,49	2.500,00	58.714,29	22,75	23,52	23,78	8.356,00
20-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	23,55	800,00	18.841,38	22,75	23,52	23,78	8.356,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – MAIO 2024

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL
Mês de Referência: 01 DE MAIO DE 2024 À 31 DE MAIO 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
20-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	11,86	3.117,00	36.976,07	11,74	11,87	11,99	6.524,00
20-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	11,87	3.484,00	41.340,73	11,74	11,87	11,99	6.524,00
20-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	GGPS3	19,49	3.307,00	64.447,18	19,00	19,43	19,85	6.234,00
20-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	23,55	3.647,00	85.886,85	23,43	23,77	24,14	20.540,00
20-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	23,51	906,00	21.303,50	23,43	23,77	24,14	20.540,00
20-05-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	BPML11	95,88	2.068,00	198.276,20	95,12	95,94	98,40	1.495,00
20-05-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	EVBI11	98,36	19,00	1.868,78	97,01	97,64	98,49	30,00
20-05-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	FIGS11	56,33	784,00	44.158,85	56,20	56,35	56,69	174,00
20-05-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	HOFC11	30,90	60,00	1.854,00	30,81	30,99	31,58	653,00
20-05-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	PVBI11	96,81	7.281,00	704.880,07	96,13	96,69	96,95	17.380,00
20-05-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	QAGR11	47,19	205,00	9.673,95	46,92	47,13	47,49	565,00
20-05-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	RBRP11	60,03	1.050,00	63.030,50	59,95	60,26	61,40	6.712,00
21-05-24	FIA RVA EMB II	Compra	CEAB3	10,27	4.200,00	43.113,28	10,14	10,31	10,62	5.531,00
21-05-24	FIA RVA EMB II	Compra	ENGI11	47,01	2.400,00	112.831,50	46,49	46,91	47,22	9.580,00
21-05-24	FIA RVA EMB II	Compra	EQT13	30,78	8.700,00	267.791,00	30,41	30,72	30,99	15.057,00
21-05-24	FIA RVA EMB II	Venda	LREN3	14,17	27.200,00	385.409,90	13,98	14,19	14,75	26.849,00
21-05-24	FIA RVA EMB II	Compra	SRNA3	9,56	5.300,00	50.678,00	9,48	9,58	9,69	4.607,00
21-05-24	FIA RVA EMB II	Compra	VALE3	66,67	2.000,00	133.340,00	65,90	66,40	67,10	31.178,00
21-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	21,44	2.300,00	49.318,46	21,38	21,45	21,79	7.795,00
21-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	B3SA3	11,45	1.700,00	19.460,00	11,28	11,40	11,50	23.042,00
21-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	27,92	700,00	19.546,24	27,88	27,97	28,13	24.420,00
21-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	BBDC4	13,41	1.300,00	17.434,04	13,31	13,39	13,46	19.097,00
21-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	33,83	800,00	27.066,26	33,53	33,77	33,99	8.602,00
21-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	34,23	1.000,00	34.233,68	34,01	34,19	34,50	14.182,00
21-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLE3	8,75	1.800,00	15.747,28	8,51	8,71	8,78	9.111,00
21-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	9,68	2.100,00	20.320,06	9,46	9,65	9,72	20.958,00
21-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	36,50	4.900,00	178.850,00	36,43	36,94	37,59	26.503,00
21-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	37,39	1.800,00	67.308,46	36,43	36,94	37,59	26.503,00
21-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,75	1.700,00	21.671,16	12,66	12,71	12,84	10.070,00
21-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,71	17.400,00	221.183,00	12,66	12,71	12,84	10.070,00
21-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQT13	30,77	2.700,00	83.077,86	30,41	30,72	30,99	15.057,00
21-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	14,90	1.900,00	28.301,04	14,60	14,81	14,98	4.358,00
21-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,51	5.900,00	26.581,95	4,45	4,49	4,59	38.930,00
21-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	20,69	1.900,00	39.314,28	20,56	20,65	20,80	6.573,00
21-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,22	35.000,00	357.700,00	10,19	10,22	10,26	24.800,00
21-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,23	200,00	2.046,00	10,19	10,22	10,26	24.800,00
21-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	32,96	100,00	3.296,00	32,83	32,98	33,28	27.088,00
21-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB84	32,95	12.100,00	398.695,00	32,83	32,98	33,28	27.088,00
21-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	MGLU3	1,53	12.400,00	18.984,30	1,50	1,54	1,59	21.447,00
21-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	16,17	1.400,00	22.636,44	15,94	16,18	16,47	12.008,00
21-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	8,30	8.900,00	73.855,30	7,60	8,06	8,44	8.890,00
21-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	8,38	700,00	5.868,93	7,60	8,06	8,44	8.890,00
21-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	46,00	600,00	27.601,66	45,68	46,24	47,19	24.995,00
21-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	20,77	3.300,00	68.533,65	20,27	20,63	20,82	15.464,00
21-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	20,59	4.500,00	92.667,66	20,27	20,63	20,82	15.464,00
21-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	20,50	2.300,00	47.150,00	20,27	20,63	20,82	15.464,00
21-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	REC3	21,09	1.200,00	25.303,77	20,92	21,09	21,48	6.784,00
21-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	46,94	2.200,00	103.278,17	46,54	46,90	48,17	19.038,00
21-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	23,10	1.400,00	32.342,52	22,93	23,09	23,27	4.984,00
21-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	SRNA3	9,60	6.800,00	65.280,37	9,48	9,58	9,69	4.607,00
21-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	49,11	1.300,00	63.844,61	48,90	49,30	50,61	44.761,00
21-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	VIVA3	23,57	700,00	16.496,67	23,33	23,59	23,80	6.621,00
21-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	13,80	1.900,00	26.219,57	13,68	13,62	13,97	29.158,00
21-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	CPLE3	8,70	24.450,00	212.715,00	8,51	8,71	8,78	9.111,00
21-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	46,95	3.681,00	172.826,58	46,49	46,91	47,22	9.580,00
21-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	46,97	825,00	38.751,59	46,49	46,91	47,22	9.580,00
21-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQT13	30,76	8.665,00	211.133,73	30,41	30,72	30,99	15.057,00
21-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	4,50	24.829,00	111.674,01	4,45	4,49	4,59	38.930,00
21-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	4,50	12.081,00	54.388,17	4,45	4,49	4,59	38.930,00
21-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	4,51	12.081,00	54.485,30	4,45	4,49	4,59	38.930,00
21-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	4,50	22.218,00	99.977,87	4,45	4,49	4,59	38.930,00
21-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	23,55	4.501,00	105.985,10	23,39	23,52	23,71	10.651,00
21-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	23,37	1.505,00	35.171,85	23,26	23,54	23,90	17.019,00
21-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	23,75	903,00	21.446,25	23,26	23,54	23,90	17.019,00
21-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	23,54	2.052,00	48.312,19	23,26	23,54	23,90	17.019,00
22-05-24	FIA RVA EMB II	Venda	IGTI11	20,40	4.900,00	99.960,00	20,13	20,31	20,63	14.256,00
22-05-24	FIA RVA EMB II	Compra	PETRA	36,99	16.900,00	625.060,60	36,41	36,97	37,46	40.914,00
22-05-24	FIA RVA EMB II	Venda	PRI03	44,09	3.800,00	167.547,21	43,87	44,45	45,65	33.837,00
22-05-24	FIA RVA EMB II	Venda	REC3	20,05	15.500,00	310.808,29	19,97	20,14	20,85	9.177,00
22-05-24	FIA RVA EMB II	Venda	RRRP3	28,73	7.900,00	226.946,21	28,39	28,88	29,80	15.035,00
22-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	36,11	1.300,00	46.943,00	35,96	36,32	37,13	37.745,00
22-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	36,27	2.300,00	83.421,81	35,96	36,32	37,13	37.745,00
22-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	36,32	1.700,00	61.741,67	35,96	36,32	37,13	37.745,00
22-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,12	29.900,00	302.490,18	10,09	10,12	10,20	31.941,00
22-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,14	101.700,00	1.031.388,81	10,09	10,12	10,20	31.941,00
22-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	32,42	9.300,00	301.528,52	32,32	32,51	32,85	47.797,00
22-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	32,60	31.600,00	1.030.174,29	32,32	32,51	32,85	47.797,00
22-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	14,13	5.500,00	77.714,44	13,81	14,11	14,56	20.045,00
22-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	12,07	2.895,00	34.954,43	12,00	12,07	12,16	14.910,00
22-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	12,06	6.639,00	80.072,42	12,00	12,07	12,16	14.910,00
22-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	12,06	30.800,00	371.502,66	12,00	12,07	12,16	14.910,00
22-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	12,03	3.676,00	44.222,28	12,00	12,07	12,16	14.910,00
22-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	12,05	9.957,00	120.024,21	12,00	12,07	12,16	14.910,00
22-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	12,03	869,00	10.456,97	12,00	12,07	12,16	14.910,00
22-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	GGPS3	19,19	3.386,00	64.977,34	18,91	19,11	19,31	4.355,00
22-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	4,40	23.842,00	104.967,82	4,39	4,43	4,54	30.547,00
22-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	22,91	674,00	15.438,94	22,73	22,92	23,36	20.236,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – MAIO 2024



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL
Mês de Referência: 01 DE MAIO DE 2024 À 31 DE MAIO DE 2024

DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
22-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	22,85	343,00	7.837,55	22,73	22,92	23,36	20.236,00
22-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	22,87	971,00	22.208,87	22,73	22,92	23,36	20.236,00
22-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	23,12	4.607,00	106.529,52	22,97	23,12	23,45	17.479,00
22-05-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	PVBI11	96,79	3.276,00	317.090,12	96,08	96,60	97,20	10.516,00
22-05-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	RBRP11	59,11	1.951,00	115.327,09	59,00	59,29	60,00	1.654,00
23-05-24	FIA RVA EMB II	Compra	PETRA	37,53	13.400,00	502.958,70	36,57	37,15	37,71	61.897,00
23-05-24	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	49,12	5.300,00	260.336,00	47,74	49,10	50,90	36.696,00
23-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	32,54	1.500,00	48.812,21	32,37	32,64	33,30	16.368,00
23-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	32,67	900,00	29.403,00	32,37	32,64	33,30	16.368,00
23-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,60	4.500,00	56.700,00	12,33	12,50	12,62	15.734,00
23-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	14,18	6.100,00	86.498,00	14,12	14,20	14,45	7.812,00
23-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	14,14	5.500,00	77.796,54	14,12	14,20	14,45	7.812,00
23-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	14,18	1.500,00	21.270,00	14,12	14,20	14,45	7.812,00
23-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,05	55.700,00	559.785,01	10,01	10,04	10,11	17.604,00
23-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	32,22	17.300,00	557.474,48	32,05	32,18	32,44	26.965,00
23-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	15,70	2.300,00	36.100,52	15,54	15,67	16,01	15.270,00
23-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	15,72	2.500,00	39.289,12	15,54	15,67	16,01	15.270,00
23-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	8,70	9.800,00	85.243,63	8,44	8,74	9,20	32.827,00
23-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	8,83	2.200,00	19.426,00	8,44	8,74	9,20	32.827,00
23-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	8,73	9.300,00	81.223,72	8,44	8,74	9,20	32.827,00
23-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	22,41	100,00	2.241,26	22,22	22,48	23,11	8.701,00
23-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	22,40	4.700,00	105.298,83	22,22	22,48	23,11	8.701,00
23-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	6,11	3.600,00	21.994,86	6,00	6,08	6,24	36.098,00
23-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	6,20	1.100,00	6.820,62	6,00	6,08	6,24	36.098,00
23-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	6,11	5.900,00	36.052,62	6,00	6,08	6,24	36.098,00
23-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	48,31	2.100,00	101.445,69	47,74	49,10	50,90	36.696,00
23-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	47,85	3.300,00	157.905,00	47,74	49,10	50,90	36.696,00
23-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	14,09	500,00	7.045,74	13,22	13,75	14,56	24.257,00
23-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	GGPS3	18,75	6.004,00	112.569,37	18,54	18,74	18,96	6.520,00
23-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	GGPS3	18,80	824,00	15.491,20	18,54	18,74	18,96	6.520,00
23-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	PRIQ3	44,40	1.968,00	87.377,79	43,80	44,28	44,64	24.995,00
23-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	PRIQ3	44,30	6.406,00	283.787,81	43,80	44,28	44,64	24.995,00
23-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	PRIQ3	44,38	150,00	6.656,52	43,80	44,28	44,64	24.995,00
23-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	PRIQ3	44,28	1.819,00	80.540,43	43,80	44,28	44,64	24.995,00
23-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	22,44	1.216,00	27.292,66	22,37	22,57	23,16	16.800,00
23-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	22,63	1.823,00	41.252,75	22,37	22,57	23,16	16.800,00
23-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	22,46	1.519,00	34.116,74	22,37	22,57	23,16	16.800,00
23-05-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	BPML11	95,70	2.223,00	212.745,43	94,27	95,23	96,30	620,00
23-05-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	GZIT11	63,52	5.473,00	347.659,62	63,37	63,59	64,18	487,00
23-05-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	PVBI11	96,27	4.458,00	429.166,07	95,85	96,21	96,79	8.199,00
23-05-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	RBRP11	58,11	6.883,00	400.003,54	57,32	58,02	59,05	7.491,00
24-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	21,36	2.200,00	46.987,63	21,01	21,37	21,61	9.972,00
24-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	B3SA3	11,16	1.000,00	11.160,00	11,01	11,13	11,22	21.051,00
24-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	27,02	600,00	16.210,66	26,80	26,97	27,14	39.834,00
24-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBDC4	12,99	1.000,00	12.993,53	12,87	12,97	13,05	23.195,00
24-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	32,81	700,00	22.969,47	32,69	32,91	33,63	17.377,00
24-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	32,27	1.100,00	35.502,41	31,99	32,25	32,53	21.872,00
24-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPLE3	8,33	1.800,00	14.997,64	8,30	8,35	8,46	10.197,00
24-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPLE6	9,32	2.000,00	18.645,60	9,29	9,34	9,41	18.902,00
24-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	36,32	1.700,00	61.745,07	36,14	36,33	36,63	14.168,00
24-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,79	6.100,00	78.038,54	12,57	12,72	12,88	12.850,00
24-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,80	3.400,00	43.504,87	12,57	12,72	12,88	12.850,00
24-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,62	4.200,00	53.004,00	12,57	12,72	12,88	12.850,00
24-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQL3	30,28	2.600,00	78.731,86	29,69	30,20	30,44	15.512,00
24-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	14,26	300,00	4.278,00	14,14	14,24	14,36	4.100,00
24-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	14,20	100,00	1.420,47	14,14	14,24	14,36	4.100,00
24-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	14,28	300,00	4.285,38	14,14	14,24	14,36	4.100,00
24-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,29	45.900,00	196.722,78	4,23	4,28	4,34	30.971,00
24-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	20,61	100,00	2.060,88	20,22	20,56	20,74	15.267,00
24-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	9,98	59.200,00	590.973,85	9,92	9,98	10,08	47.550,00
24-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,01	8.700,00	87.102,17	9,92	9,98	10,08	47.550,00
24-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	9,97	1.200,00	11.961,62	9,92	9,98	10,08	47.550,00
24-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	31,93	18.100,00	577.988,40	31,73	31,92	32,24	42.756,00
24-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	31,80	2.700,00	85.860,86	31,73	31,92	32,24	42.756,00
24-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	1,34	11.900,00	15.926,92	1,32	1,34	1,41	30.086,00
24-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	15,48	2.200,00	34.045,49	15,43	15,54	15,74	11.191,00
24-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRIQ3	43,76	600,00	26.253,00	43,34	43,77	44,84	23.087,00
24-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	20,39	3.400,00	69.324,78	20,27	20,43	20,61	11.456,00
24-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	19,71	1.100,00	21.679,67	19,52	19,70	19,99	3.562,00
24-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	45,15	1.500,00	67.726,14	44,94	45,29	46,27	18.970,00
24-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	22,30	900,00	20.070,00	21,84	22,04	22,67	7.106,00
24-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	22,06	800,00	17.648,55	21,84	22,04	22,67	7.106,00
24-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	22,00	2.600,00	57.197,69	21,84	22,04	22,67	7.106,00
24-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	22,06	2.100,00	46.331,88	21,84	22,04	22,67	7.106,00
24-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	22,02	1.100,00	24.222,00	21,84	22,04	22,67	7.106,00
24-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	22,10	1.900,00	41.984,62	21,84	22,04	22,67	7.106,00
24-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	6,08	3.800,00	23.086,65	5,98	6,07	6,12	16.234,00
24-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	49,15	1.300,00	63.888,50	48,80	49,34	50,24	36.148,00
24-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	13,70	1.700,00	23.284,61	13,41	13,65	13,94	9.692,00
24-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQL3	30,33	9.161,00	277.840,86	29,69	30,20	30,44	15.512,00
24-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQL3	30,25	3.027,00	91.566,61	29,69	30,20	30,44	15.512,00
24-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQL3	30,38	1.930,00	58.629,21	29,69	30,20	30,44	15.512,00
24-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	GGPS3	18,76	55.096,00	1.033.835,00	18,45	18,66	19,00	4.096,00
24-05-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	EVBI11	98,39	17,00	1.672,65	97,58	98,26	98,50	4,00
24-05-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	RBRP11	57,73	2.242,00	129.436,30	57,50	58,10	58,79	6.933,00
24-05-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	SARE11	47,59	4.202,00	199.981,00	47,00	47,53	47,74	3.710,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – MAIO 2024

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

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



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
24-05-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	TEPP11	95,64	6.274,00	600.045,36	95,07	95,63	96,00	3.884,00
27-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,89	2.600,00	33.514,00	12,75	12,79	12,94	8.602,00
27-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,76	9.600,00	122.470,14	12,75	12,79	12,94	8.602,00
27-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,83	300,00	3.849,00	12,75	12,79	12,94	8.602,00
27-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,81	2.300,00	29.458,11	12,75	12,79	12,94	8.602,00
27-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,26	26.300,00	112.161,16	4,20	4,26	4,30	12.880,00
27-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	20,42	1.400,00	28.590,91	20,27	20,44	20,56	5.393,00
27-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	9,97	88.300,00	880.087,84	9,94	9,96	10,02	8.745,00
27-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	9,96	4.500,00	44.807,30	9,94	9,96	10,02	8.745,00
27-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	31,64	1.400,00	44.300,16	31,60	31,70	31,87	15.602,00
27-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	31,70	27.800,00	881.155,21	31,60	31,70	31,87	15.602,00
27-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	21,74	6.200,00	134.770,94	21,60	21,71	22,10	4.174,00
27-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQLT3	30,42	3.979,00	121.042,71	30,14	30,38	30,55	10.841,00
27-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQLT3	30,44	2.442,00	74.334,15	30,14	30,38	30,55	10.841,00
27-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQLT3	30,44	506,00	15.404,38	30,14	30,38	30,55	10.841,00
27-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	GGPS3	18,70	191,00	3.571,75	18,57	18,63	18,75	3.626,00
27-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	4,26	16.839,00	71.698,83	4,20	4,26	4,30	12.880,00
28-05-24	FIA RVA EMB II	Compra	BPAC11	32,30	3.500,00	113.050,00	32,03	32,35	32,83	27.669,00
28-05-24	FIA RVA EMB II	Compra	ITUB4	31,92	4.100,00	130.868,00	31,50	31,67	32,14	61.787,00
28-05-24	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	64,51	5.400,00	348.353,30	63,35	64,10	65,29	68.562,00
28-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	35,83	1.600,00	57.331,90	35,76	36,09	36,73	20.119,00
28-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,77	8.500,00	108.507,00	12,71	12,77	12,93	14.764,00
28-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,76	3.100,00	39.558,23	12,71	12,77	12,93	14.764,00
28-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	30,00	1.900,00	56.999,59	29,92	30,28	30,75	42.970,00
28-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,19	26.700,00	111.776,32	4,14	4,25	4,37	48.831,00
28-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	15,04	5.000,00	75.199,26	14,83	15,04	15,52	16.208,00
28-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	20,22	9.100,00	184.011,64	19,99	20,24	20,60	23.569,00
28-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQLT3	30,47	2.703,00	82.353,05	29,92	30,28	30,75	42.970,00
28-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQLT3	30,15	638,00	19.237,31	29,92	30,28	30,75	42.970,00
28-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	PRI03	43,91	11.821,00	519.085,64	43,08	43,55	44,35	27.835,00
28-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	23,97	1.424,00	34.126,73	23,82	23,99	24,25	17.160,00
28-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	24,01	5.698,00	136.790,93	23,82	23,99	24,25	17.160,00
28-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	23,90	1.430,00	34.175,18	23,82	23,99	24,25	17.160,00
28-05-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	BMLC11	98,21	19,00	1.865,96	96,51	97,40	98,99	78,00
28-05-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	BPML11	93,90	10.020,00	940.828,40	93,23	93,85	96,99	4.178,00
28-05-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	FIGS11	56,49	3,00	169,48	56,04	56,94	57,49	175,00
28-05-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	GZIT11	61,58	2.188,00	134.737,04	61,51	61,69	63,01	3.283,00
28-05-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	HOF11	30,65	51,00	1.563,15	30,65	30,86	31,17	72,00
28-05-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	MAXR11	82,10	116,00	9.548,31	82,10	82,70	83,00	54,00
28-05-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	RBR11	81,50	23.063,00	1.879.634,69	79,00	81,20	81,79	9.998,00
28-05-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	RBRP11	57,64	5.759,00	331.959,71	57,60	57,72	58,45	3.211,00
28-05-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	SARE11	46,99	1.900,00	89.274,75	46,70	47,16	47,80	2.271,00
29-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	21,22	3.900,00	82.739,51	20,84	21,20	21,50	9.141,00
29-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	B3SA3	11,02	1.500,00	16.529,67	10,85	10,99	11,14	44.527,00
29-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	27,31	1.100,00	30.045,60	27,12	27,47	27,97	76.913,00
29-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	BBDC4	12,79	6.700,00	85.696,89	12,65	12,76	12,85	28.104,00
29-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	32,70	1.300,00	42.513,76	32,14	32,60	32,82	16.049,00
29-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	31,86	1.600,00	50.973,20	31,71	31,88	32,15	25.997,00
29-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ3	8,21	1.200,00	9.852,00	8,15	8,23	8,34	6.317,00
29-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ3	8,26	1.900,00	15.689,32	8,15	8,23	8,34	6.317,00
29-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ6	9,28	800,00	7.420,46	9,13	9,23	9,30	23.953,00
29-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ6	9,22	600,00	5.533,58	9,13	9,23	9,30	23.953,00
29-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	35,41	1.600,00	56.660,85	35,17	35,36	35,63	14.905,00
29-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,52	5.000,00	62.588,30	12,43	12,52	12,70	14.102,00
29-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	29,51	1.100,00	32.458,98	29,33	29,49	29,89	24.991,00
29-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	14,18	3.600,00	51.034,84	14,07	14,18	14,44	7.801,00
29-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,11	28.000,00	115.217,91	4,04	4,12	4,19	33.737,00
29-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	20,50	4.900,00	100.472,69	20,52	20,75	20,75	14.437,00
29-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	9,91	1.500,00	14.867,43	9,85	9,89	9,96	38.176,00
29-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	9,91	27.700,00	274.451,60	9,85	9,89	9,96	38.176,00
29-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITUB4	31,18	7.400,00	230.715,16	30,95	31,30	31,53	52.261,00
29-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	12,30	2.000,00	24.593,40	12,08	12,32	12,63	27.386,00
29-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	14,69	1.000,00	14.689,54	14,47	14,73	14,91	23.299,00
29-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	42,19	900,00	37.972,66	41,95	42,36	43,16	38.511,00
29-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	42,35	1.300,00	55.048,90	41,95	42,36	43,16	38.511,00
29-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	19,79	800,00	15.832,00	19,71	19,83	19,99	13.616,00
29-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	19,88	3.200,00	63.627,05	19,71	19,83	19,99	13.616,00
29-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	19,78	1.900,00	37.588,09	19,67	19,85	20,12	4.786,00
29-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	43,84	1.800,00	78.917,52	43,48	43,87	44,30	37.900,00
29-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	22,29	2.600,00	57.957,75	21,78	22,17	22,41	8.596,00
29-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	5,95	7.700,00	45.826,60	5,90	5,96	6,10	10.523,00
29-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	49,21	2.200,00	108.263,91	48,51	49,17	49,70	18.019,00
29-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	22,46	1.000,00	22.457,03	22,15	22,43	22,61	6.646,00
29-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	12,62	1.300,00	16.412,15	12,16	12,52	12,81	17.316,00
29-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	4,16	23.695,00	98.504,92	4,04	4,12	4,19	33.737,00
29-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	4,10	1.122,00	4.600,20	4,04	4,12	4,19	33.737,00
29-05-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	EVBI11	98,08	892,00	87.486,47	97,19	98,07	98,11	85,00
29-05-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	RBR11	81,75	2.817,00	230.289,85	81,01	81,97	82,21	1.030,00
29-05-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	SARE11	46,75	2.499,00	116.828,25	46,75	47,14	47,50	4.242,00
31-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	20,85	600,00	12.512,73	20,72	20,93	21,27	12.201,00
31-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ3	8,17	2.700,00	22.059,00	8,03	8,12	8,30	8.728,00
31-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ3	8,15	3.900,00	31.804,16	8,03	8,12	8,30	8.728,00
31-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	34,96	400,00	13.982,14	34,79	34,92	35,26	18.492,00
31-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	29,32	600,00	17.591,13	29,18	29,32	29,61	15.817,00
31-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	29,50	4.453,00	131.363,50	29,18	29,32	29,61	15.817,00
31-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,01	41.500,00	166.368,49	3,96	4,00	4,15	29.342,00

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

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



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
31-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	20,31	800,00	16.248,51	20,21	20,29	20,47	12.273,00
31-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRIQ3	42,50	700,00	29.750,51	41,39	41,73	42,58	27.762,00
31-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRIQ3	41,78	3.600,00	150.423,14	41,39	41,73	42,58	27.762,00
31-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	19,62	800,00	15.693,48	19,45	19,65	19,83	20.504,00
31-05-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	42,85	3.400,00	145.693,76	42,35	42,88	43,99	35.916,00
31-05-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	48,77	400,00	19.509,05	48,63	48,82	49,60	31.807,00
31-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQTL3	29,40	13.668,00	401.838,40	29,18	29,32	29,61	15.817,00
31-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	EQTL9	29,50	4.748,00	140.066,00	29,18	29,32	29,61	15.817,00
31-05-24	FIA RVA EMB IV	Venda	GMAT3	7,85	38.383,00	301.306,55	7,71	7,81	7,88	8.435,00
31-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	4,01	2.415,00	9.684,15	3,96	4,00	4,15	29.342,00
31-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	4,00	22.823,00	91.319,80	3,96	4,00	4,15	29.342,00
31-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	PRIQ3	41,55	1.059,00	44.002,32	41,39	41,73	42,58	27.762,00
31-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	PRIQ3	41,50	1.341,00	55.651,39	41,39	41,73	42,58	27.762,00
31-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	23,42	4.033,00	94.453,29	23,07	23,23	23,58	25.771,00
31-05-24	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	23,33	4.517,00	105.396,65	23,07	23,23	23,58	25.771,00
31-05-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	EQTL9	29,50	885,00	26.107,50	29,18	29,32	29,61	15.817,00

7. RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS

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

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

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

8. GLOSSÁRIO

Administrador

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

Carteira

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

Dados Gerais

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

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

Duration

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

Vide também glossário de Valor Presente.

ETL (Expected Tail Loss)

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

Fundo de Investimento

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

Índice de Referência (*Benchmark*)

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

LDI (*Liability Driven Investments*)

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

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

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

Patrimônio de Cobertura

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

Patrimônio Líquido (PL)

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

Rating

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

Stress Testing

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

Tracking Error

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

Túnel de Preços

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

Valor Presente

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

Value at Risk (VaR)

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