



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO

Março/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 – MARÇO 2024



Data: 28/03/2024

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS
 CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais		Limites	
PL:	4.803.374.009,28	VAR / PL:	1,3939%
VAR:	87.243.012,69	ETL / PL:	1,7555%
ETL:	84.325.450,74	VAR / CDI:	0,0154%
Limite Fundo:		Status:	ENQUADRADO
Benchmark:		Duração DC:	0,00%
		Duração DU:	1,705,11
			1,173,59

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	173.716.650,13	Cenário Baixa - 10000 (+):	384.513.281,38	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	540.706.335,92
Cenário Alta - 09999 (-):	(270.624.244,79)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(282.030.238,59)	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	(250.780.771,10)
Cenário Alta - 09999:	(96.907.594,66)	Cenário Baixa - 10000:	102.483.042,79	CENÁRIO BRADESCO 1:	289.925.564,83
				CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	35.955.387,62
				CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(369.572.282,59)
				CENÁRIO BRADESCO 2:	(333.616.894,97)

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

Produto	MtM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
RSAN44	11.100.394,65	124.075,95	118.879,18	0,18%	328.230,70	-345.506,00	126.627,95	-127.664,47
SANB11	43.464,48	1.606,44	538,57	0,00%	946.755,43	-946.755,43	555.177,38	-559.721,81
SBFG3	863.765,00	110.755,83	23.515,90	0,03%	-312.734,71	-91.910,46	42.105,25	-56.815,67
SSSP3	3.767.021,70	359.274,23	259.095,51	0,39%	-3.929,91	3.203,35	4.581,35	-6.553,78
SBSPC7	2.419.985,86	430,66	371,62	0,00%	105.446,40	-105.446,40	25.764,07	-25.974,96
SCAR3	175.744,00	19.274,98	12.105,91	0,02%	12.295,25	-12.295,25	6.008,28	-6.057,46
SLCE3	40.984,16	1.743,44	-24,47	0,00%	-13.899,56	11.463,51	16.253,16	-22.912,58
SMFT16	5.939.376,41	1.592,97	1.399,31	0,00%	1.421.680,00	-1.421.680,00	521.045,72	-525.310,76
SMFT3	3.554.200,00	239.773,95	-5.744,31	-0,01%	49.002,58	-49.002,58	23.945,93	-24.141,94
SMT03	163.341,92	22.154,91	-18.852,07	-0,03%	-259,70	215,66	351,42	-521,84
SNGO18	1.404.614,59	18,23	15,45	0,00%	834.621,42	-834.621,42	407.851,67	-411.190,15
SOMA3	2.782.071,41	291.396,28	93.540,06	0,14%	0,00	0,00	0,00	0,00
SRNA3	1.759.670,00	224.605,24	145.878,02	0,22%	76.456,80	-76.456,80	32.024,48	-32.286,61
STBP3	218.448,00	30.282,02	-11.443,94	-0,02%	3.348.137,38	-2.678.509,90	1.963.347,76	-1.979.418,82
SUBZ3	13.392.549,52	1.650.957,92	-926.081,19	-1,38%	30.609,33	-30.609,33	17.949,31	-18.096,24
TAEI11	122.437,32	6.738,92	104,07	0,00%	-80.572,10	-21.749,17	16.546,64	-22.353,39
TBSP11	2.672.493,10	341,61	296,79	0,00%	-3.152,02	2.580,06	3.707,25	-5.291,86
TCI11	10.496.285,58	260.707,73	229.306,72	0,34%	-1.327.362,35	5.341,58	535.389,56	-561.599,93
TEPP11	4.432.177,27	123.801,41	29.028,15	0,04%	2.216.088,64	-2.216.088,64	649.757,19	-655.075,80
TERMO_RF_PRE	137.270,34	2,00	0,41	0,00%	-3,92	4,00	14,11	-21,47
TIMS3	1.359.795,40	84.018,43	30.612,83	0,05%	435.134,53	-312.752,94	199.346,01	-200.977,76
TOTS3	1.584.852,72	107.394,25	35.738,18	0,05%	316.970,54	-316.970,54	232.339,41	-234.241,23
TRPL4	30.776,80	3.494,73	2.752,20	0,00%	6.155,36	-7.694,20	4.511,88	-4.548,81
TRXF11	9.442.681,50	324.908,08	257.426,59	0,38%	4.721.340,75	-4.721.340,75	1.384.297,11	-1.395.628,33
TRXF13	1.432.208,10	46.778,46	38.114,41	0,06%	0,00	0,00	0,00	0,00
UGFA3	13.105.481,22	1.751.864,96	1.329.505,54	1,98%	3.276.370,31	-2.621.096,24	1.921.263,55	-1.936.990,12
UNEG11	14.874.038,29	462.500,08	395.755,08	0,59%	-2.107.344,35	64.654,62	889.881,18	-1.102.837,65
USIM5	148.798,95	25.816,44	16.599,45	0,02%	53.031,47	-32.735,70	21.813,98	-21.992,44
UTPS21	6.661.687,84	186.156,12	151.313,07	0,23%	-823.367,02	-368,67	321.965,42	-406.203,26
VALE3	21.135.748,48	1.100.012,62	662.970,74	0,99%	5.283.937,12	-5.283.937,12	3.098.500,73	-3.123.863,63
VAMO22	1.060.419,20	32,40	27,58	0,00%	-367,35	289,93	435,25	-637,93
VAMO3	109.744,05	15.375,86	1.546,66	0,00%	38.410,42	-43.897,62	16.088,48	-16.220,17
VAMO33	4.184.049,72	71.704,00	66.314,87	0,10%	-432.472,41	-19.423,58	148.234,60	-191.683,84
VAMO34	7.458.894,76	135.468,30	122.228,48	0,18%	-767.761,45	-27.989,29	267.932,70	-345.747,10
VBBR3	1.255.062,86	632.213,36	300.960,05	0,45%	1.821.265,72	-1.821.265,72	1.067.990,22	-1.076.732,29
VCCS11	2.449.576,02	954,31	857,57	0,00%	-7.822,86	6.549,08	9.228,45	-12.687,15
VECS11	3.543.342,35	26,59	22,56	0,00%	-418,43	354,53	595,28	-887,31
VERDECS2	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
VERO12	8.257.751,86	106.589,86	102.930,77	0,15%	-731.470,20	-107.495,07	198.892,90	-260.827,07
VIMT13	9.193.288,96	228.039,03	198.512,26	0,28%	-1.066.964,55	-26.684,98	398.267,27	-503.551,56
VIVA3	665.480,00	193.278,49	159.058,93	0,24%	199.644,00	-199.644,00	97.559,37	-98.357,94
VIVT3	2.508.090,20	265.795,32	161.995,78	0,24%	376.213,53	-376.213,53	367.686,02	-370.695,73
VIXL14	2.120.117,08	63,03	53,86	0,00%	-788,35	642,30	986,27	-1.455,20
VRDN12	10.096.783,25	218.508,65	186.263,07	0,28%	-1.084.575,35	-62.513,17	375.048,58	-479.405,07
VVMR11	4.119.412,05	177.032,66	22.571,82	0,03%	0,00	0,00	0,00	0,00
VVRT11	2.584.860,14	190,28	163,87	0,00%	-1.851,69	1.509,18	2.196,75	-3.167,13
WDOJ24	-6.428,10	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
WDOK24	-117.794,38	367.649,25	112.119,37	0,17%	-2.163.847,37	2.202.521,64	-2.822.449,82	2.838.568,68
WEGE3	6.030.214,20	678.390,01	-269.748,66	-0,40%	1.257.553,55	-1.257.553,55	737.429,40	-743.465,66
WINJ24	6.592,00	79.488,26	71.070,89	0,11%	371.854,09	-371.881,03	298.942,86	-300.994,89
XPRN11	2.462.518,00	81.475,55	18.447,28	0,03%	1.231.259,00	-1.231.259,00	361.005,14	-363.960,16
XPRN13	2.344.298,00	458.765,61	244.183,29	0,36%	1.172.149,00	-1.172.149,00	343.874,09	-346.487,24
YDUQ3	3.530.327,18	533.760,10	172.131,72	0,26%	1.376.827,60	-892.581,80	517.545,97	-521.782,36
Total Var:	4.963.466.968,35	106.598.273,64	67.243.012,69	99,98%	-96.907.594,66	102.483.042,80	289.925.564,83	-333.616.894,97

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – MARÇO 2024



bradesco

Data: 28/03/2024

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: EMBRAERPREV RENDA FIXA
CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais		Limite Fundo:		0,00%		Duration DC:	
PL:	3.892.565.931,64	VAR / PL:	1,4085%	Status:	ENQUADRADO	Duration DU:	2,007,60
VAR:	54.828.351,33	ETL / PL:	1,7664%	Benchmark:			1,381,06
ETL:	68.756.964,54	VAR / CDI:	0,0155%				

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (+):	225.944.126,26	CENARIO BRADESCO 1 (+):	199.566.372,30	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
Cenário Alta - 09999 (-):	(219.001.813,13)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(3.663.894,79)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(227.697.154,52)
Cenário Alta - 09999:	(219.001.813,13)	Cenário Baixa - 10000:	222.280.231,48	CENARIO BRADESCO 1:	199.566.372,30	CENARIO BRADESCO 2:	(227.697.154,52)

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

Produto	MmM	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	3.089.019.951,65	44.704.040,62	44.572.779,89	81,30%	-158.396.221,60	217.316.148,98	175.136.947,78	-197.963.504,72
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	133.526.745,58	730.283,62	680.133,47	1,24%	-7.243.367,41	-1.552.438,31	1.534.292,63	-2.026.404,66
FIM EMB II A	224.909.731,36	477.485,32	456.421,17	0,83%	-1.969.245,41	2.281.717,19	1.468.992,74	-1.957.248,16
FIM EMB VI A CRED PRIV	278.844.735,69	2.701.990,28	2.581.224,93	4,71%	-12.376.133,28	6.346.260,10	7.804.511,12	-8.474.677,48
FIM EMB VII A CRED PRIV	370.918.951,57	7.216.798,74	6.537.791,86	11,92%	-39.016.845,44	-2.111.456,48	13.621.628,03	-17.275.319,50
Total Var:	4.097.220.115,84	55.830.598,57	54.828.351,33	100,00%	-219.001.813,13	222.280.231,48	199.566.372,30	-227.697.154,52



bradesco

Data: 28/03/2024

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL
CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais		Limite Fundo:		0,00%		Duration DC:	
PL:	526.709.456,91	VAR / PL:	3,3606%	Status:	ENQUADRADO	Duration DU:	5,15
VAR:	17.700.562,81	ETL / PL:	4,2143%	Benchmark:			1,80
ETL:	22.197.219,87	VAR / CDI:	0,0369%				

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	129.519.032,48	Cenário Baixa - 10000 (+):	-	CENARIO BRADESCO 1 (+):	67.258.398,01	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
Cenário Alta - 09999 (-):	-	Cenário Baixa - 10000 (-):	(126.840.199,48)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(67.811.886,05)
Cenário Alta - 09999:	129.519.032,48	Cenário Baixa - 10000:	(126.840.199,48)	CENARIO BRADESCO 1:	67.258.398,01	CENARIO BRADESCO 2:	(67.811.886,05)

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

Produto	MmM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
CAIXA	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
FIA RVA EMB II	109.729.341,06	3.984.858,29	3.954.727,40	22,34%	28.783.320,82	-28.814.056,26	15.698.510,00	-15.826.802,81
FIA RVA EMB III	117.360.128,87	3.801.553,05	3.344.069,06	18,89%	32.562.331,99	-31.083.278,59	14.376.992,36	-14.497.690,55
FIA RVA EMB IV	110.328.725,26	3.488.950,43	3.286.233,07	18,57%	31.433.354,78	-29.871.666,58	14.931.136,77	-15.053.893,63
FIC FIA EMB VIII ETF	71.838.159,54	2.803.862,56	2.759.115,38	15,99%	6.458.891,67	-6.458.891,59	5.268.791,42	-5.301.845,95
FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES RVA EMB VI	117.453.070,82	4.410.703,06	4.356.417,90	24,61%	30.283.143,22	-30.614.316,48	16.992.967,45	-17.131.653,21
Total Var:	526.709.425,56	18.489.727,38	17.700.562,81	100,00%	129.519.032,48	-126.840.199,48	67.258.398,01	-67.811.886,05

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – MARÇO 2024



bradesco

Data: 28/03/2024

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FI RF EMB II
CNPJ: 11005764000196

Dados Gerais		Limite Fundo:	
PL:	2.973.389.620,78	VAR / PL:	1,5035%
VAR:	44.703.965,35	ETL / PL:	1,8854%
ETL:	56.060.576,06	VAR / CDI:	0,0165%
Status:	ENQUADRADO	Dutacion DC:	0,00%
Benchmark:		Dutacion DU:	1,546,73

Cenários de STRESS			
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (+):	218.074.866,89
Cenário Alta - 09999 (-):	(158.395.954,89)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(759.083,82)
Cenário Alta - 09999:	(158.395.954,89)	Cenário Baixa - 10000:	217.315.783,07

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
CSMG3	8.343.982,84	21.208,70	8.428,64	0,02%	0,00	0,00	0,00	0,00
ELET42	15.014.158,90	194.206,01	188.360,12	0,42%	0,00	0,00	0,00	0,00
ENTV12	13.940.670,29	192.275,42	185.743,00	0,42%	-27.914,71	28.470,84	100.341,88	-152.727,89
GASP17	50.721.794,15	570.518,89	570.518,89	0,49%	0,00	0,00	0,00	0,00
IGSN15	2.696.591,98	53.701,87	45.296,77	0,10%	-303.208,22	-125.106,50	28.026,20	-37.861,09
NEOE16	7.703.168,03	101.460,81	98.673,62	0,22%	0,00	0,00	0,00	0,00
NTNB20240815 - 760199_VENCIMENTO	125.130.161,52	372.159,48	261.347,26	0,58%	-1.329.959,97	-226.131,08	344.180,46	-453.080,17
NTNB20260815 - 760199_VENCIMENTO	43.104.954,40	295.031,29	255.960,69	0,57%	-1.298.389,86	-147.284,46	382.624,22	-499.218,00
NTNB20300815 - 760199_VENCIMENTO	26.731.246,72	367.422,97	364.951,95	0,82%	-1.324.709,10	1.587.978,78	1.084.656,96	-1.430.703,75
NTNB20350515 - 760199_VENCIMENTO	243.209.874,29	4.556.814,12	4.542.195,59	10,16%	-279.198,80	-19.993,02	93.568,55	-119.846,93
NTNB20400815 - 760199_VENCIMENTO	29.876.478,36	656.013,22	655.454,52	1,47%	-698.369,68	-116.931,66	182.817,41	-240.444,56
NTNB20450515 - 760199_VENCIMENTO	231.956.556,78	5.610.544,92	5.606.429,69	12,54%	-709.229,98	693.331,13	543.863,33	-734.273,35
NTNB20500815 - 760199_VENCIMENTO	727.163.306,70	20.868.924,22	20.859.463,27	46,66%	-1.065.681,83	1.109.744,05	809.594,22	-1.074.021,97
NTNB20550515 - 760199_VENCIMENTO	232.505.300,80	7.015.250,96	7.008.757,91	15,58%	-1.424.887,46	1.488.719,72	1.228.648,93	-1.572.458,62
PETRA5	9.584.770,54	29.603,10	11.799,55	0,03%	-17.474.268,84	21.212.871,31	17.551.358,05	-21.566.852,06
SBSPC2	4.901.452,27	14.694,04	-311,83	0,00%	-2.730.526,64	3.479.541,91	2.879.455,49	-3.402.785,25
BBTOPIND	340.050.028,76	4.440.413,66	4.388.274,29	9,82%	-21.550.220,13	34.472.936,53	25.851.926,51	-29.591.616,68
CAIXA	5.000,00	0,00	0,00	0,00%	-80.750.784,31	114.985.597,41	92.534.536,23	-102.838.593,65
COMPROMISSADA_PRE	976.487.038,95	14.227,47	3.279,93	0,01%	-27.053.907,97	39.015.676,21	31.474.394,99	-34.185.784,93
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-112.785,89	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-177.647,08	-71.603,30	22.862,17	-30.938,26
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-177.050,32	-52.033,81	23.837,29	-32.164,25
Total Var:	3.089.014.750,38	45.374.468,14	44.703.965,35	100,01%	-158.395.954,89	217.315.783,07	175.136.652,89	-197.963.171,39

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FI RF EMB V CREDITO PRIVADO
CNPJ: 20726178000121

Dados Gerais		Limite Fundo:	
PL:	127.915.856,41	VAR / PL:	0,5709%
VAR:	730.283,62	ETL / PL:	0,7159%
ETL:	915.805,12	VAR / CDI:	0,0063%
Status:	ENQUADRADO	Dutacion DC:	0,00%
Benchmark:		Dutacion DU:	715,01

Cenários de STRESS			
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (+):	328.558,03
Cenário Alta - 09999 (-):	(7.243.367,41)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(1.880.996,33)
Cenário Alta - 09999:	(7.243.367,41)	Cenário Baixa - 10000:	(1.552.438,30)

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
17H0164854	7.355.113,05	47.879,15	47.073,00	6,45%	-420.478,39	-128.848,53	68.158,88	-91.009,27
AEGP23	15.501.194,46	44.843,65	35.663,00	4,88%	-580.866,71	-263.450,20	43.582,32	-58.908,97
CCRDD1	3.260.562,61	8.831,89	2.346,55	0,32%	0,00	0,00	0,00	0,00
CMDD33	707.848,85	2.122,06	542,85	0,07%	-80.725,70	-21.376,61	13.218,69	-17.851,10
ENUG21	1.700.342,51	10.009,64	9.866,04	1,38%	-25.568,93	-7.514,52	3.442,49	-4.845,04
ENM12	1.066.073,29	6.664,89	6.567,39	0,90%	-10,49	10,70	37,69	-57,37
ENTV12	18.326.172,82	252.762,06	240.958,88	3,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ERDV17_VENCIMENTO	13.569.072,83	38.476,89	31.030,50	4,25%	0,00	0,00	0,00	0,00
ERDV36	2.174.001,98	6.030,91	1.486,16	0,20%	-92.573,17	-30.108,32	13.958,07	-18.660,66
GASP17	10.494.164,31	118.038,39	55.190,60	7,56%	-60.976,57	-19.764,56	9.249,14	-12.362,82
GRRB24_VENCIMENTO	16.787.146,62	219.280,26	210.618,58	28,84%	-1.706.841,67	-193.617,70	502.991,42	-656.263,67
LFSN1600GM	15.289.635,45	41.526,02	6.981,71	0,96%	-478.090,17	-224.390,28	29.861,52	-40.381,40
LFSN1800DC5	5.095.527,43	19.277,49	14.873,68	2,04%	-54.861,24	-14.384,24	9.046,05	-12.216,06
OMGE31	13.778.608,04	64.841,15	58.660,84	8,03%	-274.077,75	328.547,33	224.411,79	-296.007,67
SBSPC2	3.756.279,85	11.260,93	2.880,68	0,39%	-1.524.918,15	-263.708,54	393.663,66	-518.061,81
TAE33	4.306.190,59	13.203,83	5.541,83	0,76%	-501.804,44	-135.269,57	74.963,35	-101.145,02
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	-319.966,86	-145.352,97	22.785,65	-30.759,67
COMPROMISSADA_PRE	366.825,45	5,34	1,33	0,00%	-895.250,68	-371.584,48	90.107,34	-121.071,32
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-29.014,58	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-135.684,39	-39.876,66	18.267,96	-24.649,42
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-90.672,10	-21.749,17	16.546,64	-22.353,39
Total Var:	133.526.745,56	905.054,55	730.283,62	100,00%	-7.243.367,41	-1.552.438,31	1.534.292,63	-2.026.404,66

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – MARÇO 2024



Relatório de Risco de Mercado

Data: 28/03/2024

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

Dados Gerais			Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	1.008,87
PL:	262.692.148,16	VAR / PL:	1,0286%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:
VAR:	2.701.990,14	ETL / PL:	1,2899%	Benchmark:		
ETL:	3.388.404,64	VAR / CDI:	0,0113%			694,60

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	300.237,20	Cenário Baixa - 10000 (+):	12.780.207,65	CENARIO BRADESCO 1 (+):	18.876.585,16	CENARIO BRADESCO 2 (+):	272.867,03
Cenário Alta - 09999 (-):	(12.676.369,83)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(6.433.947,88)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(11.072.074,45)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(8.747.544,07)
Cenário Alta - 09999:	(12.376.132,63)	Cenário Baixa - 10000:	6.346.259,76	CENARIO BRADESCO 1:	7.804.510,71	CENARIO BRADESCO 2:	(8.474.677,03)

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
020913	1.102.381,29	48.305,88	-20.346,89	-0,75%	0,00	0,00	0,00	0,00
AEGA1	1.867.496,70	734,98	673,01	0,02%	-6.203,92	5.146,56	7.257,93	-10.092,70
APRB28	1.158.485,14	35,46	31,86	0,00%	-346,88	282,77	413,50	-598,50
ARTRA1	2.555.493,79	125,76	112,83	0,00%	-1.290,30	1.045,58	1.532,27	-2.226,73
BCBF15	2.080.330,94	30,20	26,88	0,00%	-413,65	337,64	562,99	-821,01
BKBR18	2.656.122,22	0,83	-0,22	0,00%	-5,52	5,61	19,37	-29,45
BRELETR0	1.823.933,77	43.721,14	20.054,85	0,74%	0,00	0,00	0,00	0,00
BRKPA0	3.429.035,48	543,43	487,46	0,02%	-5.093,35	4.122,72	5.889,54	-8.477,80
CAEC11	2.502.076,31	41,08	36,93	0,00%	-540,73	440,72	682,80	-1.009,56
CAXA	10.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CART13	1.005.106,52	21.850,10	19.082,83	0,71%	-109.944,76	-5.887,59	38.339,13	-48.945,11
CBAN22	6.316.625,17	18.422,49	17.085,92	0,63%	-124.323,12	108.134,57	146.087,54	-189.387,91
CEAB22	1.709.597,74	239,56	216,89	0,01%	-2.205,08	1.804,30	2.594,21	-3.703,67
CELG12	3.211.075,32	64,37	57,84	0,00%	-776,82	635,49	984,97	-1.454,71
CGBP13	2.743.688,61	588,45	538,51	0,02%	-5.047,20	4.178,61	5.915,17	-8.253,16
CLI12	2.613.669,86	2.070,77	1.915,12	0,07%	-16.595,86	14.068,58	19.960,36	-26.831,36
COMPROMISSADA_PRE	40.773.926,91	594,08	121,06	0,00%	-1.165,60	1.188,82	4.189,85	-6.377,26
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-97.752,82	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CSAN23	1.114.203,40	705,97	653,71	0,02%	-5.583,55	4.752,30	6.740,47	-9.022,77
CSMG88	2.830.452,65	36.898,12	35.723,73	1,32%	-253.392,20	-36.170,65	69.676,61	-91.270,89
DAPK25	-12.401,64	187.159,65	161.274,10	5,97%	-765.807,50	716.779,37	508.547,49	-507.080,20
DAPK27	6.854,66	263.129,86	257.913,14	9,55%	-1.106.959,60	973.369,96	902.487,31	-953.477,40
DAPK29	2.634,07	56.898,30	52.301,95	1,94%	-221.522,69	193.436,22	198.525,70	-190.574,09
DAPK35	-1.274,12	31.518,16	-28.822,62	-1,07%	143.012,70	-130.832,55	-144.152,73	130.480,81
DAPQ24	-1.157,40	271.282,36	244.180,69	9,04%	-263.992,50	252.929,06	229.002,87	-229.794,04
DAPQ26	12.564,72	610.459,14	566.806,44	20,98%	-2.305.248,66	2.052.274,40	1.828.062,74	-1.802.183,22
DAPQ28	6.789,68	241.239,68	228.464,55	8,46%	-956.154,46	838.165,09	827.484,79	-800.127,48
DAPQ30	149,64	35.306,34	-32.526,15	-1,20%	147.314,81	-129.943,03	-134.224,52	127.297,31
DAPQ32	936,75	25.454,96	23.302,75	0,86%	-111.154,74	99.107,25	102.119,00	-99.570,22
DASAA2	1.347.895,52	0,73	-0,19	0,00%	-10,97	11,18	31,23	-47,30
DESK13	2.774.872,47	475,64	432,44	0,02%	-4.256,31	3.498,47	5.006,53	-7.091,77
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DHF27	-3.879,98	21.760,55	19.732,22	0,73%	-177.210,43	146.286,87	200.537,25	-280.109,09
DHN26	-1.060,06	7.787,15	6.968,20	0,26%	-65.495,42	52.908,82	73.170,54	-103.914,69
ELET24	2.656.419,44	537,75	489,13	0,02%	-4.683,23	3.846,60	5.421,17	-7.635,97
GUAR15	2.704.850,73	220,42	197,87	0,01%	-2.198,32	1.785,10	2.625,64	-3.807,94
HAFV22	594.022,43	163,82	149,99	0,01%	-1.378,75	1.143,86	1.612,14	-2.242,93
HZTC14	2.652.636,14	54.339,85	47.377,71	1,75%	-272.160,35	-15.335,18	94.404,84	-120.397,60
IDV24P410000	136,50	227,27	190,33	0,01%	-136,50	612,427,67	1.177.231,73	-136,50
IDV24P410100	-349,44	541,89	-453,82	-0,02%	349,44	-638.392,15	-1.203.333,96	349,44
IDV24P410200	-6.940,81	9.792,63	-8.201,16	-0,30%	6.940,81	-5.178.453,09	-3.585.245,78	6.940,81
IDV24P410300	13.493,24	15.515,56	12.994,02	0,48%	-13.493,24	3.368.575,61	6.134.620,84	-13.493,24
IDV24P410400	16.978,29	17.048,58	14.271,19	0,53%	-16.978,29	2.066.531,36	3.708.753,27	-16.978,29
IGTA37	2.062.093,04	55,13	-44,59	0,00%	1.463,22	-1.271,18	-2.220,73	3.384,72
INSSSN1	1.301.282,36	105.028,47	42.796,33	1,58%	0,00	0,00	0,00	0,00
IRJS14	3.326.087,26	111.658,32	97.923,09	3,62%	-538.190,71	31.598,06	240.420,54	-293.160,66
IVIA18	2.669.608,97	63,74	57,04	0,00%	-745,34	606,26	939,07	-1.383,25
JSMLE5	3.308.859,62	59.952,70	56.485,62	2,05%	-345.357,41	-12.844,12	120.043,37	-155.017,08
LCAMD1	7.588.682,84	141.227,93	130.161,80	4,82%	-801.622,60	-23.912,79	282.641,04	-364.781,39
LF001800FAU	4.666.048,33	63.194,54	59.819,46	2,21%	-466.508,15	-82.897,85	102.521,88	-158.716,21
LF0021003Q1	2.543.592,68	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002200IO9	2.527.698,60	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002308Z9P	5.358.917,85	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002308ZK1	5.375.911,73	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFSC190054B	923.404,64	0,00	0,00	0,00%	308,56	-313,82	-790,05	1.203,80
LFSC190059S	1.398.645,75	0,00	0,00	0,00%	481,63	-489,85	-1.219,82	1.858,66
LFSC19005L1	925.242,25	0,00	0,00	0,00%	366,02	-371,83	-893,47	1.346,30
LFSC22002IX	4.833.368,38	941,32	845,36	0,03%	-8.780,75	7.153,63	10.231,48	-14.689,24
LFNS210029N	4.554.849,64	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFNS2301ERT	4.425.711,45	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20240901 - 210100	1.229.494,39	152,70	67,59	0,00%	-1.181,41	1.318,59	-3,40	5,18
LFT20250901 - 210100	20.382.517,73	2.863,33	86,05	0,00%	-77.794,70	120.512,75	1.631,71	-2.483,98
LIGHB4	4.044.450,68	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LIGHD3	970.166,10	210,58	191,76	0,01%	-1.820,66	1.496,77	2.105,06	-2.959,33
LMTP17	2.726.537,08	179,98	161,01	0,01%	-1.938,19	1.568,48	2.352,86	-3.450,43
LRENB1	682.869,14	0,88	0,67	0,00%	-28,89	26,43	50,62	-76,11
MANT12	2.748.789,24	1.201,59	1.107,15	0,04%	-9.878,22	8.291,50	11.743,59	-16.041,39
MOVIZ7	1.149.774,82	536,80	491,65	0,02%	-4.529,07	3.756,44	5.293,08	-7.354,70
MTRJ19	2.875.338,23	37.259,17	35.674,49	1,32%	-250.459,05	-32.113,90	71.963,80	-93.599,06
NTEM11	3.230.851,93	32.706,31	31.702,53	1,17%	-237.499,64	-49.938,67	62.313,96	-81.833,88
NTNB20240815 - 760199_NEGOCIACAO	6.485.741,84	19.589,76	18.854,85	0,59%	-36.760,78	35.936,71	28.189,50	-38.058,83
NTNB20250515 - 760199_NEGOCIACAO	608.712,51	2.876,15	2.886,80	0,10%	-9.625,82	9.357,25	5.748,45	-7.710,19
NTNB20260815 - 760199_NEGOCIACAO	6.750.235,86	46.201,90	44.612,38	1,65%	-170.017,78	173.785,92	128.776,19	-168.191,84
NTNB20270515 - 760199_NEGOCIACAO	5.103.904,92	40.308,35	39.535,61	1,46%	-156.787,36	162.104,46	121.448,91	-160.033,09
NTNB20280815 - 760199_NEGOCIACAO	10.127.621,06	109.202,42	104.209,18	3,86%	-407.937,06	423.107,08	334.954,41	-436.273,77
NTNB20290815 - 760199_NEGOCIACAO	1.126.004,62	32.315,31	30.286,78	1,12%	-125.041,73	178.053,97	143.288,74	-159.244,46
NTSD36	2.888.097,05	2.666,83	2.483,27	0,09%	-20.240,52	17.715,08	25.470,70	-32.490,22
OMGE13	3.109.673,54	781,83	714,58	0,03%	-6.721,48	5.554,11	7.844,69	-10.969,24
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
OVSA10	1.826.225,56	76,03	68,22	0,00%	-864,01	708,58	1.088,15	-1.600,15
PASN12	3.719.018,92	35.255,51	34.074,24	1,26%	-281.078,72	-56.284,68	66.853,19	-87.818,05
RAHD11	3.697.103,29	91.297,39	79.430,95	2,94%	-448.897,90	-2.041,98	177.082,18	-220.268,47
RBCAPMZ	556.856,83	2.109,80	-219,08	-0,01%	0,00	0,00	0,00	0,00
RDCO10	3.827.543,21	210,90	188,85	0,01%	-2.206,44	1.799,04	2.697,86	-3.937,78

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – MARÇO 2024



Relatório de Risco de Mercado

Data: 28/03/2024

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

Dados Gerais									
PL:	262.692.148,16	VAR / PL:	1,0286%	Limite Fundo:	0,00%	Dutation DC:	1.008,87		
VAR:	2.701.990,14	ETL / PL:	1,2899%	Status:	ENQUADRADO	Dutation DU:	694,60		
ETL:	3.388.404,64	VAR / CDI:	0,0113%	Benchmark:					

Cenários de STRESS									
Cenário Alta - 09999 (+):	300.237,20	Cenário Baixa - 10000 (+):	12.780.207,65	CENARIO BRADESCO 1 (+):	18.876.585,16	CENARIO BRADESCO 2 (+):	272.867,03		
Cenário Alta - 09999 (-):	(12.676.369,83)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(6.433.947,88)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(11.072.074,45)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(8.747.544,07)		
Cenário Alta - 09999:	(12.376.132,63)	Cenário Baixa - 10000:	6.346.259,76	CENARIO BRADESCO 1:	7.804.510,71	CENARIO BRADESCO 2:	(8.474.677,03)		

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

Produto	MTM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
RDORB9	1.104.591,52	671,02	621,36	0,02%	-5.306,38	4.516,29	6.405,86	-8.572,65
RDORC9	1.579.565,87	959,55	888,55	0,03%	-7.588,13	6.458,29	9.160,38	-12.258,89
RIS412	2.814.493,54	66.826,49	57.436,17	2,13%	-320.962,74	-11.717,54	115.400,05	-147.619,10
RLOG11	998.095,66	9,39	8,46	0,00%	-142,68	117,75	190,73	-283,78
RODB11	2.937.991,65	2.559,90	2.361,84	0,09%	-20.718,70	17.453,58	24.699,48	-33.618,61
RSAN24	1.834.106,40	41,54	37,19	0,00%	-524,24	431,06	676,65	-1.000,15
RSAN44	900.539,06	10.065,88	9.772,96	0,36%	-74.444,73	-11.381,71	19.889,66	-23.999,02
SMFT16	2.594.172,07	695,77	633,47	0,02%	-6.070,98	5.006,98	7.099,98	-10.007,65
SNGO18	1.404.614,89	18,23	16,34	0,00%	-259,70	215,66	351,42	-521,84
TBSP11	2.672.493,10	341,61	309,28	0,01%	-3.152,02	2.580,06	3.707,25	-5.291,86
UNEG11	4.762.246,93	154.482,90	128.663,50	4,76%	-674.712,14	20.700,65	284.914,82	-353.097,53
VAMO33	2.876.451,30	49.295,08	46.242,06	1,71%	-297.316,22	-13.353,33	101.908,35	-131.778,85
VCCS11	2.449.576,02	954,31	878,29	0,03%	-7.822,86	6.549,08	9.228,45	-12.687,15
VECS11	3.543.342,35	26,59	23,88	0,00%	-418,43	354,53	595,28	-887,31
VERDECS2	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
VIXL14	2.120.117,08	63,03	56,51	0,00%	-788,35	642,30	986,27	-1.455,20
VVRT11	2.584.860,14	190,28	171,52	0,01%	-1.851,69	1.509,18	2.196,75	-3.167,13
Total Var:	278.844.721,06	3.252.651,75	2.701.990,14	99,99%	-12.376.132,63	6.346.259,76	7.804.510,71	-8.474.677,03

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – MARÇO 2024



Relatório de Risco de Mercado

Data: 28/03/2024

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

Dados Gerais			
PL:	311.192.967,08	VAR / PL:	2,3158%
VAR:	7.206.526,99	ETL / PL:	2,9041%
ETL:	9.037.275,59	VAR / CDI:	0,0254%
Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	1,940,93
Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1,336,05
Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	-	Cenário Baixa - 10000 (+):	400.354,16	CENARIO BRADESCO 1 (+):	13.602.240,23	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
Cenário Alta - 09999 (-):	(38.961.312,37)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(2.508.805,39)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(17.250.731,36)
Cenário Alta - 09999:	(38.961.312,37)	Cenário Baixa - 10000:	(2.108.451,22)	CENARIO BRADESCO 1:	13.602.240,23	CENARIO BRADESCO 2:	(17.250.731,36)

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
ANEM11	11.107.926,25	288.110,91	286.570,41	3,98%	-1.363.697,89	-10.609,70	533.224,66	-665.711,01
ANET11	1.922.991,43	16.224,52	13.627,22	0,19%	-136.662,46	-34.315,31	27.820,08	-36.850,56
APPSA2	3.387.543,28	56.497,13	55.847,14	0,77%	-348.659,55	-20.128,03	116.533,62	-150.898,27
ASAB11	6.435.425,21	104.650,96	104.558,68	1,45%	-607.714,66	-64.437,98	188.962,14	-243.659,72
ASER12	2.829.864,60	95.873,57	95.518,93	1,33%	-465.550,62	29.036,26	209.739,45	-254.987,47
BRKPK28	10.627.333,52	338.426,91	330.486,05	4,59%	-1.386.433,73	-25.555,40	529.146,42	-671.434,68
BTDW15	5.499.096,58	138.899,21	138.410,92	1,92%	-632.621,50	62.542,79	268.271,66	-345.424,55
CAEC21	9.183.364,90	113.275,64	95.758,22	1,33%	-792.052,94	-161.715,58	187.246,46	-247.280,09
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CART13	10.246.865,16	222.757,48	222.268,09	3,08%	-1.120.865,41	-60.022,82	390.859,94	-498.985,82
CBAN32	16.502.110,17	367.119,89	366.401,77	5,08%	-1.850.994,62	-86.553,65	651.767,79	-834.479,35
CBAN72	4.845.423,51	115.249,27	114.769,63	1,59%	-558.328,82	-20.439,41	201.026,36	-256.907,08
CJEN13	7.276.329,56	156.705,26	156.298,35	2,17%	-783.770,88	-44.183,07	272.472,79	-347.157,47
CNRD11	10.343.293,29	273.003,10	270.484,66	3,75%	-1.225.508,62	-34.116,51	454.226,74	-575.704,18
COMPROMISSADA_PRE	5.411.733,07	78,85	22,38	0,00%	-154,70	157,79	556,10	-846,42
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-161.742,53	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CONX12	9.591.437,39	111.414,34	97.180,52	1,35%	-831.801,08	-172.502,83	197.187,85	-259.794,09
CREZMZ4	210.806,29	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CRMG15	9.528.888,85	110.590,65	106.311,69	1,48%	-803.110,64	-113.753,13	221.712,38	-288.938,26
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ERDV17	10.168.959,26	28.665,28	15.643,95	0,22%	-356.177,18	-167.170,76	22.246,83	-30.084,14
ERDV38	6.221.891,34	24.810,69	15.299,50	0,21%	-362.374,24	-143.696,60	38.234,92	-51.429,46
GBSP11	9.955.560,28	299.217,28	297.990,33	4,14%	-1.533.238,34	87.950,07	683.174,07	-828.793,68
GRRB24	9.664.912,59	126.246,86	109.148,73	1,51%	-877.945,55	-151.825,68	226.645,12	-298.265,23
HARG11	10.727.410,14	269.097,26	266.655,03	3,70%	-1.228.039,19	-23.083,62	465.753,32	-586.285,05
HVRD15	11.594.134,04	297.535,53	296.899,98	4,12%	-1.405.987,96	-36.022,50	518.253,53	-659.809,51
IPIL11	8.115.567,80	141.498,96	141.463,09	1,96%	-784.520,06	-68.410,12	254.104,05	-325.272,12
IRBR12	11.924.733,53	92.905,56	76.532,41	1,06%	-825.393,00	-280.668,66	120.840,96	-161.699,02
ITPO14	9.296.307,27	269.784,65	267.439,80	3,71%	-1.212.484,69	-3.120,07	472.844,56	-596.037,83
LAMEA6	5.566.263,74	132.614,66	132.364,66	1,84%	-614.835,33	75.458,46	267.091,53	-343.005,34
LCAMD1	11.151.183,31	208.350,93	207.854,69	2,88%	-1.182.618,82	-35.278,09	416.975,04	-538.155,16
LORTA7	6.460.995,50	123.773,63	123.536,81	1,71%	-678.650,96	1.709,17	250.040,30	-322.577,98
MOVI37	8.762.843,31	159.831,44	159.364,62	2,21%	-917.751,43	-32.661,88	320.000,30	-413.178,87
MTRJ19	9.120.632,46	118.186,86	115.230,15	1,60%	-794.461,31	-101.865,94	228.270,66	-296.896,15
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PASN12	4.264.462,45	40.426,20	36.528,63	0,51%	-322.302,65	-64.539,57	76.658,10	-100.697,73
PEJA11	5.048.718,40	87.589,38	86.998,08	1,21%	-518.130,04	-46.610,82	164.716,46	-213.173,82
QUAT12	3.551.716,60	15.500,95	10.940,24	0,15%	-226.542,11	-95.777,55	21.780,95	-29.337,09
RAHD11	9.619.675,39	237.551,19	236.961,18	3,29%	-1.168.009,58	-5.313,14	460.758,86	-573.127,40
RDVE11	8.867.208,65	189.081,20	188.606,24	2,62%	-961.193,87	-44.391,85	344.146,76	-434.600,51
RMSA12	11.804.616,68	394.030,80	392.483,19	5,45%	-1.870.248,73	94.203,87	823.823,58	-1.007.689,95
RSAN44	10.199.855,60	114.010,07	107.810,90	1,50%	-843.189,92	-128.913,69	225.277,96	-294.475,01
TCI11	10.496.285,58	260.707,73	260.333,91	3,61%	-1.327.362,35	5.341,58	535.389,56	-661.599,93
UNEG11	10.111.791,36	328.017,18	324.435,19	4,50%	-1.432.632,21	43.954,17	604.966,37	-749.740,32
UTPS21	6.661.687,84	186.156,12	184.019,01	2,55%	-823.367,02	-368,67	321.965,42	-406.203,26
VAMO33	1.307.598,42	22.408,92	22.235,89	0,31%	-135.156,20	-6.070,26	46.326,25	-59.905,00
VAMO34	7.458.894,76	135.468,30	135.212,79	1,88%	-767.761,45	-27.989,29	267.932,70	-345.747,10
VERDECS2	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
VERO12	8.257.751,86	106.589,86	95.823,58	1,33%	-731.470,20	-107.495,07	198.892,90	-260.827,07
VIMI13	9.183.286,96	228.039,03	226.269,30	3,14%	-1.066.964,55	-26.684,98	398.267,27	-503.651,56
VRDN12	10.096.783,25	218.506,65	217.979,86	3,02%	-1.084.576,35	-62.513,17	375.048,58	-479.405,07
Total Var:	370.391.018,90	7.365.463,84	7.206.526,99	100,00%	-38.961.312,37	-2.108.451,22	13.602.240,23	-17.250.731,36

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – MARÇO 2024



bradesco

Data: 28/03/2024

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIRF EMB II A CRED PRIV
CNPJ: 20725957000102

Dados Gerais		Limite Fundo:		ENQUADRADO		0,00% Dutation DC:		805,14	
PL:	217.375.339,21	VAR / PL:	0,2074%	Status:		Dutation DU:			
VAR:	450.926,24	ETL / PL:	0,2601%	Benchmark:					555,56
ETL:	565.479,70	VAR / CDI:	0,0023%						

Cenários de STRESS										
Cenário Alta - 09999 (+):	828.390,71	Cenário Baixa - 10000 (+):	3.784.738,74	CENARIO BRADESCO 1 (+):	4.263.006,01	CENARIO BRADESCO 2 (+):	1.310.221,42			
Cenário Alta - 09999 (-):	(2.688.101,14)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(1.629.937,10)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(2.875.722,79)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(3.158.601,92)			
Cenário Alta - 09999:	(1.859.710,43)	Cenário Baixa - 10000:	2.154.801,64	CENARIO BRADESCO 1:	1.387.283,22	CENARIO BRADESCO 2:	(1.848.380,50)			

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
CAXA	9.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CDB323R5IT1	6.518.970,15	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	7.059.420,25	102,86	18,62	0,00%	-201,81	205,83	725,41	-1.104,13
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-183.943,48	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPGT16	145.749,39	0,90	-0,12	0,00%	46,54	-45,39	-96,46	146,95
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DHF27	10.391,58	59.224,18	-52.454,39	-11,83%	474.157,64	-391.416,21	-536.572,63	749.481,07
DHF29	550,29	3.797,73	-3.503,86	-0,78%	29.211,97	-24.795,10	-34.533,46	46.619,00
DHF29	2.544,05	17.037,71	-15.810,58	-3,51%	125.465,14	-109.001,43	-153.771,65	200.612,60
DHF33	4.909,02	28.171,26	-26.188,95	-5,81%	198.383,78	-184.966,28	-274.596,93	312.236,17
DHN25	-6.438,70	34.986,71	31.043,78	6,88%	-363.912,92	289.449,75	418.045,89	-612.730,93
ERDV18	1.394.234,69	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
IDIN24P400700	-343,20	433,84	215,02	0,05%	343,20	-335.949,95	-795.626,67	343,20
IDIN24P400800	5.933,37	4.888,52	-2.422,82	-0,54%	-5.933,37	362.636,36	822.427,80	-5.933,37
IDIV24P410200	-782,43	1.103,91	-914,77	-0,20%	782,43	-583.761,74	-1.080.534,99	782,43
IDIV24P410300	2.423,94	2.787,23	2.309,68	0,51%	-2.423,94	605.133,34	1.102.027,70	-2.423,94
LF002200U5M	10.414.085,93	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002200U5N	10.918.537,46	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306J15	10.827.334,09	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306U55	6.505.993,16	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024000XE	10.413.852,18	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024000XG	10.395.161,18	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024000XN	10.372.339,57	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024002C7	6.620.044,21	50.870,24	45.829,20	10,16%	-414.269,69	341.978,82	468.801,42	-654.818,69
LF0024002SX	4.460.428,18	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024002TZ	10.359.347,98	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF00240033U	6.634.783,75	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024003CF	10.915.429,84	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024006I2	10.958.606,15	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20260301 - 210100	190.140,03	31,14	-7,55	0,00%	-922,89	1.639,28	35,00	-53,27
LFT20260901 - 210100	1.724.970,64	205,61	-83,38	-0,02%	-9.965,84	19.504,88	551,87	-839,86
LFT20300301 - 210100	8.356.590,45	2.942,46	1.995,52	0,44%	-119.861,43	296.298,67	22.627,91	-34.332,94
LTN20280101 - 100000	205.918,29	2.284,71	2.087,54	0,46%	-17.018,95	15.385,90	20.812,00	-28.073,32
NTNB20240815 - 760199_NEGOCIACAO	14.447.255,75	42.968,72	35.061,82	7,78%	-81.886,15	80.050,50	62.793,28	-84.777,60
NTNB20250515 - 760199_NEGOCIACAO	9.230.690,39	43.614,72	39.141,88	8,68%	-145.968,71	141.896,00	87.140,76	-116.919,57
NTNB20260815 - 760199_NEGOCIACAO	13.724.617,48	93.937,96	91.354,68	20,26%	-345.681,10	353.342,50	257.762,06	-341.968,59
NTNB20270515 - 760199_NEGOCIACAO	10.747.140,01	84.876,08	84.296,54	18,69%	-330.142,45	341.338,51	255.731,34	-336.976,90
NTNB20280815 - 760199_NEGOCIACAO	17.610.807,74	189.890,87	184.537,93	40,92%	-709.357,22	735.736,21	582.448,49	-758.631,61
NTNB20290815 - 760199_NEGOCIACAO	1.265.664,10	36.323,41	34.420,10	7,63%	-140.550,78	206.138,18	161.060,99	-178.995,72
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
TERMO_RF_PRE	137.270,34	2,00	0,36	0,00%	-3,92	4,00	14,11	-21,47
Total Var:	212.399.617,82	699.482,76	450.926,24	99,97%	-1.859.710,43	2.154.801,64	1.387.283,22	-1.848.380,50

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – MARÇO 2024



bradesco

Data: 28/03/2024

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIM EMB I A
CNPJ: 20725946000122

Dados Gerais									
PL:	384.221.749,99	VAR / PL:	0,2716%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	633,68		
VAR:	1.043.590,39	ETL / PL:	0,3406%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	437,22		
ETL:	1.308.704,45	VAR / CDI:	0,003%	Benchmark:					

Cenários de STRESS									
Cenário Alta - 09999 (+):	27.815.916,30	Cenário Baixa - 10000 (+):	149.262.423,11	CENARIO BRADESCO 1 (+):	264.848.127,29	CENARIO BRADESCO 2 (+):	33.831.282,62		
Cenário Alta - 09999 (-):	(50.167.621,75)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(127.855.484,10)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(237.743.910,49)	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(76.006.808,28)		
Cenário Alta - 09999:	(22.351.705,44)	Cenário Baixa - 10000:	21.406.939,01	CENARIO BRADESCO 1:	27.104.216,80	CENARIO BRADESCO 2:	(42.175.525,66)		

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

Produto	MtM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PRLG14	1.142.110,54	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
SBSPC7	2.419.985,86	430,66	391,79	0,04%	-3.929,91	3.208,35	4.581,35	-6.553,78
SMFT16	3.345.204,33	897,20	819,67	0,08%	-7.828,58	6.456,53	9.154,18	-12.904,94
VAMO22	1.060.419,20	32,40	29,64	0,00%	-357,35	289,93	435,25	-637,93
WDOJ24	-6.428,10	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
WDOK24	-117.794,38	367.649,25	216.812,58	20,78%	-2.163.847,37	2.202.521,64	-2.822.449,82	2.838.568,68
Total Var:	387.517.471,60	10.018.241,96	1.043.590,39	100,04%	-22.351.705,44	21.406.939,00	27.104.216,81	-42.175.525,66



bradesco

Data: 28/03/2024

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIM EMB III A IMOBILIÁRIO
CNPJ: 32711990000162

Dados Gerais									
PL:	71.715.029,69	VAR / PL:	2,6657%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	4,00		
VAR:	1.911.707,08	ETL / PL:	3,3423%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1,00		
ETL:	2.397.357,90	VAR / CDI:	0,0292%	Benchmark:					

Cenários de STRESS									
Cenário Alta - 09999 (+):	33.792.296,01	Cenário Baixa - 10000 (+):	53,32	CENARIO BRADESCO 1 (+):	8.364.022,94	CENARIO BRADESCO 2 (+):	-		
Cenário Alta - 09999 (-):	(52,28)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(33.792.296,01)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-	CENARIO BRADESCO 2 (-):	(8.432.583,55)		
Cenário Alta - 09999:	33.792.243,72	Cenário Baixa - 10000:	(33.792.242,68)	CENARIO BRADESCO 1:	8.364.022,94	CENARIO BRADESCO 2:	(8.432.583,55)		

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

Produto	MtM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
AIEC11	1.885.291,20	152.696,61	4.728,49	0,25%	942.645,60	-942.645,60	276.383,69	-278.646,04
BMLC11	3.859.114,40	53.369,47	-8.638,48	-0,45%	3.859.114,40	-3.859.114,40	565.746,17	-570.377,11
BPML11	2.787.744,00	169.520,91	-104.793,54	-5,48%	2.787.744,00	-2.787.744,00	408.683,27	-412.028,56
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CEOC11	664.125,80	43.244,44	33.477,37	1,75%	332.062,90	-332.062,90	97.360,84	-98.157,79
CNES11	519.719,12	119.259,61	-99.632,42	-5,21%	259.859,56	-259.859,56	76.190,82	-76.814,49
COMPROMISSADA_PRE	1.828.867,74	26,65	7,13	0,00%	-52,28	53,32	187,93	-286,05
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-1.748.918,91	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
FVPQ11	1.047.179,00	42.273,72	22.181,19	1,16%	523.589,50	-523.589,50	153.516,44	-154.773,06
MALL11	4.457.688,40	63.831,96	40.458,79	2,12%	2.228.844,20	-2.228.844,20	653.497,12	-658.846,35
MAXR11	1.943.282,88	91.775,47	46.381,32	2,43%	971.641,44	-971.641,44	284.865,27	-287.217,21
NEWL11	6.813.291,94	696.869,77	613.989,88	32,12%	3.406.645,97	-3.406.645,97	998.828,60	-1.007.084,55
NEWU11	1.764.952,64	49.943,98	-11.233,00	-0,63%	1.754.952,64	-1.754.952,64	257.276,06	-259.382,00
OULG11	175.828,05	12.446,69	10.691,05	0,56%	87.914,03	-87.914,03	25.776,39	-25.987,39
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PATC11	4.270.556,40	155.709,19	97.529,59	5,10%	2.135.278,20	-2.135.278,20	626.063,57	-631.188,24
PVBH11	2.466.446,47	62.172,05	54.721,58	2,86%	0,00	0,00	0,00	0,00
QAGR11	5.341.626,93	188.488,85	158.314,49	8,28%	2.670.813,47	-2.670.813,47	783.082,51	-789.492,46
RBRL11	2.130.700,40	122.302,90	108.843,22	5,69%	2.130.700,40	-2.130.700,40	312.360,68	-314.917,52
RBRP11	719.304,64	31.423,90	14.817,32	0,78%	359.652,32	-359.652,32	105.450,06	-106.313,23
RCRB11	6.563.933,03	324.219,36	282.173,54	14,76%	0,00	0,00	0,00	0,00
TEPP11	4.432.177,27	123.801,41	55.678,43	2,91%	2.216.088,64	-2.216.088,64	649.757,19	-655.075,80
TRXF11	9.442.681,50	324.908,08	282.702,02	14,79%	4.721.340,75	-4.721.340,75	1.384.297,11	-1.395.628,33
TRXF13	1.432.208,10	46.778,46	40.356,87	2,11%	0,00	0,00	0,00	0,00
VVMR11	4.119.412,05	177.032,66	28.945,00	1,51%	0,00	0,00	0,00	0,00
XPIN11	2.462.518,00	81.475,55	35.611,68	1,86%	1.231.259,00	-1.231.259,00	361.005,14	-363.960,16
XPPR11	2.344.298,00	468.765,61	204.398,44	10,69%	1.172.149,00	-1.172.149,00	343.674,09	-346.487,24
Total Var:	71.715.029,66	3.602.337,29	1.911.707,08	100,00%	33.792.243,72	-33.792.242,68	8.364.022,94	-8.432.583,55

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – MARÇO 2024



Data: 28/03/2024

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIA RVA EMB II
CNPJ: 13294268000125

Dados Gerais					
PL:	109.729.342,30	VAR / PL:	3,6315%	Limite Fundo:	0,00%
VAR:	3.984.858,29	ETL / PL:	4,5541%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	4.997.173,05	VAR / CDI:	0,0398%	Benchmark:	
				Dutacion DC:	4,00
				Dutacion DU:	1,00

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	28.783.422,06	Cenário Baixa - 10000 (+):	103,26	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	15.698.510,00
Cenário Alta - 09999 (-):	(101,25)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(28.814.159,51)	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	-
Cenário Alta - 09999:	28.783.320,81	Cenário Baixa - 10000:	(28.814.056,25)	CENÁRIO BRADESCO 1:	15.698.510,00
				CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	-
				CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	(15.826.802,81)
				CENÁRIO BRADESCO 2:	(15.826.802,81)

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
ABEV3	1.631.256,45	89.542,31	69.139,91	1,74%	228.375,90	-489.376,94	239.142,20	-241.099,70
ARZ3	572.003,00	52.666,09	1.038,54	0,03%	171.600,90	-171.600,90	83.855,64	-84.542,04
AZUL4	502.040,00	127.902,29	-67.643,68	-1,70%	301.224,00	-175.714,00	73.599,06	-74.201,51
B3SA3	3.723.242,71	256.302,88	178.379,61	4,48%	946.337,13	-921.494,81	545.827,39	-550.295,27
BBAS3	3.581.396,00	278.881,55	187.976,03	4,72%	890.349,50	-990.349,50	522.100,95	-526.374,62
BBDC4	2.806.082,90	349.600,21	20.829,31	0,52%	701.520,70	-701.520,70	411.371,74	-414.739,04
BPAC11	3.898.010,00	253.879,14	178.373,36	4,48%	1.169.403,00	-1.364.303,50	571.448,27	-576.125,88
BRFS3	326.400,00	51.830,08	-28.923,24	-0,73%	81.600,00	-81.600,00	47.850,24	-48.241,92
BRIT3	603.450,00	152.787,69	-51.694,64	-1,30%	283.621,50	-283.621,50	88.465,77	-89.189,91
BRSR6	424.530,00	75.832,05	47.467,99	1,19%	106.132,50	-106.132,50	62.236,10	-62.745,53
CAIXA	10.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CIEL3	562.140,00	57.886,20	42.498,86	1,07%	168.642,00	-140.535,00	82.409,72	-83.084,29
CMG4	2.287.176,00	158.252,33	-18.538,38	-0,47%	605.937,75	-667.032,30	335.300,00	-338.044,61
COMPROMISSADA_PRE	3.541.663,14	51,60	3,24	0,00%	-101,25	103,26	363,93	-553,94
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	1.128.727,11	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPL6	1.586.338,00	120.433,77	92.370,17	2,32%	348.994,36	-348.994,36	232.557,15	-234.460,76
CSAN3	1.370.520,00	181.173,48	128.631,48	3,23%	342.630,00	-342.638,46	200.918,23	-202.562,86
CURY3	655.592,00	40.053,23	-1.751,13	-0,04%	196.677,60	-196.677,60	96.109,79	-96.896,50
CSSE3	1.035.606,00	79.076,98	-8.286,44	-0,21%	207.121,20	-207.121,20	151.819,84	-153.062,57
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DIRR3	1.219.988,00	77.858,09	22.078,60	0,55%	365.996,40	-365.996,40	178.850,24	-180.314,23
ELET3	3.758.087,40	266.672,17	184.639,68	4,63%	1.127.426,22	-1.127.426,22	550.935,61	-555.445,32
ENEV3	805.800,00	45.018,43	7.428,95	0,19%	298.146,00	-410.964,32	118.130,28	-119.097,24
EQT3	2.848.125,00	128.880,08	62.560,00	1,57%	569.616,25	-569.625,00	417.535,13	-420.952,88
GGBR4	1.289.820,00	85.344,86	-1.818,77	-0,05%	322.455,00	-322.455,00	189.087,61	-190.635,40
GMAT3	855.750,00	72.571,03	34.395,43	0,86%	154.035,00	-136.920,00	125.452,95	-126.479,85
GOAU4	686.343,00	35.987,98	802,51	0,02%	205.902,90	-171.585,75	100.617,88	-101.441,50
HAPV3	729.595,60	136.127,44	-34.632,24	-0,87%	248.062,50	-248.082,22	106.958,72	-107.834,23
IGTI11	634.032,00	30.000,84	19.622,54	0,49%	126.806,40	-126.806,40	92.949,09	-93.709,93
INTB3	430.295,00	38.063,93	3.451,40	0,09%	215.147,50	-150.603,25	63.081,25	-63.597,60
ITSA4	2.823.912,00	137.794,34	107.278,96	2,69%	536.516,39	-536.543,28	413.985,50	-417.374,19
ITUB4	9.648.521,68	558.840,87	451.854,77	11,34%	1.929.704,34	-1.833.219,12	1.414.473,28	-1.426.051,50
JBS3	1.395.350,00	129.423,51	19.262,77	0,48%	488.372,50	-488.372,50	204.558,31	-206.232,73
LJQQ3	223.108,00	44.217,24	2.437,17	0,06%	100.398,60	-100.398,60	32.707,63	-32.975,35
LRNS3	1.119.831,00	132.982,12	19.030,51	0,46%	223.986,20	-223.986,20	164.167,23	-165.511,02
MRFG3	1.978.489,00	249.871,50	-43.758,51	-1,10%	791.395,60	-593.546,70	290.046,49	-292.420,67
MULT3	547.626,00	36.307,34	6.469,28	0,16%	164.287,80	-136.906,50	80.281,97	-80.939,12
ONCO3	1.005.360,00	140.486,84	55.070,91	1,38%	351.876,00	-351.876,00	147.385,78	-148.592,21
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PCAR3	321.160,00	95.478,70	59.356,89	1,49%	116.257,75	-116.268,60	47.082,06	-47.467,45
PETR3	3.475.824,00	790.683,82	465.924,60	11,69%	868.956,00	-1.042.747,20	509.555,80	-513.726,79
PETRA	7.552.660,24	1.692.308,37	1.028.810,49	25,82%	1.888.165,06	-2.265.818,29	1.107.219,99	-1.116.283,18
PLPL3	239.400,00	35.037,65	2.877,84	0,07%	71.820,00	-71.821,71	35.096,04	-35.383,32
PRIO3	2.217.670,00	199.752,21	-15.444,01	-0,39%	1.330.602,00	-1.330.602,00	325.110,42	-327.771,63
RADL3	2.099.169,52	245.568,94	-25.908,14	-0,65%	419.833,90	-419.833,90	307.738,25	-310.257,26
RAIL3	552.048,00	34.996,16	14.590,70	0,37%	248.421,60	-182.175,84	80.930,24	-81.592,69
RECV3	927.870,00	97.285,60	50.424,24	1,27%	556.722,00	-556.722,00	136.025,74	-137.139,19
RENT3	3.362.820,00	319.224,52	17.845,40	0,45%	1.109.730,60	-874.333,20	492.989,41	-497.024,80
RRRP3	475.056,00	57.392,78	-40.591,84	-1,02%	285.033,60	-285.033,60	69.643,21	-70.213,28
SIFG3	863.765,00	110.755,83	21.129,90	0,53%	328.230,70	-345.506,00	126.627,95	-127.064,47
SBSR3	2.337.720,00	221.779,18	100.003,32	2,51%	584.430,00	-584.430,00	342.709,75	-345.515,02
STBP3	218.448,00	30.282,02	-13.654,92	-0,34%	76.456,80	-76.456,80	32.024,48	-32.286,61
SUZB3	3.410.134,00	420.382,07	-109.199,91	-2,74%	852.533,50	-682.026,80	499.925,64	-504.017,81
TIMS3	881.100,00	54.441,01	27.519,47	0,89%	281.952,00	-202.653,00	129.169,26	-130.226,58
TOTS3	853.755,54	57.852,97	33.536,23	0,84%	170.751,11	-170.751,11	125.160,56	-126.185,07
VALE3	12.682.750,85	660.075,33	482.071,59	12,10%	3.170.687,71	-3.170.687,71	1.899.291,28	-1.874.510,58
VBBR3	660.264,00	57.299,12	32.218,16	0,81%	165.066,00	-165.066,00	96.794,70	-97.587,02
VIVT3	1.755.820,00	186.073,35	114.088,22	2,86%	263.373,00	-263.373,00	257.403,21	-259.510,20
WEGE3	2.609.060,00	351.865,78	-25.735,86	-0,65%	652.265,00	-652.265,00	382.488,20	-385.619,07
WINJ24	6.592,00	79.488,26	78.950,06	1,98%	371.854,09	-371.581,03	298.942,86	-300.994,89
Total Var:	109.729.341,04	10.470.426,16	3.984.858,29	99,99%	28.783.320,81	-28.814.056,25	15.698.510,00	-15.826.802,80

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – MARÇO 2024



bradesco

Data: 28/03/2024

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIA RVA EMB III
CNPJ: 38452593000108

Dados Gerais					
PL:	117.359.457,74	VAR / PL:	3,2392%	Limite Fundo:	0,00%
VAR:	3.801.552,83	ETL / PL:	4,0621%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	4.767.300,61	VAR / CDI:	0,0355%	Benchmark:	
				Dutacion DC:	4,00
				Dutacion DU:	1,00

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	33.422.450,06	Cenário Baixa - 10000 (+):	875.493,07	CENARIO BRADESCO 1 (+):	15.498.734,41
Cenário Alta - 09999 (-):	(860.119,95)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(31.958.769,87)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(1.121.742,88)
Cenário Alta - 09999:	32.562.330,12	Cenário Baixa - 10000:	(31.083.276,80)	CENARIO BRADESCO 1:	14.376.991,54
				CENARIO BRADESCO 2 (+):	1.128.149,09
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	(15.625.838,80)
				CENARIO BRADESCO 2:	(14.497.689,72)

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
ALOS3	5.177.579,68	287.213,24	204.604,59	5,38%	0,00	0,00	0,00	0,00
ALPA4	678.536,00	131.227,06	47.182,94	1,24%	169.634,00	-169.641,12	99.473,38	-100.287,62
BBAS3	2.084.918,26	163.146,12	42.053,10	1,11%	521.229,67	-521.229,67	305.649,02	-308.150,92
BBSE3	3.134.926,00	191.504,40	73.122,48	1,92%	626.965,60	-626.965,60	459.590,45	-463.342,36
BPAC11	3.478.006,53	226.524,25	120.463,16	3,17%	1.043.462,96	-1.217.362,99	509.676,05	-514.049,66
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CIEL3	648.000,00	66.727,61	21.876,22	0,58%	194.400,00	-162.000,00	94.996,80	-95.774,40
COMPROMISSADA_PRE	4.524.016,70	65,92	-6,53	0,00%	-129,33	131,90	464,88	-707,68
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	226.598,23	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPLE3	1.601.746,45	106.972,81	52.486,23	1,38%	352.384,22	-352.384,22	234.816,03	-236.738,13
CPLE6	946.684,96	71.871,72	33.127,46	0,87%	208.270,69	-208.270,69	138.784,02	-139.920,04
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DOLK24	-46.815,71	146.117,01	71.867,77	1,89%	-859.990,62	875.361,16	-1.121.742,88	1.128.149,09
ELET3	8.060.109,60	571.941,70	251.978,20	6,63%	2.418.032,88	-2.418.032,88	1.181.612,07	-1.191.284,20
ENEV3	6.623.816,25	370.059,31	192.964,28	5,08%	2.450.812,01	-3.378.198,24	971.051,46	-979.000,04
ENJ3	185.673,00	28.110,52	12.901,45	0,34%	83.552,85	-50.131,71	27.219,66	-27.442,47
EQT3	9.555.150,15	432.378,67	185.756,04	4,89%	1.911.000,68	-1.911.030,03	1.400.785,01	-1.412.251,19
FLRY3	3.255.000,00	186.453,68	139.623,51	3,67%	651.000,00	-651.000,00	477.183,00	-481.089,00
HAPV3	3.086.284,70	575.836,86	153.481,20	4,04%	1.049.336,60	-1.049.420,21	452.449,94	-456.152,88
IGT11	7.848.640,17	371.378,36	317.652,07	8,36%	1.569.728,03	-1.569.728,03	1.150.610,65	-1.160.029,02
ITS44	5.724.600,00	279.335,01	192.919,77	5,07%	1.067.619,48	-1.067.674,00	839.226,36	-846.095,68
MGLU3	2.735.899,20	412.721,45	216.543,82	5,70%	1.422.667,58	-1.231.154,64	401.082,82	-404.365,90
NTCO3	1.665.733,72	189.292,95	9.752,49	0,26%	391.424,67	-391.433,43	229.536,56	-231.415,44
ONCO3	423.030,00	59.113,30	29.608,03	0,78%	148.060,50	-148.060,50	62.016,20	-62.523,83
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PETR3	2.227.896,00	506.803,95	54.338,98	1,43%	556.974,00	-668.368,80	326.609,55	-329.283,03
PRI03	4.420.718,00	398.187,37	82.120,75	2,16%	2.652.430,80	-2.652.430,80	648.077,26	-653.382,12
RAIL3	8.231.614,44	521.829,48	20.020,19	0,53%	3.704.226,50	-2.716.432,77	1.206.754,68	-1.216.632,61
RECV3	2.909.814,45	305.089,13	50.288,49	1,32%	1.745.888,67	-1.745.888,67	426.578,80	-430.070,58
RENT3	8.109.098,68	769.777,48	388.179,06	10,21%	2.676.002,56	-2.108.365,66	1.188.793,87	-1.198.524,79
SCAR3	175.744,00	19.274,98	4.438,23	0,12%	105.446,40	-105.446,40	25.764,07	-25.974,96
SMFT3	3.554.200,00	239.773,95	104.397,85	2,75%	1.421.680,00	-1.421.680,00	521.045,72	-525.310,76
SOMA3	2.681.003,00	280.810,29	148.810,87	3,91%	804.300,90	-804.300,90	393.035,04	-396.252,24
SRNA3	1.759.670,00	224.605,24	63.166,39	1,66%	0,00	0,00	0,00	0,00
SUZB3	7.673.047,86	946.506,40	131.906,12	3,47%	1.919.511,97	-1.535.609,57	1.125.601,82	-1.134.815,47
VIVA3	665.490,00	193.278,49	79.747,34	2,10%	199.644,00	-199.644,00	97.559,37	-98.357,94
WIDOK24	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
YDIQ3	3.427.697,81	518.243,28	304.450,29	8,01%	1.336.802,15	-856.924,45	502.500,50	-506.613,74
Total Var:	117.360.122,12	9.792.171,99	3.801.552,83	100,03%	32.562.330,12	-31.083.276,80	14.376.991,54	-14.497.689,72



bradesco

Data: 28/03/2024

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO:	FIA RVA EMB IV
CNPJ:	38452613000132

Dados Gerais					
PL:	110.328.728,82	VAR / PL:	3,1623%	Limite Fundo:	0,00%
VAR:	3.488.950,43	ETL / PL:	3,9657%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	4.375.284,59	VAR / CDI:	0,0347%	Benchmark:	
				Dutacion DC:	4,00
				Dutacion DU:	1,00

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	31.433.645,71	Cenário Baixa - 10000 (+):	296,75	CENARIO BRADESCO 1 (+):	14.931.136,76
Cenário Alta - 09999 (-):	(290,96)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(29.871.963,31)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-
Cenário Alta - 09999:	31.433.354,75	Cenário Baixa - 10000:	(29.871.666,56)	CENARIO BRADESCO 1:	14.931.136,76
				CENARIO BRADESCO 2 (+):	-
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	(15.053.893,62)
				CENARIO BRADESCO 2:	(15.053.893,62)

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	2.663.398,50	148.175,56	96.877,50	2,78%	665.849,63	-825.653,54	390.454,22	-393.650,30
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	10.177.952,26	146,29	1,56	0,00%	-290,96	296,75	1.046,87	-1.591,89
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-1.692.593,36	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPLES	2.274.826,90	151.924,69	117.750,42	3,37%	500.462,36	-500.462,36	333.489,92	-336.219,71
CPLE6	5.032.145,04	382.037,25	267.767,96	7,67%	1.107.071,91	-1.107.071,91	737.712,46	-743.751,04
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ENGH1	10.437.048,23	647.749,98	533.119,12	15,28%	1.774.298,20	-2.296.150,61	1.530.071,27	-1.542.595,73
ENGH4	16,36	1,01	0,77	0,00%	13,09	-13,09	2,40	-2,42
EQTL3	6.767.991,30	306.257,36	109.296,99	3,13%	1.353.577,47	-1.353.598,26	992.187,53	-1.000.309,11
GGPS3	8.208.559,52	798.430,47	-235.718,12	-6,76%	3.693.812,17	-3.693.851,78	1.203.374,83	-1.213.225,10
GMAT3	9.322.748,75	790.606,51	497.157,16	14,25%	1.678.094,78	-1.491.639,80	1.366.714,97	-1.377.902,27
HAPV3	4.626.324,60	863.176,44	-229.463,20	-6,58%	1.572.950,36	-1.573.075,40	678.219,19	-683.770,78
ITUB4	9.754.277,60	564.966,24	484.723,05	13,89%	1.950.855,52	-1.853.312,74	1.429.977,10	-1.441.682,23
MATD3	893.806,16	92.202,59	16.490,48	0,47%	268.141,85	-268.141,85	131.031,98	-132.104,55
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PRI03	12.183.294,10	1.097.385,95	13.038,55	0,37%	7.309.976,46	-7.309.976,46	1.786.070,92	-1.800.690,87
RAIL3	9.933.280,14	629.703,75	294.688,22	8,46%	4.469.976,06	-3.277.982,45	1.456.218,87	-1.468.138,81
RENT3	1.905.051,20	160.941,99	-10.805,31	-0,31%	628.696,90	-495.313,31	279.280,51	-281.566,57
UGPA3	12.693.584,29	1.695.468,22	1.221.533,98	35,01%	3.170.896,07	-2.536.716,86	1.859.413,46	-1.874.633,76
VBBR3	5.156.011,58	447.449,73	312.481,30	8,96%	1.289.002,90	-1.289.002,90	756.871,30	-762.058,51
Total Var:	110.328.725,17	8.796.526,02	3.488.950,43	99,98%	31.433.354,75	-29.871.666,56	14.931.136,76	-15.053.893,62



bradesco

Data: 28/03/2024

Relatório de Risco de Mercado

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

Dados Gerais					
PL:	117.453.769,10	VAR / PL:	3,7553%	Limite Fundo:	0,00%
VAR:	4.410.703,10	ETL / PL:	4,7093%	Status:	ENQUADRADO
ETL:	5.531.199,63	VAR / CDI:	0,0412%	Benchmark:	
				Dutacion DC:	9,16
				Dutacion DU:	4,58

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	30.287.605,16	Cenário Baixa - 10000 (+):	6.764,57	CENARIO BRADESCO 1 (+):	16.992.968,42
Cenário Alta - 09999 (-):	(4.461,66)	Cenário Baixa - 10000 (-):	(30.621.081,33)	CENARIO BRADESCO 2 (+):	1,23
Cenário Alta - 09999:	30.283.143,50	Cenário Baixa - 10000:	(30.614.316,76)	CENARIO BRADESCO 1 (-):	(0,81)
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	(17.131.654,60)
				CENARIO BRADESCO 1:	16.992.967,61
				CENARIO BRADESCO 2:	(17.131.653,37)

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

Produto	MtM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
TOTS3	768.899,34	52.102,87	29.985,35	0,68%	153.779,87	-153.779,87	112.720,64	-113.643,32
TRPL4	517.695,56	58.784,73	33.465,54	0,76%	103.539,11	-129.423,89	75.894,17	-76.515,40
UGPA3	1.629.964,44	217.884,22	150.060,24	3,40%	407.491,11	-326.992,89	236.952,79	-240.906,74
USM5	271.731,46	47.145,17	31.857,99	0,72%	105.375,27	-59.780,92	39.835,83	-40.161,91
VALE5	13.453.831,93	700.206,33	508.819,55	11,54%	3.363.457,98	-3.363.457,98	1.972.331,76	-1.988.476,36
VAM03	185.420,10	25.978,57	11.012,01	0,25%	64.897,04	-74.168,04	27.182,59	-27.405,09
VBBR3	1.468.787,28	127.484,51	77.157,79	1,75%	367.196,82	-367.196,82	215.324,22	-217.086,76
VIVT3	1.128.177,60	119.558,83	78.764,86	1,79%	169.226,64	-169.226,64	165.390,84	-166.744,65
WEGE3	2.982.541,40	402.234,62	-32.449,31	-0,74%	745.635,35	-745.635,35	437.240,57	-440.819,62
YDUQ3	276.141,28	41.750,58	19.916,45	0,45%	107.695,10	-69.035,32	40.482,31	-40.813,68
Total Var:	117.453.071,90	11.920.254,95	4.410.703,10	100,03%	30.283.143,50	-30.614.316,75	16.992.967,61	-17.131.653,37

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 – MARÇO 2024



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/03/2024

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	18/05/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	658.223,91	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	243.486,15	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	146.091,69	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	20/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	486.732,40	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FIR F EMB II	25/08/17	25/08/17	15/08/24	PETR	9.531.005,35	AAA	Aaa.br	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	18/12/17	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	3.028.992,26	-	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	21/12/17	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	884.148,24	-	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	26/01/18	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	3.140.129,07	-	-	AAA(bra)
FIR F EMB II	19/02/18	19/02/18	15/02/25	SABESP	4.809.200,12	brAAA	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/02/18	19/02/18	15/02/25	SABESP	2.984.634,04	brAAA	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	13/03/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	12.847.621,21	brAA	-	AA(bra)
FIR F EMB II	23/05/18	23/05/18	15/05/28	COMGAS	26.252.763,75	-	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	632.572,51	brAA	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	632.572,51	brAA	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	632.572,51	brAA	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	631.364,71	brAA	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	632.572,51	brAA	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	04/07/18	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	13.019.221,68	brAAA	A2.br	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	26/07/18	26/07/18	15/07/25	AEGEA SA	14.983.465,82	brA	Aa1.br	AA(bra)
FIR F EMB II	26/07/18	26/07/18	15/07/25	CSMG	8.122.492,33	-	Aa3.br	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/02/13	15/02/25	CEMG	680.375,98	brA+	A1.br	AA-(bra)
FIM EMB I A	12/02/19	09/01/19	15/01/25	ITAJUBB	2.554.014,86	-	AAA.br	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	586.652,19	-	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	3.714.523,76	-	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	2.115.332,44	-	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	6.395.355,07	-	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	741.030,60	-	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	5.995.611,24	-	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	8.892.367,23	-	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	916.183,29	-	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	641.650,84	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	30/09/20	28/09/20	22/09/25	HAPVIDA	168.516,54	-	-	AAA(bra)
FIR F EMB II A CRED PRIV	08/01/21	22/05/19	15/04/24	ECORODOV	1.393.765,35	-	-	AA(bra)
FIR F EMB II A CRED PRIV	05/02/21	07/08/19	15/07/24	COPEL GT	145.555,64	-	-	AA+(bra)
FIR F EMB II	12/02/21	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	6.237.679,46	brAA	-	AA(bra)
FIR F EMB II	12/02/21	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	6.249.840,70	brAA	-	AA(bra)
FIR F EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	4.442.358,41	brAAA	-	-
FIR F EMB II	12/02/21	17/07/19	15/06/29	NEOENERG	644.057,72	brAA+	-	-
FIR F EMB II	12/02/21	17/07/19	15/06/29	NEOENERG	6.402.255,11	brAA+	-	-
FIR F EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	1.839.561,38	brAAA	-	-
FIR F EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	3.525.759,17	brAAA	-	-
FIR F EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	3.772.210,23	brAAA	-	-
FIR F EMB II	12/02/21	31/07/20	15/07/34	IGUA SAN	2.634.574,40	brAA	-	-
FIR F EMB II	12/02/21	23/05/18	15/05/28	COMGAS	22.863.199,94	-	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	245.606,25	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	432.267,01	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	491.212,51	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	245.606,25	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	300.622,05	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	253.282,81	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	734.863,08	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	26/10/16	27/01/25	BRADESCO	14.919.556,16	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	12/12/17	15/11/24	CCR	3.224.080,53	brAAA	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	14/12/17	15/11/24	ECORODOV	2.148.814,62	brAA	A2.br	-
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	19/02/18	15/02/25	SABESP	700.936,37	brAAA	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	23/05/18	15/05/28	COMGAS	10.161.295,65	-	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	28/06/18	15/06/27	JAGUARA	1.615.471,24	-	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	28/06/18	15/06/27	ENERGMIR	1.030.034,56	-	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	31/07/18	01/08/25	BRADESCO	4.809.912,47	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	191.324,43	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	334.970,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	22/12/20	15/12/26	IRB	2.729.465,59	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	164.000,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	921.197,79	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	76.875,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	1.425.857,96	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	07/04/21	15/03/31	LOCALIZA	5.419.873,46	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	1.730.136,28	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/06/21	06/01/21	15/11/25	QUATA	591.088,00	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	19.010,92	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	219.637,38	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	513.294,91	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	343.921,25	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	343.921,25	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	277.769,59	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	564.572,33	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	556.103,75	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	892.049,69	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	222.752,80	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	128.323,73	-	-	AAA(bra)



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/03/2024

Fundo	INFORMAÇÕES DOS ATIVOS					INFORMAÇÕES DE RATING		
	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/08/20	25/08/25	CSAN	321.148,80	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	1.031.056,11	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	14/06/21	19/06/19	19/06/24	BNBBM	620.905,62	brAAA	AAbr	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	14/06/21	12/06/19	12/06/24	BNBBM	941.185,98	brAAA	AAbr	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	15/06/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	83.230,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	16/06/21	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	368.775,48	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	17/06/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	841.253,98	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	17/06/21	18/03/21	15/02/26	CORSAN	510.303,01	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	18/06/21	18/06/21	15/12/30	MG050	531.413,59	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	50.225,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	823.151,86	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	13/10/20	15/12/30	LAMEA	260.350,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	94.041,33	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	25/06/21	25/06/21	20/06/26	OURO VER	1.465.972,92	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	3.483.012,11	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	01/07/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	3.046.474,59	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	02/07/21	01/03/21	18/02/25	RENNER	560.646,39	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	02/07/21	01/03/21	18/02/25	RENNER	118.568,79	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/07/21	07/04/21	15/03/29	CAGECE	1.270.088,23	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	08/07/21	08/07/21	15/06/31	VAMOS	277.178,43	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/07/21	07/04/21	15/03/29	CAGECE	2.894.592,67	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	12/07/21	12/07/21	12/07/26	BRADESCO	4.445.609,40	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	2.143.880,07	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	238.275,21	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	1.041.313,18	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	299.710,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	541.482,85	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	264.450,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	387.860,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	24/11/20	15/12/30	LAMEA	193.930,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	2.004.798,35	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	313.396,46	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	4.287.760,14	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	369.774,27	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	369.774,27	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	15/07/21	02/10/18	20/09/24	IGUATEMI	1.318.325,67	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	15/07/21	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	845.653,69	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/07/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	2.498.056,95	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	19/07/21	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	594.538,73	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/21	13/10/20	15/10/30	LAMEA	331.690,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/07/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	2.149.461,51	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/07/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	787.631,00	-	-	AAA(bra)
FIM EMB IA	21/07/21	11/06/18	15/05/25	INTERVIA	1.317.851,67	-	Aa2.br	-
FIM EMB IA	21/07/21	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.078.975,24	-	-	AAA(bra)
FIM EMB IA	21/07/21	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	869.072,29	-	-	AA-(bra)
FIM EMB IA	21/07/21	20/09/19	20/08/26	VAMOS	1.036.967,93	brAA+	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	23/07/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.594.240,78	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	29/07/21	07/11/19	15/10/24	BKBR	1.070.934,89	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	29/07/21	23/12/20	15/12/26	RD COLIN	2.139.992,13	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	04/08/21	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	390.061,75	-	-	brA
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	06/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	669.035,96	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	11/08/21	11/08/21	15/08/31	CSAN	1.040.725,82	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	11/08/21	19/11/19	15/06/27	AUTOPIST	1.136.467,27	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	17/08/21	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	2.895.843,23	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	18/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	1.240.975,25	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	18/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	962.986,16	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	27/08/21	27/08/21	20/08/31	S LUIZ A	1.023.579,05	-	-	AAA(bra)
FIM EMB IA	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	679.502,47	-	-	AA(bra)
FIM EMB IA	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	60.850,97	-	-	AA(bra)
FIM EMB IA	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	304.254,84	-	-	AA(bra)
FIM EMB IA	16/09/21	17/06/19	15/06/24	PROLAGOS	1.137.302,64	-	-	AA(bra)
FIM EMB IA	16/09/21	12/05/21	15/04/26	ELETROB	2.096.896,59	brAAA	-	-
FIM EMB IA	16/09/21	22/10/19	21/10/26	AUTOBAN	563.784,06	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	20/09/21	20/09/21	15/09/29	MOV_PART	1.042.831,77	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.062.827,19	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.062.827,19	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	1.110.154,29	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	864.622,14	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	864.622,14	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	287.428,44	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	287.428,44	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	822.054,93	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	822.054,93	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	1.056.347,35	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	410.350,32	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	410.350,32	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	23/09/21	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	4.069.493,74	brAAA	-	-

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – MARÇO 2024



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/03/2024

Fundo	INFORMAÇÕES DOS ATIVOS					INFORMAÇÕES DE RATING		
	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	23/09/21	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	4.324.647,97	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	27/09/21	29/03/21	01/04/24	CNH	2.549.536,94	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	30/09/21	30/09/21	15/09/31	SIMPAP	871.205,23	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	04/10/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	657.065,14	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/10/21	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	2.603.663,56	-	-	AA-(bra)
FIM EMB IA	20/10/21	20/10/21	20/10/25	DAYCOVAL	2.864.470,78	brAA+	AA.br	AA(bra)
FIM EMB IA	20/10/21	20/10/21	20/10/24	DAYCOVAL	1.582.933,07	brAA+	AA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/10/21	22/10/21	15/12/35	CART	2.436.806,29	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	22/10/21	22/10/21	15/12/35	CART	915.288,22	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	25/10/21	22/04/21	15/03/26	VIX LOGI	112.740,90	-	-	A+(bra)
FIM EMB IA	27/10/21	27/10/21	15/10/29	CONT GLO	2.086.896,07	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/10/21	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	938.578,61	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	04/11/21	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	3.529.130,13	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	10/11/21	10/11/21	15/10/28	LIGHT	367.408,40	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	12/11/21	12/11/21	15/10/31	VAMOS	2.206.495,95	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/11/21	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	12.337,71	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/11/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	2.340.215,67	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/11/21	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	2.400.918,19	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	03/12/21	11/06/19	11/06/24	BNBBM	621.576,83	brAAA	AA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/12/21	06/12/21	15/12/35	TESC	2.844.131,36	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/12/21	06/01/21	15/11/25	QUATA	2.647.662,16	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	20/12/21	20/12/21	15/11/35	ORIZON	2.237.205,20	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	10/01/22	22/04/21	15/03/26	VIX LOGI	648.766,52	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	13/01/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.203.919,10	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/01/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	380.133,43	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/01/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	2.255.393,86	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	380.379,52	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	368.492,66	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	3.051.771,42	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	879.627,64	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	784.532,76	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/03/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	1.101.757,42	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	19/04/22	19/04/22	16/04/29	VERT-10	474.405,15	-	-	AAAsf(bra)
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	26/04/22	26/04/22	15/04/24	LIGHT	979.755,73	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	106.510,61	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.230.110,23	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	12/05/22	12/05/22	15/04/27	BRKA	1.987.489,45	-	A+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	12/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.474.560,81	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	26/05/22	26/05/22	10/05/27	GUAR	2.590.714,29	-	-	A
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	2.679.192,94	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	558.932,50	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.134.076,08	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	03/03/22	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	3.431.633,73	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/03/22	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	2.453.558,27	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/03/22	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	1.094.952,61	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/03/22	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	3.383.833,89	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/03/22	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	2.708.517,18	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/06/22	06/12/21	15/12/35	TESC	885.138,48	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	447.146,00	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	06/12/21	15/12/35	TESC	555.190,03	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	281.299,77	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	13/06/22	30/09/21	15/09/31	SIMPAP	1.875.383,88	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	13/06/22	08/07/21	15/06/31	VAMOS	943.726,57	brAA+	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	13/06/22	08/07/21	15/06/31	VAMOS	76.994,01	brAA+	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	13/06/22	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	722.937,48	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	13/06/22	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	817.495,30	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/06/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	1.387.487,02	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	27/06/22	27/06/22	07/07/24	LAGE	2.522.004,42	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	3.402.194,19	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	12/11/21	15/10/31	VAMOS	2.133.681,58	brAA+	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	12/11/21	15/10/31	VAMOS	1.599.709,56	brAA+	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	27/07/22	25/03/22	15/03/44	GBS PART	1.448.264,35	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	28/07/22	28/07/22	18/07/25	1V11	1.681.146,77	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	29/07/22	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	1.892.871,14	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/08/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	1.287,77	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	461.449,53	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	07/04/21	15/03/29	CAGECE	1.569.889,48	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	07/04/21	15/03/29	CAGECE	2.615.707,79	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/08/22	30/08/22	15/08/29	TRBR	5.797.211,71	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	02/09/22	02/09/22	02/09/29	AEGEA SA	1.715.190,16	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	27/09/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	55.374,26	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	28/09/22	28/09/22	28/09/27	B.BRASIL	4.611.071,42	-	AAA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/10/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	38.633,20	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	03/11/22	06/04/21	15/03/29	ANET	1.727.139,73	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/11/22	08/11/22	15/06/42	BRK AMBI	5.594.712,82	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/11/22	02/05/22	15/04/38	RDVE	1.863.116,19	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/11/22	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	1.665.888,73	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO	11/11/22	11/11/22	15/10/40	RAHOLD	2.973.130,35	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	11/11/22	11/11/22	15/10/40	RAHOLD	7.735.934,48	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	4.019.468,31	-	-	AA(bra)

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – MARÇO 2024



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/03/2024

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	1.809.367,91	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	1.481.495,87	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.486.915,57	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.810.007,04	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.482.283,44	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	01/12/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	1.744.552,07	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	2.152.043,04	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	2.282.978,57	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	1.665.231,43	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/12/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	3.086.425,24	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	15/12/21	15/11/36	ITAPOA T	1.313.596,55	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	02/05/22	15/04/38	RDVE	2.156.090,90	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	27/07/21	15/06/39	ANEMUS	3.278.129,31	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	26/01/23	26/01/23	20/01/26	CELG	3.171.554,63	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/03/23	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	321.276,23	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	16/03/23	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	1.263.201,76	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	16/03/23	15/12/21	15/11/36	ITAPOA T	3.988.299,97	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	16/03/23	27/07/22	15/04/36	BRV_VDR	9.003.482,65	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	20/03/23	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	961.214,60	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	14/04/23	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	680.969,47	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	17/04/23	17/04/23	17/03/30	VERO	2.983.898,39	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	20/04/23	12/05/22	15/04/27	BRKA	1.180.301,77	-	A+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	20/04/23	12/05/22	15/04/27	BRKA	32.581,79	-	A+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	26/04/23	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	2.395.036,11	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	06/04/23	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	1.975.962,37	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	06/04/23	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	2.261.790,89	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	06/04/23	18/06/21	15/12/30	MG050	3.223.554,85	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	06/04/23	08/11/22	15/06/42	BRK AMBI	1.404.444,07	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	06/04/23	08/07/21	15/06/31	VAMOS	1.084.515,61	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	05/05/23	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	831.558,51	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	05/05/23	22/10/21	15/12/35	CART	1.569.065,51	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	05/05/23	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	2.557.411,44	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	05/05/23	02/10/20	15/09/34	BRKA	308.037,03	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	05/05/23	02/10/20	15/09/34	BRKA	2.940.248,16	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	05/05/23	18/03/21	15/02/31	CORSAN	1.648.624,11	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	05/05/23	22/10/21	15/12/35	CART	677.551,02	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	05/05/23	10/02/21	15/12/31	METRORIO	5.248.540,57	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	08/05/23	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	236.182,30	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	09/05/23	08/11/22	15/06/42	BRK AMBI	2.456.866,73	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	09/05/23	22/10/21	15/12/35	CART	2.234.729,67	brAA+	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.120.600,67	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	16/05/23	23/12/20	15/12/27	SABESP	2.342.362,10	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	21/07/21	15/07/31	CACHOEIR	1.814.936,05	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	29/10/21	15/10/26	COELBA	1.912.679,68	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	04/05/22	15/04/27	LOCALIZA	2.977.122,74	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	16/05/23	23/12/21	21/12/28	SMARTIFI	3.193.510,32	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	26/05/23	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	62.688,50	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	02/06/23	25/06/21	20/06/26	OURO VER	294.022,82	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	19/06/23	25/03/22	15/03/44	GBS PART	2.964.183,17	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	19/06/23	26/07/21	15/06/33	ASA BRAN	2.789.204,52	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	23/06/23	23/06/23	15/05/43	IGUA RJ	1.388.786,12	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	28/06/23	08/07/21	15/06/31	VAMOS	1.087.815,36	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	28/06/23	28/07/22	18/07/25	1V11	381.471,22	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/07/23	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	1.574.177,78	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/07/23	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	1.039.183,87	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/07/23	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	1.039.183,87	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/07/23	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	1.574.177,78	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	13/07/23	28/07/22	18/07/25	1V11	1.156.752,36	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	13/07/23	28/07/22	18/07/25	1V11	282.761,69	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	21/07/23	23/12/20	15/12/26	RD COLIN	1.594.483,33	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	31/07/23	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	1.525.730,01	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	31/07/23	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	1.525.730,01	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	31/07/23	15/12/21	15/11/36	ITAPOA T	2.580.966,82	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	31/07/23	26/07/21	15/06/33	ASA BRAN	2.745.400,01	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	01/08/23	31/07/23	25/07/28	TIMS A	2.610.127,71	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	09/08/23	17/04/23	17/03/30	VERO	1.317.255,51	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	09/08/23	06/12/21	15/12/35	TESC	2.078.310,03	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	09/08/23	02/05/22	15/04/38	RDVE	3.206.234,00	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/08/23	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.202.756,15	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/08/23	05/06/18	05/06/28	BRADESCO	4.225.567,13	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	21/08/23	08/08/23	15/01/34	SPERIO4	2.469.595,50	brAA+	-	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	29/08/23	29/08/23	29/08/25	BRADESCO	10.755.083,58	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	30/08/23	30/08/23	01/09/25	VOLKSWAG	6.457.608,78	brAAA	AAA.br	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	08/09/23	08/09/23	08/09/25	B VOTORA	6.443.462,92	brAAA	AA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	14/09/23	06/01/21	15/11/25	QUATA	2.575,55	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	19/09/23	13/09/23	15/09/25	PANAMERI	5.312.201,06	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	21/09/23	21/09/23	15/09/28	ELETROB	2.576.417,15	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	28/09/23	28/09/23	15/09/30	CSMG	2.587.740,56	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	29/09/23	23/12/21	21/12/28	SMARTIFI	2.476.534,91	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	29/09/23	19/05/21	10/05/30	RODO BR	2.637.572,42	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	29/09/23	06/09/21	20/08/31	S LUIZ A	1.464.083,85	-	-	AAA(bra)



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/03/2024

Fundo	INFORMAÇÕES DOS ATIVOS					INFORMAÇÕES DE RATING		
	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	29/09/23	13/09/23	15/09/25	B VOTORA	5.307.506,97	brAAA	AA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	02/10/23	14/11/22	10/10/31	CORREDOR	2.425.850,05	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	20/10/23	20/10/23	20/10/28	SANTANDE	4.177.981,17	-	AAA.br	A-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/11/23	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	3.025.091,26	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/11/23	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	3.060.104,39	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/11/23	18/03/21	15/02/31	CORSAN	3.077.587,47	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/11/23	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	3.126.597,45	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/11/23	18/06/21	15/12/30	MG050	967.172,74	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	17/11/23	23/08/22	15/08/32	PETRJ	4.634.452,44	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	23/11/23	29/09/22	15/09/28	VERT5	2.508.669,93	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	23/11/23	10/12/21	17/11/28	DESKTOP	2.655.825,90	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/12/23	12/02/21	15/12/35	MS 306	1.086.699,78	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/12/23	30/08/22	15/08/29	TRBR	2.003.121,66	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/12/23	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.048.020,71	-	Aa3.br	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	26/12/23	27/12/22	02/06/26	BRADESCO	10.345.746,83	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	08/01/24	08/01/24	08/01/26	DAYCOVAL	10.280.722,05	brAA+	AA.br	AA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	08/01/24	08/01/24	08/01/26	B.ALFA	10.254.577,02	-	AAA.br	AA+(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	08/01/24	08/01/24	08/01/26	ABC	10.261.979,09	brAAA	AA+.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	17/04/23	17/03/30	VERO	2.893.838,92	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	2.122.175,30	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	2.122.175,30	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	25/03/22	15/03/44	GBS PART	2.096.141,91	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	25/03/22	15/03/44	GBS PART	2.069.768,13	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	1.013.464,01	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	2.028.088,92	brA	-	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	11/01/24	27/12/22	02/06/26	BRADESCO	10.876.416,15	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	18/01/24	18/01/24	04/01/27	TOYOTA	6.480.190,69	brAAA	-	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	24/01/24	24/01/24	26/01/26	ABC	10.205.327,29	brAAA	AA+.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	24/01/24	24/01/24	25/01/27	BTG PACT	4.356.600,42	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	25/01/24	25/01/24	26/01/26	BTG PACT	6.546.369,95	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	26/01/24	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	1.055.609,07	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	26/01/24	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.247.667,81	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	26/01/24	22/04/21	15/03/26	VX LOGI	1.301.583,62	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	30/01/24	28/04/21	15/04/31	MANAUSEN	2.620.307,89	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	30/01/24	01/06/23	25/05/26	LM TRANS	2.632.483,26	-	AA+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	30/01/24	27/10/21	15/10/29	CONT GLO	2.647.808,41	-	-	AA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	31/01/24	31/01/24	02/02/26	B.ALFA	10.784.878,15	-	AAA.br	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/02/24	08/02/24	15/09/31	PLANALTO	3.059.008,34	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	15/02/24	15/02/24	15/12/43	AGUAS SE	2.187.177,32	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	20/02/24	14/05/21	07/05/26	INTERVIA	2.619.871,53	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	20/02/24	12/11/21	30/04/29	HAPVIDA	557.804,59	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	21/02/24	18/03/21	15/02/26	CORSAN	1.280.860,54	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	21/02/24	19/05/22	13/05/28	CEA MODA	1.643.270,85	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	21/02/24	07/11/19	15/10/24	BKBR	1.560.023,27	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	21/02/24	19/04/22	16/04/29	VERT-10	1.839.944,63	-	-	AAAsf(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	26/02/24	07/04/21	15/03/26	CAGECE	2.449.194,45	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	26/02/24	24/03/22	11/03/27	ARTERIS	2.459.399,90	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	26/02/24	16/02/24	15/02/34	NTRASSUD	2.627.040,52	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	299.511,70	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	18/06/21	15/12/30	MG050	302.905,75	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	02/05/22	15/04/38	RDVE	810.436,52	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	813.608,39	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	299.511,70	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	12/02/21	15/12/35	MS 306	319.276,11	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	1.004.688,97	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	502.344,49	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	10/02/21	15/12/31	METRORIO	505.434,72	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	15/12/21	15/11/36	ITAPOA T	401.911,75	-	AA.br	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	26/02/24	26/02/24	01/03/27	BTG PACT	10.693.148,77	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	05/03/24	05/03/24	24/08/26	B VOTORA	6.552.752,81	brAAA	AA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	12/03/24	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	2.017.448,28	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	21/03/24	23/06/23	15/05/43	IGUA RJ	1.231.390,36	brAA+	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	-	FIDC VERDECARD SN3	178.067,70	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	-	FIDC CREDZ SN6	2.518.734,01	brAA(sf)	-	A+sf(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	FIDC VERDECARD SN5	88.357,75	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	VERDECARD FIDC SN6	1.060.705,16	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	FIDC VERDECARD SN8	1.388.424,79	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	RB CAP CREDIT AL SN3	608.740,62	brAA-(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	BR ELETRO FIDC S1	1.823.933,76	-	-	Aasf(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	INSS CONS PDL I FIDC	1.300.657,66	-	-	AAAsf(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	-	-	-	DRIVER SIX FIDC SN	1.102.381,24	-	AAA.br	-

Observação: Em março 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 **4.892.236.818,22**

Tópico do Enquadramento	Limite	Aplicação Atual	Valor Limite	% Aplicado	Status
			69,85%		
% do Segmento RF/PL PLANO	100,00%	4.283.844.402,77	4.892.236.818,22	87,56%	Enquadrado
% do PL em Títulos de Emissão do Tesouro Nacional e/ou do BACEN	100,00%	3.417.265.123,40	4.892.236.818,22	69,85%	Enquadrado
% do PL em Títulos RF-1, exceto títulos do Tesouro Nacional	80,00%	866.579.279,36	3.913.789.512,90	17,71%	Enquadrado
% do PL em FIDC	20,00%	Verificar Rel. de Diversificação de FIDC's	978.447.378,22	0,00%	Enquadrado
% do PL em uma mesma pessoa jurídica não-financeira	10,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Não Financ.	489.223.689,11	0,00%	Enquadrado
% do PL em Instituições Financeiras	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Financ.	1.223.059.204,56	0,00%	Enquadrado
% de uma mesma Série de Debêntures	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Debêntures	1.223.059.204,56	0,00%	Enquadrado
% do PL em RV	70,00%	505.032.117,69	3.424.565.714,43	10,32%	Enquadrado
% do capital votante de uma empresa	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação RV	1.223.059.204,56	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Imobiliários	20,00%	79.550.643,64	978.447.378,22	1,63%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Empréstimos	15,00%	25.532.807,84	733.835.551,89	0,52%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Estruturados	20,00%	0,00	978.447.378,22	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos no Exterior	10,00%	0,00	489.223.689,11	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 MARÇO DE 2024 À 28 DE MARÇO 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
01/03/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,7395%	5,7646%	5,5987%	5,9025%	-0,0251%	NÃO
04/03/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,7495%	5,7802%	5,6182%	5,9220%	-0,0307%	NÃO
05/03/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	5,7505%	5,7900%	5,6337%	5,9376%	-0,0395%	NÃO
06/03/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,7695%	5,7660%	5,6435%	5,9474%	0,0035%	NÃO
06/03/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,7795%	5,7660%	5,6435%	5,9474%	0,0135%	NÃO
06/03/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,7895%	5,7660%	5,6435%	5,9474%	0,0235%	NÃO
07/03/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	5,7705%	5,7639%	5,6195%	5,9234%	0,0066%	NÃO
14/03/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,7695%	5,8200%	5,6294%	5,9334%	-0,0505%	NÃO
15/03/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	5,8305%	5,8600%	5,6732%	5,9774%	-0,0295%	NÃO
18/03/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	5,8405%	5,8952%	5,7130%	6,0174%	-0,0547%	NÃO
18/03/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	5,8405%	5,8952%	5,7130%	6,0174%	-0,0547%	NÃO
18/03/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	5,8405%	5,8952%	5,7130%	6,0174%	-0,0547%	NÃO
18/03/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	5,8405%	5,8952%	5,7130%	6,0174%	-0,0547%	NÃO
18/03/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	5,8405%	5,8952%	5,7130%	6,0174%	-0,0547%	NÃO
18/03/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	5,8405%	5,8952%	5,7130%	6,0174%	-0,0547%	NÃO
18/03/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	5,8405%	5,8952%	5,7130%	6,0174%	-0,0547%	NÃO
18/03/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	5,8405%	5,8952%	5,7130%	6,0174%	-0,0547%	NÃO
19/03/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	5,9105%	5,8900%	5,7480%	6,0526%	0,0205%	NÃO
20/03/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	LFT	01/03/2025	Compra	0,0001%	-0,0012%	-0,0189%	0,0262%	0,0013%	NÃO
21/03/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	5,8605%	5,8975%	5,7120%	6,0164%	-0,0370%	NÃO
21/03/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	5,8605%	5,8975%	5,7120%	6,0164%	-0,0370%	NÃO

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – MARÇO 2024

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE MARÇO DE 2024 À 28 DE MARÇO 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.	
04/03/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2024	Compra	7,4592%	7,5061%	6,9733%	7,9361%	-0,0469%	NÃO
21/03/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	LTN	01/01/2028	Compra	10,4898%	10,4864%	9,9871%	10,8207%	0,0034%	NÃO
28/03/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	LTN	01/01/2028	Compra	10,5572%	10,5555%	10,0751%	10,9088%	0,0017%	NÃO

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE MARÇO DE 2024 À 28 DE MARÇO 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.	
20/03/2024	FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	ICATU VA	TULL PRE	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,8890%	5,8590%	5,7429%	6,0474%	0,0300%	NÃO
21/03/2024	FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	ICATU VA	LIQUIDEZ	NTN-B	15/08/2050	Compra	5,8690%	5,8975%	5,7120%	6,0164%	-0,0285%	NÃO

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – MARÇO 2024



RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

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



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
01-03-24	FIA RVA EMB II	Venda	CPFE3	35,43	4.800,00	170.084,50	35,37	35,51	35,79	7.057,00
01-03-24	FIA RVA EMB II	Compra	VIVT3	53,99	3.300,00	178.167,00	53,91	54,28	54,76	10.650,00
01-03-24	FIA RVA EMB II	Compra	VIVT3	53,95	100,00	5.395,00	53,91	54,28	54,76	10.650,00
01-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	24,53	1.800,00	44.151,17	24,19	24,44	24,69	9.271,00
01-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALPA4	10,11	1.800,00	18.198,00	10,04	10,18	10,32	5.690,00
01-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALPA4	10,21	6.700,00	68.398,10	10,04	10,18	10,32	5.690,00
01-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	36,07	7.300,00	263.331,30	35,86	36,07	36,40	16.633,00
01-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	9,06	24.100,00	218.286,65	9,00	9,07	9,24	7.259,00
01-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPL6	10,16	6.900,00	70.091,32	10,03	10,10	10,25	32.646,00
01-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENAT3	26,05	1.300,00	33.869,49	25,28	25,96	26,34	8.599,00
01-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	33,85	1.400,00	47.390,00	33,68	33,93	34,17	11.358,00
01-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,68	12.700,00	46.725,53	3,59	3,67	3,74	16.662,00
01-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	23,49	1.400,00	32.880,62	23,12	23,38	23,68	12.271,00
01-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	16,49	12.900,00	212.766,52	15,85	16,40	16,74	31.657,00
01-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	LWSA3	5,77	7.800,00	45.008,33	5,58	5,75	5,84	11.109,00
01-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	2,21	33.600,00	74.349,19	2,13	2,19	2,25	19.636,00
01-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	16,51	2.400,00	39.620,05	16,34	16,48	16,62	14.464,00
01-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	16,44	1.800,00	29.592,00	16,34	16,48	16,62	14.464,00
01-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	16,38	1.100,00	18.018,00	16,34	16,48	16,62	14.464,00
01-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	44,61	1.500,00	66.916,70	44,03	44,58	45,09	16.035,00
01-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	22,35	10.800,00	241.403,90	22,16	22,34	22,78	17.237,00
01-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	22,40	6.800,00	152.320,00	22,16	22,34	22,78	17.237,00
01-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	25,17	900,00	22.655,43	24,38	25,13	25,44	9.822,00
01-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	57,04	1.700,00	96.963,21	56,40	57,04	57,63	21.191,00
01-03-24	FIA RVA EMB IV	Venda	GMAT3	7,96	4.800,00	38.217,09	7,89	7,97	8,11	7.481,00
01-03-24	FIA RVA EMB IV	Venda	GMAT3	7,96	30.415,00	242.105,87	7,89	7,97	8,11	7.481,00
01-03-24	FIA RVA EMB IV	Venda	GMAT3	8,00	4.686,00	37.490,71	7,89	7,97	8,11	7.481,00
01-03-24	FIA RVA EMB IV	Venda	GMAT3	7,95	3.515,00	27.944,25	7,89	7,97	8,11	7.481,00
04-03-24	FIA RVA EMB II	Compra	ABEV3	12,49	23.700,00	296.122,00	12,41	12,47	12,57	21.198,00
04-03-24	FIA RVA EMB II	Venda	AZUL4	11,96	22.600,00	270.186,00	11,88	11,99	12,33	9.488,00
04-03-24	FIA RVA EMB II	Compra	B3SA3	12,32	37.800,00	465.756,00	12,26	12,34	12,44	33.720,00
04-03-24	FIA RVA EMB II	Venda	ECOR3	9,13	31.600,00	288.433,00	9,09	9,18	9,40	5.190,00
04-03-24	FIA RVA EMB II	Venda	GGPS3	17,31	3.900,00	67.498,00	17,20	17,39	17,73	5.848,00
04-03-24	FIA RVA EMB II	Compra	ITSA4	10,27	19.200,00	197.179,00	10,23	10,26	10,32	24.110,00
04-03-24	FIA RVA EMB II	Venda	LJQQ3	5,33	9.600,00	51.209,00	5,28	5,36	5,55	5.022,00
04-03-24	FIA RVA EMB II	Compra	PETR3	41,11	37.800,00	1.553.927,92	40,88	41,20	41,84	17.622,00
04-03-24	FIA RVA EMB II	Venda	PETR4	40,19	40.000,00	1.607.452,18	40,02	40,28	40,75	40.648,00
04-03-24	FIA RVA EMB II	Venda	RAIL3	22,08	9.400,00	207.582,00	22,03	22,13	22,33	13.749,00
04-03-24	FIA RVA EMB II	Compra	WEGE3	36,93	13.500,00	498.616,00	36,67	37,00	37,43	16.153,00
04-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	36,19	700,00	25.331,83	35,48	35,90	36,30	17.029,00
04-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	35,90	1.400,00	50.258,48	35,48	35,90	36,30	17.029,00
04-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	10,07	6.700,00	67.475,90	10,01	10,07	10,14	19.380,00
04-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,10	21.900,00	265.027,30	11,97	12,15	12,62	18.902,00
04-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,64	66.300,00	241.628,77	3,60	3,64	3,75	21.429,00
04-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,27	7.300,00	74.942,13	10,23	10,26	10,32	24.110,00
04-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	LREN3	16,22	4.000,00	64.864,83	16,09	16,26	16,62	23.418,00
04-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	LWSA3	5,58	4.500,00	25.130,60	5,54	5,61	5,79	9.441,00
04-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	2,14	30.100,00	64.419,47	2,10	2,15	2,24	19.028,00
04-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	16,10	2.700,00	43.470,00	16,05	16,22	16,62	21.513,00
04-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	16,21	7.700,00	124.848,62	16,05	16,22	16,62	21.513,00
04-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	44,40	3.100,00	137.625,47	44,11	44,32	44,68	10.813,00
04-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	44,34	900,00	39.906,00	44,11	44,32	44,68	10.813,00
04-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	51,24	1.700,00	87.107,74	51,01	51,35	52,90	33.139,00
04-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT9	45,35	16,00	725,60	51,01	51,35	52,90	33.139,00
04-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	SBSB3	79,43	1.700,00	135.027,06	78,67	79,49	80,14	11.979,00
04-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	6,80	10.600,00	72.128,01	6,71	6,84	7,14	25.904,00
04-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	58,08	1.500,00	87.116,52	57,39	58,07	58,55	15.982,00
04-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	19,93	3.500,00	69.747,01	19,69	19,97	20,67	7.835,00
04-03-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	49,50	17,00	841,47	49,28	49,60	50,33	10.887,00
04-03-24	FIA RVA EMB IV	Venda	GMAT3	7,87	4.416,00	34.770,79	7,78	7,83	7,97	6.558,00
04-03-24	FIA RVA EMB IV	Venda	GMAT3	7,82	4.619,00	36.102,81	7,78	7,83	7,97	6.558,00
05-03-24	FIA RVA EMB II	Compra	BBA53	58,14	4.500,00	261.645,00	57,69	58,06	58,37	19.494,00
05-03-24	FIA RVA EMB II	Venda	BBDC4	13,72	10.700,00	146.852,56	13,58	13,71	13,81	31.864,00
05-03-24	FIA RVA EMB II	Venda	ENEV3	12,23	6.200,00	75.828,54	12,15	12,23	12,37	16.157,00
05-03-24	FIA RVA EMB II	Venda	PRI03	44,15	6.100,00	269.291,46	43,80	44,15	44,41	14.589,00
05-03-24	FIA RVA EMB II	Compra	RECV3	23,19	9.700,00	224.978,67	22,91	23,14	23,34	5.606,00
05-03-24	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	66,12	4.200,00	277.685,12	65,60	65,91	66,29	59.316,00
05-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	24,01	3.000,00	72.024,09	23,97	24,18	24,63	8.201,00
05-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	35,57	9.100,00	323.680,06	35,29	35,60	36,27	19.281,00
05-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	43,60	1.600,00	69.760,00	43,42	43,80	44,30	29.327,00
05-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	43,62	1.200,00	52.349,24	43,42	43,80	44,30	29.327,00
05-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	33,74	1.300,00	43.864,70	33,53	33,80	34,17	13.319,00
05-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	15,72	5.500,00	86.474,25	15,58	15,71	15,99	7.807,00
05-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	3,76	45.600,00	171.401,78	3,66	3,75	3,82	41.276,00
05-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,31	10.300,00	106.155,81	10,25	10,30	10,37	24.908,00
05-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,31	10.700,00	110.317,00	10,25	10,30	10,37	24.908,00
05-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	LWSA3	5,80	5.839,00	33.891,92	5,59	5,81	5,93	11.602,00
05-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	2,16	96.100,00	207.620,74	2,11	2,14	2,18	18.643,00
05-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	16,22	300,00	4.867,49	15,95	16,50	16,78	15.902,00
05-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,11	6.900,00	152.550,95	21,93	22,08	22,26	17.050,00
05-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	50,94	1.300,00	66.226,63	50,68	51,04	51,91	27.313,00
05-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	SRNA3	8,49	300,00	2.547,08	8,42	8,56	8,84	4.981,00
05-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	SRNA3	8,53	15.100,00	128.749,55	8,42	8,56	8,84	4.981,00
05-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	58,47	1.600,00	93.547,70	57,91	58,46	58,98	17.132,00
05-03-24	FIA RVA EMB IV	Venda	GMAT3	7,80	15.075,00	117.580,18	7,65	7,76	7,93	9.071,00
05-03-24	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	3,75	14.796,00	55.521,91	3,66	3,75	3,82	41.276,00

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

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



							DADOS BM&FBOVESPA			
DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
05-03-24	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	3,75	23.673,00	88.869,85	3,66	3,75	3,82	41.276,00
05-03-24	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	3,71	47.346,00	175.449,58	3,66	3,75	3,82	41.276,00
05-03-24	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	28,54	349,00	9.962,13	28,26	28,58	29,31	32.858,00
05-03-24	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	28,55	6.578,00	187.792,87	28,26	28,58	29,31	32.858,00
06-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	35,91	6.100,00	219.023,09	35,40	35,87	36,16	20.041,00
06-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	43,78	1.100,00	48.158,00	43,46	43,76	44,15	14.709,00
06-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	43,77	1.900,00	83.160,49	43,46	43,76	44,15	14.709,00
06-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENAT3	25,60	2.600,00	66.571,09	25,32	25,67	26,44	13.290,00
06-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	3,80	16.700,00	63.456,64	3,70	3,80	3,88	29.851,00
06-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	3,80	40.800,00	155.067,91	3,70	3,80	3,88	29.851,00
06-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,39	5.300,00	55.091,05	10,30	10,41	10,47	22.299,00
06-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,39	5.100,00	52.969,69	10,30	10,41	10,47	22.299,00
06-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	2,05	31.800,00	65.078,86	2,03	2,08	2,16	30.736,00
06-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTC03	16,92	6.400,00	108.305,56	16,74	16,94	17,08	19.454,00
06-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,30	2.000,00	44.591,05	21,98	22,27	22,46	21.332,00
06-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	REC3	21,64	13.400,00	289.978,05	21,41	21,73	22,54	18.371,00
06-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	51,34	800,00	41.072,62	50,73	51,27	52,12	32.744,00
06-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	SRNA3	8,69	6.700,00	58.245,35	8,45	8,75	8,97	5.548,00
06-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	SRNA3	8,65	200,00	1.730,00	8,45	8,75	8,97	5.548,00
06-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	SRNA3	8,75	8.000,00	69.999,98	8,45	8,75	8,97	5.548,00
06-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	58,40	2.600,00	151.841,06	57,92	58,39	58,94	15.788,00
06-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	21,13	2.700,00	57.059,73	20,50	21,05	21,56	18.110,00
06-03-24	FIA RVA EMB IV	Venda	GMAT3	7,80	2.197,00	17.136,60	7,73	7,80	7,89	7.144,00
06-03-24	FIA RVA EMB IV	Venda	GMAT3	7,81	25.533,00	199.307,70	7,73	7,80	7,89	7.144,00
06-03-24	FIA RVA EMB IV	Compra	PRI03	43,96	982,00	43.166,54	43,24	44,05	44,79	23.454,00
06-03-24	FIA RVA EMB IV	Compra	PRI03	44,09	982,00	43.294,86	43,24	44,05	44,79	23.454,00
06-03-24	FIA RVA EMB IV	Compra	PRI03	43,92	475,00	20.860,18	43,24	44,05	44,79	23.454,00
06-03-24	FIA RVA EMB IV	Compra	PRI03	43,95	2.456,00	107.941,20	43,24	44,05	44,79	23.454,00
07-03-24	FIA RVA EMB II	Venda	CRFB3	11,69	24.500,00	286.439,06	11,61	11,72	11,89	6.203,00
07-03-24	FIA RVA EMB II	Venda	GGPS3	17,63	6.300,00	111.063,05	17,38	17,58	17,76	6.264,00
07-03-24	FIA RVA EMB II	Compra	GMAT3	8,13	25.600,00	208.229,24	8,03	8,15	8,36	17.319,00
07-03-24	FIA RVA EMB II	Venda	PETRA	40,32	4.300,00	173.393,56	40,28	40,51	40,94	54.227,00
07-03-24	FIA RVA EMB II	Compra	TIMS3	18,49	10.000,00	184.934,08	18,14	18,45	18,62	12.389,00
07-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	24,20	1.300,00	31.465,15	24,05	24,24	24,50	7.334,00
07-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	32,94	700,00	23.059,90	32,61	32,86	33,05	11.131,00
07-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	35,36	1.500,00	53.042,10	35,09	35,42	35,88	13.737,00
07-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	43,33	1.300,00	56.333,48	43,10	43,35	43,71	13.058,00
07-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENAT3	25,77	400,00	10.308,00	25,65	25,84	25,99	6.930,00
07-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	12,24	3.100,00	37.939,04	12,15	12,23	12,36	6.895,00
07-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQT13	33,52	1.100,00	36.867,81	33,36	33,57	33,73	9.064,00
07-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	15,66	1.800,00	28.183,79	15,51	15,65	15,79	6.452,00
07-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	15,70	2.100,00	32.970,00	15,51	15,65	15,79	6.452,00
07-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	15,70	800,00	12.558,16	15,51	15,65	15,79	6.452,00
07-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	3,82	8.200,00	31.319,42	3,74	3,81	3,86	26.662,00
07-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGT11	23,61	2.000,00	47.214,12	23,37	23,57	23,73	11.471,00
07-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,29	6.800,00	69.992,16	10,26	10,32	10,47	14.752,00
07-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	2,04	9.200,00	18.768,00	2,03	2,05	2,08	21.828,00
07-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTC03	17,09	1.600,00	27.337,00	16,76	17,03	17,27	10.543,00
07-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	43,55	500,00	21.777,41	43,35	43,57	43,98	13.860,00
07-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	22,06	1.800,00	39.709,82	21,98	22,09	22,31	9.107,00
07-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	REC3	20,72	700,00	14.504,00	20,69	21,08	21,59	16.217,00
07-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	REC3	21,08	5.100,00	107.503,56	20,69	21,08	21,59	16.217,00
07-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	51,54	700,00	36.077,93	51,08	52,03	53,25	25.831,00
07-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	24,78	600,00	14.867,00	24,69	24,90	25,32	7.592,00
07-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	6,97	3.400,00	23.681,78	6,94	7,03	7,22	7.858,00
07-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	58,88	900,00	52.988,59	57,59	58,65	58,96	15.415,00
07-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	21,42	200,00	4.284,85	20,64	21,32	21,66	15.838,00
07-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	20,83	500,00	10.414,98	20,64	21,32	21,66	15.838,00
07-03-24	FIA RVA EMB IV	Compra	PRI03	43,60	8.416,00	366.903,14	43,35	43,57	43,98	13.860,00
08-03-24	FIA RVA EMB II	Compra	CPL6	10,23	18.500,00	189.165,55	10,06	10,18	10,25	13.951,00
08-03-24	FIA RVA EMB II	Venda	PETRA	35,92	22.800,00	819.022,62	35,10	36,17	37,06	264.414,00
08-03-24	FIA RVA EMB II	Compra	TOTS3	30,05	11.300,00	339.518,52	29,77	30,05	30,37	12.490,00
08-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	24,17	1.600,00	38.671,48	24,00	24,22	24,70	10.713,00
08-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	57,83	300,00	17.350,44	56,03	57,13	58,17	55.324,00
08-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	32,83	800,00	26.260,23	32,52	32,77	32,97	13.845,00
08-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	35,77	1.700,00	60.805,49	34,82	35,56	36,09	47.395,00
08-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	35,65	1.100,00	39.213,30	34,82	35,56	36,09	47.395,00
08-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	35,77	2.500,00	89.412,86	34,82	35,56	36,09	47.395,00
08-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPL6	9,14	2.600,00	23.771,00	9,02	9,10	9,18	4.518,00
08-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	43,50	1.400,00	60.894,49	42,42	43,30	43,70	19.736,00
08-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,48	1.000,00	12.484,46	12,22	12,48	12,60	13.975,00
08-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENIU3	1,71	2.500,00	4.275,00	1,70	1,72	1,80	305,00
08-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQT13	33,58	1.800,00	60.442,85	33,25	33,57	33,93	20.485,00
08-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	15,24	3.700,00	56.388,00	15,21	15,36	16,17	12.068,00
08-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	15,37	6.000,00	92.216,67	15,21	15,36	16,17	12.068,00
08-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	15,27	500,00	7.635,66	15,21	15,36	16,17	12.068,00
08-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	3,90	22.200,00	86.556,49	3,71	3,88	4,00	26.566,00
08-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	3,90	7.000,00	27.270,38	3,71	3,88	4,00	26.566,00
08-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGT11	23,60	2.500,00	59.001,34	23,41	23,64	24,16	14.483,00
08-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,42	16.800,00	175.025,90	10,28	10,39	10,47	19.347,00
08-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,45	5.300,00	55.408,64	10,28	10,39	10,47	19.347,00
08-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,43	4.200,00	43.789,52	10,28	10,39	10,47	19.347,00
08-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	2,04	8.400,00	17.113,52	2,01	2,03	2,07	21.962,00
08-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTC03	17,36	1.800,00	31.241,71	17,01	17,33	17,64	20.734,00
08-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	PETRA	35,97	6.800,00	244.617,75	35,47	36,63	37,96	186.485,00
08-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	PETRA	36,67	14.100,00	517.009,31	35,47	36,63	37,96	186.485,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – MARÇO 2024

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL
Mês de Referência: 01 DE MARÇO DE 2024 À 28 DE MARÇO DE 2024



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
08-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	44,63	900,00	40.168,62	43,28	44,73	45,46	31.367,00
08-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	22,17	2.200,00	48.775,32	21,98	22,20	22,38	11.233,00
08-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	21,30	1.100,00	23.435,09	20,69	21,35	21,72	18.456,00
08-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	53,37	2.400,00	128.092,23	52,49	53,59	54,73	27.176,00
08-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	53,22	800,00	42.573,37	52,49	53,59	54,73	27.176,00
08-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	24,64	900,00	22.178,90	24,50	24,73	25,35	7.391,00
08-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	7,00	7.100,00	49.696,73	6,82	6,99	7,15	14.132,00
08-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	SOMA3	6,99	2.800,00	19.558,67	6,82	6,99	7,15	14.132,00
08-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	58,82	1.100,00	64.702,41	57,96	58,62	59,27	44.524,00
08-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	21,23	1.100,00	23.355,96	21,14	21,45	21,93	12.100,00
11-03-24	FIA RVA EMB II	Compra	BBDC4	13,92	11.300,00	157.296,00	13,78	13,90	13,97	31.628,00
11-03-24	FIA RVA EMB II	Venda	CRFB3	11,61	9.500,00	110.281,99	11,54	11,65	11,81	9.803,00
11-03-24	FIA RVA EMB II	Venda	GOAU4	9,85	19.100,00	188.143,67	9,72	9,83	9,91	10.008,00
11-03-24	FIA RVA EMB II	Compra	INTB3	21,19	8.000,00	169.553,97	21,01	21,32	21,62	4.346,00
11-03-24	FIA RVA EMB II	Venda	PETR3	36,89	9.600,00	354.144,00	36,14	36,93	37,97	47.204,00
11-03-24	FIA RVA EMB II	Venda	PETR3	36,27	8.800,00	319.176,00	36,14	36,93	37,97	47.204,00
11-03-24	FIA RVA EMB II	Compra	PETR4	37,00	14.600,00	540.200,00	35,30	36,32	37,74	144.440,00
11-03-24	FIA RVA EMB II	Compra	RECV3	21,87	6.800,00	148.719,77	21,24	21,83	22,22	11.426,00
11-03-24	FIA RVA EMB II	Compra	TIMS3	18,32	1.800,00	32.983,46	18,27	18,43	18,92	16.513,00
11-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	24,18	1.800,00	43.520,07	23,92	24,09	24,30	8.850,00
11-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	24,25	900,00	21.825,00	23,92	24,09	24,30	8.850,00
11-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	24,08	900,00	21.672,00	23,92	24,09	24,30	8.850,00
11-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	33,31	2.600,00	86.617,81	33,20	33,31	33,58	15.854,00
11-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	3,88	28.400,00	110.321,22	3,81	3,88	3,94	30.659,00
11-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	23,71	1.800,00	42.678,00	23,50	23,65	23,83	10.425,00
11-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	23,72	1.800,00	42.689,49	23,50	23,65	23,83	10.425,00
11-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	44,62	3.900,00	174.026,17	43,65	45,00	45,60	28.306,00
11-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	21,09	1.200,00	25.306,06	20,83	21,12	21,40	7.088,00
11-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	21,03	1.100,00	23.135,00	20,83	21,12	21,40	7.088,00
12-03-24	FIA RVA EMB II	Compra	CMIG4	11,97	7.700,00	92.201,03	11,81	11,95	12,05	14.081,00
12-03-24	FIA RVA EMB II	Venda	GGPS3	17,87	12.700,00	226.897,88	17,50	17,79	17,90	5.087,00
12-03-24	FIA RVA EMB II	Compra	INTB3	21,85	7.200,00	157.292,87	21,29	21,84	22,15	12.412,00
12-03-24	FIA RVA EMB II	Compra	TOTS3	31,28	2.900,00	90.697,76	30,11	30,92	31,45	11.208,00
12-03-24	FIA RVA EMB II	Compra	VALE3	60,89	4.400,00	267.912,70	60,66	61,40	62,57	83.139,00
12-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	24,44	1.600,00	39.097,98	24,02	24,35	24,53	9.092,00
12-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	43,84	2.500,00	109.611,79	43,08	43,68	43,97	19.572,00
12-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENAT3	27,13	500,00	13.565,00	25,60	26,41	27,13	6.198,00
12-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,40	2.000,00	24.800,00	12,17	12,44	12,62	14.154,00
12-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,36	4.400,00	54.403,46	12,17	12,44	12,62	14.154,00
12-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	12,30	1.500,00	18.450,00	12,17	12,44	12,62	14.154,00
12-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	33,44	2.500,00	83.590,62	33,07	33,33	33,61	16.610,00
12-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	33,25	2.600,00	86.450,00	33,07	33,33	33,61	16.610,00
12-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	15,23	1.100,00	16.752,58	15,11	15,28	15,78	10.676,00
12-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	15,24	13.100,00	199.621,86	15,11	15,28	15,78	10.676,00
12-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	3,91	12.300,00	48.145,70	3,80	3,91	3,98	38.629,00
12-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	3,91	8.800,00	34.408,00	3,80	3,91	3,98	38.629,00
12-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	23,56	2.700,00	63.616,74	23,37	23,54	23,73	13.488,00
12-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU9	1,95	42.889,00	83.633,55	1,98	2,02	2,05	41.892,00
12-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTC03	18,28	2.000,00	36.556,43	16,93	17,93	18,55	44.984,00
12-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTC03	17,56	2.300,00	40.388,00	16,93	17,93	18,55	44.984,00
12-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTC03	18,11	900,00	16.295,92	16,93	17,93	18,55	44.984,00
12-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTC03	18,21	27.200,00	495.374,33	16,93	17,93	18,55	44.984,00
12-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	PETR3	37,28	11.500,00	428.683,17	36,79	37,19	37,75	32.059,00
12-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	47,08	10.600,00	499.006,82	45,17	46,93	47,97	42.960,00
12-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	RECV3	22,13	1.100,00	24.342,46	21,76	21,99	22,26	10.290,00
12-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	53,86	2.400,00	129.256,46	52,32	53,59	54,85	34.612,00
12-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	54,00	1.900,00	102.600,00	52,32	53,59	54,85	34.612,00
12-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	24,96	1.100,00	27.453,77	24,40	24,83	25,17	4.213,00
12-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	7,29	5.900,00	43.007,28	6,94	7,19	7,36	11.594,00
12-03-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	MAXR11	81,84	219,00	17.923,82	81,30	81,85	82,64	54,00
12-03-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	RBRP11	58,90	1.116,00	65.726,82	57,71	58,98	60,09	6.320,00
12-03-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ABEV3	12,84	1.518,00	19.491,42	12,76	12,82	12,90	33.767,00
12-03-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ALOS3	24,47	184,00	4.502,81	24,02	24,35	24,53	9.092,00
12-03-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ALPA4	9,91	61,00	604,70	9,63	9,85	10,02	7.465,00
12-03-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ARZZ3	60,82	21,00	1.277,22	58,44	60,14	61,52	8.177,00
12-03-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ASAI3	14,72	466,00	6.860,71	14,18	14,64	14,83	10.441,00
12-03-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	AZUL4	12,48	113,00	1.410,70	11,93	12,30	12,60	16.317,00
12-03-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	B3SA3	12,82	1.935,00	24.807,36	12,64	12,76	12,90	37.413,00
12-03-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBAS3	57,60	491,00	28.281,87	56,63	57,40	58,11	30.855,00
12-03-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBDC4	12,48	518,00	6.465,69	12,32	12,45	12,55	12.275,00
12-03-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBDC4	14,09	1.778,00	25.052,20	13,91	14,06	14,16	53.889,00
12-03-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBSF3	32,94	232,00	7.642,63	32,73	32,93	33,02	8.743,00
12-03-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BEEF3	6,81	90,00	612,60	6,72	6,80	6,89	11.029,00
12-03-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BHIA3	8,09	33,00	266,94	8,03	8,19	8,35	5.561,00
12-03-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BPAC11	36,43	397,00	14.461,49	35,66	36,27	36,72	16.401,00
12-03-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRAP4	20,17	86,00	1.734,97	20,12	20,25	20,55	9.803,00
12-03-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRFS3	17,02	580,00	9.873,22	16,28	16,87	17,14	21.020,00
12-03-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRKM5	20,49	92,00	1.885,25	20,43	20,62	21,12	6.307,00
12-03-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CCRO3	14,07	343,00	4.826,13	13,78	13,98	14,07	16.517,00
12-03-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CIEL3	5,35	379,00	2.027,65	5,35	5,36	5,38	12.608,00
12-03-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CMIG4	11,96	496,00	5.933,60	11,81	11,95	12,05	14.081,00
12-03-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CMIN3	5,87	384,00	2.253,60	5,81	5,86	5,93	10.239,00
12-03-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	COGN3	2,79	627,00	1.749,33	2,68	2,75	2,81	13.859,00
12-03-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CPFE3	34,07	65,00	2.214,50	34,00	34,27	34,74	7.055,00
12-03-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CPL66	10,05	581,00	5.839,11	9,95	10,04	10,10	14.804,00
12-03-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CRFB3	12,00	184,00	2.208,77	11,72	11,96	12,18	13.879,00

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE MARÇO DE 2024 À 28 DE MARÇO 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
28-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGT111	23,31	3.300,00	76.916,62	23,13	23,33	23,74	15.426,00
28-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,46	3.900,00	40.798,13	10,38	10,47	10,53	12.782,00
28-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	1,82	13.100,00	23.777,26	1,79	1,81	1,85	31.287,00
28-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTOC3	17,79	700,00	12.453,00	17,64	17,91	18,21	17.443,00
28-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	PETR3	37,46	100,00	3.745,94	37,07	37,91	38,33	12.922,00
28-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	PETR3	37,98	2.100,00	79.761,67	37,07	37,91	38,33	12.922,00
28-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	48,69	700,00	34.083,23	47,52	48,45	49,09	21.082,00
28-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	22,30	2.700,00	60.214,48	22,13	22,40	22,69	32.410,00
28-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	23,47	800,00	18.778,56	22,89	23,40	23,62	8.501,00
28-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	23,28	5.300,00	123.409,44	22,89	23,40	23,62	8.501,00
28-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	23,50	1.600,00	37.594,55	22,89	23,40	23,62	8.501,00
28-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	54,90	2.000,00	109.795,84	53,57	54,73	55,20	24.001,00
28-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	54,84	4.000,00	219.347,29	53,57	54,73	55,20	24.001,00
28-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	26,10	1.500,00	39.150,00	25,83	26,05	26,42	12.647,00
28-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	26,13	1.500,00	39.195,00	25,83	26,05	26,42	12.647,00
28-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	26,05	1.800,00	46.892,58	25,83	26,05	26,42	12.647,00
28-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	7,64	11.900,00	90.889,04	7,46	7,62	7,74	17.953,00
28-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	7,63	4.500,00	34.348,85	7,46	7,62	7,74	17.953,00
28-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	SOMA3	7,59	8.600,00	65.234,45	7,46	7,62	7,74	17.953,00
28-03-24	FIA RVA EMB III	Compra	SRNA3	9,00	156.700,00	1.410.300,00	9,15	9,45	9,69	12.375,00
28-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	63,81	3.400,00	216.962,62	63,28	63,81	64,08	16.598,00
28-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	63,87	1.600,00	102.197,61	63,28	63,81	64,08	16.598,00
28-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	25,58	4.200,00	107.428,70	25,04	25,43	25,96	11.767,00
28-03-24	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	18,20	1.400,00	25.478,89	17,40	18,04	18,39	8.380,00
28-03-24	FIA RVA EMB IV	Compra	AURE3	11,90	46.285,00	550.858,15	11,81	11,89	11,95	6.234,00
28-03-24	FIA RVA EMB IV	Venda	EQTL3	32,21	6.655,00	214.371,45	32,00	32,39	32,89	28.303,00
28-03-24	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	8,77	64.044,00	561.551,57	8,53	8,74	8,83	12.175,00
28-03-24	FIA RVA EMB IV	Compra	PRI03	48,47	2.602,00	126.122,35	47,52	48,45	49,09	21.082,00
28-03-24	FIA RVA EMB IV	Compra	PRI03	48,70	7.567,00	368.481,06	47,52	48,45	49,09	21.082,00
28-03-24	FIA RVA EMB IV	Compra	PRI03	48,45	1.599,00	77.467,05	47,52	48,45	49,09	21.082,00
28-03-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RENT3	54,81	1.996,00	109.407,17	53,57	54,73	55,20	24.001,00
28-03-24	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	28,51	19.359,00	551.906,08	28,15	28,48	28,67	12.800,00
28-03-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	25,18	782,00	19.690,76	24,93	25,11	25,31	20.093,00
28-03-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	25,13	4.573,00	114.916,10	24,93	25,11	25,31	20.093,00
28-03-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	25,13	3.297,00	82.864,92	24,93	25,11	25,31	20.093,00
28-03-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	TRXF13	109,19	12.799,00	1.397.522,81	111,77	111,97	112,16	7.749,00

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.