



DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO

Outubro/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 – OUTUBRO 2024

Relatório de Risco de Mercado



FUNDO: EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS
CNPJ: 10679245000140

Data: 31/10/2024

Dados Gerais									
PL:	4.951.227.218,27	VAR / PL:	1,7211%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	2.168,25		
VAR:	85.213.216,58	ETL / PL:	2,1583%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1.490,41		
ETL:	106.860.811,39	VAR / CDI:	0,0189%	Benchmark:					

Cenários de STRESS									
Cenário Alta - 09999 (+):	153.292.346,23	Cenário Baixa - 10000 (+):	167.623.709,73	CENARIO BRADESCO 1 (+):	329.444.528,76	CENARIO BRADESCO 2 (+):	613.215.000,95		
Cenário Alta - 09999 (-):	-211.399.454,01	Cenário Baixa - 10000 (-):	-157.118.845,18	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-66.649.978,02	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-901.178.328,26		
Cenário Alta - 09999:	-58.107.107,79	Cenário Baixa - 10000:	10.504.864,55	CENARIO BRADESCO 1:	262.794.550,74	CENARIO BRADESCO 2:	-287.963.327,31		

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
XPIN11	2.659.952,50	129.533,39	88.392,90	0,10%	1.329.976,25	-1.329.976,25	389.949,04	-393.140,98
XPPR11	2.240.012,48	259.663,30	227.671,73	0,27%	1.120.006,24	-1.120.006,24	328.385,83	-331.073,85
YDUQ3	1.553.558,64	306.168,00	-188.044,56	-0,22%	605.887,87	-388.389,66	227.751,70	-229.615,97
Total Var:	3.178.949.990,71	110.907.129,54	85.213.216,58	99,94%	-58.107.107,78	10.504.864,55	262.794.550,73	-287.963.327,32

Relatório de Risco de Mercado



FUNDO: EMBRAERPREV RENDA FIXA
CNPJ: 10679245000140

Data: 31/10/2024

Dados Gerais									
PL:	4.277.108.115,71	VAR / PL:	1,3921%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	1.603,10		
VAR:	59.543.651,08	ETL / PL:	1,7458%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1.102,06		
ETL:	74.670.140,66	VAR / CDI:	0,0153%	Benchmark:					

Cenários de STRESS									
Cenário Alta - 09999 (+):	0,00	Cenário Baixa - 10000 (+):	150.071.142,24	CENARIO BRADESCO 1 (+):	190.671.035,76	CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00		
Cenário Alta - 09999 (-):	-194.285.805,22	Cenário Baixa - 10000 (-):	-1.926.153,39	CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-213.783.599,58		
Cenário Alta - 09999:	-194.285.805,22	Cenário Baixa - 10000:	148.144.988,86	CENARIO BRADESCO 1:	190.671.035,76	CENARIO BRADESCO 2:	-213.783.599,58		

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
CAIXA	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
FI RF EMB II	3.464.239.389,34	55.885.189,69	55.823.777,46	93,75%	-166.315.305,71	144.664.188,92	175.809.755,50	-195.527.369,21
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	118.428.457,88	632.761,66	219.358,34	0,37%	-4.439.254,49	-370.628,71	1.491.431,74	-1.964.253,17
FIM EMB II A	244.322.624,19	300.584,77	225.966,47	0,38%	-1.687.478,85	1.675.215,44	1.290.185,64	-1.671.895,75
FIM EMB VI A CRED PRIV	170.567.999,22	1.672.948,77	1.428.005,22	2,40%	-9.241.124,43	3.731.737,88	7.068.231,65	-8.309.788,17
FIM EMB VII A CRED PRIV	176.762.350,01	2.155.352,35	1.846.543,59	3,10%	-12.602.641,75	-1.555.524,68	5.011.431,23	-6.310.293,28
Total Var:	4.174.320.820,64	60.646.837,24	59.543.651,08	100,00%	-194.285.805,22	148.144.988,86	190.671.035,76	-213.783.599,58

Relatório de Risco de Mercado



FUNDO: EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL
CNPJ: 10679245000140

Data: 31/10/2024

Dados Gerais									
PL:	514.553.892,57	VAR / PL:	5,8032%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	1,54		
VAR:	29.860.474,80	ETL / PL:	7,2774%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1,37		
ETL:	37.446.240,08	VAR / CDI:	0,0637%	Benchmark:					

Cenários de STRESS									
Cenário Alta - 09999 (+):	117.398.085,46	Cenário Baixa - 10000 (+):	0,00	CENARIO BRADESCO 1 (+):	65.134.756,63	CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00		
Cenário Alta - 09999 (-):	0,00	Cenário Baixa - 10000 (-):	-111.594.075,68	CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-65.670.744,23		
Cenário Alta - 09999:	117.398.085,46	Cenário Baixa - 10000:	-111.594.075,68	CENARIO BRADESCO 1:	65.134.756,63	CENARIO BRADESCO 2:	-65.670.744,23		

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
CAIXA	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
FIA EMB VIII ETF	89.152.949,89	4.998.091,92	4.947.990,16	16,57%	8.000.932,93	-8.000.932,86	6.516.330,93	-6.569.677,12
FIA RVA EMB II	95.978.235,76	5.474.825,88	5.443.408,24	18,23%	24.124.261,38	-24.005.911,44	13.783.140,63	-13.895.997,38
FIA RVA EMB III	109.403.036,06	5.998.636,74	5.700.114,42	19,09%	27.589.899,63	-25.095.829,63	13.674.146,29	-13.789.707,68
FIA RVA EMB IV	100.798.327,01	7.230.351,28	7.149.770,17	23,94%	27.633.349,43	-24.181.468,80	13.930.352,71	-14.044.669,93
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	119.217.423,22	6.697.357,26	6.619.191,81	22,17%	30.049.642,10	-30.309.932,95	17.230.786,07	-17.370.692,12
Total Var:	514.549.971,94	30.399.263,08	29.860.474,80	100,00%	117.398.085,46	-111.594.075,68	65.134.756,63	-65.670.744,23

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – OUTUBRO 2024

Relatório de Risco de Mercado



Data: 31/10/2024

FUNDO: FI RF EMB II
CNPJ: 11005764000196

Dados Gerais			
PL:	3.493.124.863,79	VAR / PL:	1,5999%
VAR:	55.885.751,22	ETL / PL:	2,0063%
ETL:	70.082.986,66	VAR / CDI:	0,0176%
Limite Fundo:	0,00%	Status:	ENQUADRADO
Dutacion DC:	1.748,43	Benchmark:	
Dutacion DU:	1.202,10		

Cenários de STRESS			
Cenário Alta - 09999 (+):	0,00	Cenário Baixa - 10000 (+):	145.493.940,75
Cenário Alta - 09999 (-):	-166.316.976,83	Cenário Baixa - 10000 (-):	-828.298,26
Cenário Alta - 09999:	-166.316.976,83	Cenário Baixa - 10000:	144.665.642,49

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

Produto	M/M	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
CSMGC3	5.616.116,49	15.782,02	9.804,32	0,02%	0,00	0,00	0,00	0,00
ELET42	14.921.533,18	156.457,13	50.305,90	0,09%	0,00	0,00	0,00	0,00
ENTV12	14.111.439,35	157.597,29	95.727,33	0,17%	0,00	0,00	0,00	0,00
GASP17	51.399.386,68	582.743,35	74.641,66	0,13%	-45.333,10	46.236,27	162.953,86	-248.028,03
IGSN15	2.582.224,31	44.365,54	36.657,92	0,07%	0,00	0,00	0,00	0,00
NEOE16	7.530.079,30	81.338,97	33.670,15	0,06%	-73.594,77	-2.248,35	15.029,32	-20.290,09
NTNB20260815 - 760199_VENCIMENTO	43.349.789,14	127.672,20	28.848,54	0,05%	0,00	0,00	0,00	0,00
NTNB20300815 - 760199_VENCIMENTO	26.080.136,57	387.015,08	368.637,69	0,66%	-1.290.548,96	-346.287,89	355.680,29	-468.051,97
NTNB20350815 - 760199_VENCIMENTO	233.574.959,75	6.044.826,73	6.003.773,54	10,74%	-1.233.054,65	-242.845,55	403.596,45	-525.567,73
NTNB20400815 - 760199_VENCIMENTO	28.308.417,87	957.216,50	953.904,01	1,71%	-1.122.783,88	1.238.228,68	1.041.505,33	-1.375.274,86
NTNB20450815 - 760199_VENCIMENTO	216.450.647,76	8.173.320,56	8.114.286,03	14,52%	-264.137,88	-39.706,80	98.482,59	-126.808,23
NTNB20500815 - 760199_VENCIMENTO	673.218.343,53	27.024.391,98	26.986.879,73	48,29%	-690.418,46	-190.309,37	188.107,76	-248.671,87
NTNB20550815 - 760199_VENCIMENTO	214.390.684,80	8.724.958,21	8.706.223,12	15,58%	-897.199,82	875.111,17	748.848,86	-995.182,39
SBSPC2	5.121.010,75	10.133,11	1.770,51	0,00%	-1.364.361,22	1.182.530,94	1.298.132,46	-1.653.312,52
BBTOPIMA	82.370.729,54	339.519,62	65.172,04	0,12%	-18.377.422,41	15.721.904,26	18.405.860,03	-22.415.168,03
BBTOPIND	259.558.711,67	4.452.418,67	4.353.409,33	7,79%	-2.958.230,73	2.451.119,38	2.975.694,78	-3.474.221,07
CAIXA	5.000,00	0,00	0,00	0,00%	-24.221.498,11	22.436.279,36	26.288.465,69	-29.597.749,01
COMPROMISSADA_PRE	1.585.801.792,42	11.745,94	2.039,39	0,00%	-85.323.509,86	76.461.127,65	92.697.591,13	-101.197.699,82
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-114.805,55	0,00	0,00	0,00%	-28.403.407,43	25.081.403,04	31.122.985,25	-33.174.381,12
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-51.475,54	-6.900,30	6.588,21	-8.927,11
Total Var:	3.464.274.197,55	57.291.502,88	55.885.751,22	100,00%	-166.316.976,82	144.665.642,49	175.811.522,01	-195.529.333,84

Relatório de Risco de Mercado



Data: 31/10/2024

FUNDO: FI RF EMB V CREDITO PRIVADO
CNPJ: 20726178000121

Dados Gerais			
PL:	116.959.411,40	VAR / PL:	0,5410%
VAR:	632.761,66	ETL / PL:	0,6784%
ETL:	793.508,64	VAR / CDI:	0,0059%
Limite Fundo:	0,00%	Status:	ENQUADRADO
Dutacion DC:	591,55	Benchmark:	
Dutacion DU:	405,53		

Cenários de STRESS			
Cenário Alta - 09999 (+):	0,00	Cenário Baixa - 10000 (+):	359.783,29
Cenário Alta - 09999 (-):	-4.439.254,49	Cenário Baixa - 10000 (-):	-730.412,00
Cenário Alta - 09999:	-4.439.254,49	Cenário Baixa - 10000:	-370.628,71

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

Produto	M/M	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
17H0164854	6.234.526,56	64.356,86	50.180,06	7,93%	-223.250,20	-9.874,79	73.247,29	-97.557,93
AEGP23	7.555.320,89	37.261,10	12.697,77	2,01%	-130.316,12	19.690,36	37.023,18	-49.953,75
CCRD01	3.327.132,48	5.509,03	392,33	0,06%	0,00	0,00	0,00	0,00
CMDT33	739.556,64	1.463,38	543,44	0,09%	-10.478,83	-6.104,53	-393,73	534,41
ENJG21	1.439.088,49	14.535,86	10.758,04	1,70%	-7.433,90	-996,52	951,44	-1.289,22
ENM12	938.268,75	9.757,44	7.219,39	1,14%	-158,74	161,91	570,61	-868,52
ENTV12	18.550.662,97	207.174,77	187.865,07	29,69%	0,00	0,00	0,00	0,00
ERDV17_VENCIMENTO	6.614.890,00	30.370,80	12.125,26	1,92%	0,00	0,00	0,00	0,00
ERDV36	2.282.078,12	3.778,64	269,51	0,04%	-46.572,59	-2.612,29	14.703,32	-19.602,47
GASP17	10.634.355,86	120.567,59	56.162,55	8,88%	-31.110,46	-1.692,52	9.871,35	-13.159,75
GRRB24_VENCIMENTO	16.321.544,98	176.280,90	163.019,98	25,76%	-1.620.953,10	-319.240,71	530.561,17	-690.902,57
LFSN16000GM	15.995.799,34	28.059,09	6.938,68	1,10%	-107.851,35	9.592,06	26.148,59	-35.320,47
LFSN18000DC5	5.170.657,27	27.031,84	8.177,85	1,29%	-7.187,42	-4.187,10	-270,06	366,55
OMGE31	13.165.233,18	157.662,09	113.502,45	17,94%	-232.300,11	256.185,25	215.483,86	-284.539,63
SBSPC2	3.924.540,81	7.765,62	2.883,82	0,46%	-1.453.606,12	-370.702,03	413.271,50	-543.413,35
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	-120.811,24	-9.713,40	18.011,08	-24.409,81
COMPROMISSADA_PRE	5.552.983,22	41,13	24,87	0,00%	-80.290,92	29.689,30	30.375,61	-40.937,54
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-19.181,73	0,00	0,00	0,00%	-327.484,58	44.464,42	116.827,58	-156.357,74
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-39.448,82	-5.288,12	5.948,95	-6.841,39
Total Var:	118.428.457,86	891.616,14	632.761,66	100,01%	-4.439.254,49	-370.628,71	1.491.431,74	-1.964.253,17

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – OUTUBRO 2024



Data: 31/10/2024

Relatório de Risco de Mercado

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

Dados Gerais				
PL:	207.869.923,31	VAR / PL:	1,0511%	Limite Fundo:
VAR:	2.185.017,17	ETL / PL:	1,3182%	Status:
ETL:	2.740.099,68	VAR / CDI:	0,0115%	Benchmark:
				ENQUADRADO
				0,00% Dutation DC:
				Dutation DU:
				1.128,51
				775,05

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	724.013,01	Cenário Baixa - 10000 (+):	6.294.904,55	CENARIO BRADESCO 1 (+):	10.058.432,34	CENARIO BRADESCO 2 (+):	58.756.019,05
Cenário Alta - 09999 (-):	-12.793.728,42	Cenário Baixa - 10000 (-):	-1.420.929,04	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-826.704,64	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-69.609.327,98
Cenário Alta - 09999:	-12.069.715,41	Cenário Baixa - 10000:	4.873.975,52	CENARIO BRADESCO 1:	9.231.727,70	CENARIO BRADESCO 2:	-10.853.308,93

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
020913	539.392,83	43.439,49	3.031,46	0,14%	0,00	0,00	0,00	0,00
AEGPA1	1.866.208,29	1.032,40	991,09	0,05%	-4.347,19	3.577,19	6.585,60	-9.098,44
APRB28	1.042.884,75	34,46	32,88	0,00%	-184,72	149,28	291,77	-421,58
ARTRA1	2.559.567,79	112,88	107,47	0,00%	-637,01	516,84	1.016,02	-1.475,25
BARU11	1.538.439,71	61.918,48	57.568,85	2,63%	-273.736,48	-19.924,98	130.268,39	-157.433,91
BCPF15	2.072.684,85	11,31	9,38	0,00%	-97,88	84,68	180,28	-269,60
BRKPA0	2.785.654,16	490,50	467,75	0,02%	-2.560,22	2.061,71	3.951,61	-5.687,93
CAEC11	1.885.365,66	20,89	19,08	0,00%	-155,57	131,75	279,39	-415,27
CAIXA	10.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CART13	972.605,36	18.360,10	17.798,23	0,81%	-105.563,69	-14.821,23	40.880,01	-51.899,39
CBAN22	5.823.680,93	39.679,04	37.462,28	1,71%	-125.926,76	105.081,53	180.036,98	-236.738,73
CEAB13	1.534.857,79	263,71	252,24	0,01%	-1.288,08	1.039,75	1.986,33	-2.842,64
CELG12	463.158,78	6,30	5,74	0,00%	-47,62	40,59	87,32	-129,99
CGBP13	2.362.176,78	803,74	771,80	0,04%	-3.444,10	2.832,63	5.219,57	-7.226,28
CLH12	2.419.887,08	3.138,88	3.009,68	0,14%	-12.479,13	10.507,05	18.975,27	-25.223,73
COMPROMISSADA_PRE	6.435.906,43	47,67	26,40	0,00%	-183,98	187,65	661,33	-1.006,60
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-83.675,31	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CRTR12	2.878.386,45	93.934,77	88.864,98	4,06%	-429.793,82	-28.662,38	201.318,72	-245.380,12
CSAN23	1.114.478,54	1.091,62	1.046,11	0,05%	-4.276,47	3.607,41	6.501,13	-8.610,98
CSMG88	2.775.677,99	30.037,52	24.521,21	1,12%	-234.633,04	-48.676,97	73.697,39	-96.405,07
DAPK25	6.155,99	33.796,59	5.142,74	0,24%	-131.848,76	116.251,50	74.173,35	-74.242,63
DAPK27	-42.648,51	217.723,40	199.895,58	9,15%	-1.179.258,23	1.021.780,12	1.151.407,31	-1.125.969,78
DAPK29	-2.934,55	119.820,60	114.132,49	5,22%	-454.826,61	396.207,64	488.057,58	-466.312,20
DAPK35	-1.139,37	40.465,54	-33.567,88	-1,54%	109.897,62	-99.086,05	-132.235,15	118.045,92
DAPQ26	-13.655,71	119.641,59	71.050,73	3,25%	-781.113,59	691.570,30	712.377,68	-702.553,48
DAPQ28	-84.752,72	426.976,91	413.599,91	18,93%	-1.785.768,37	1.559.323,88	1.854.454,68	-1.786.419,09
DAPQ30	-469,41	85.865,81	-78.501,21	-3,59%	285.452,11	-247.451,85	-315.914,81	297.606,31
DAPQ32	-410,99	112.293,57	-97.514,64	-4,46%	328.127,51	-288.263,67	-376.712,85	346.683,48
DASAA2	1.351.290,77	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DASAC5	1.923.782,52	2.685,64	2.568,14	0,12%	-10.348,99	8.839,76	15.813,81	-20.466,00
DESK13	2.767.063,80	590,33	566,56	0,03%	-2.696,01	2.199,13	4.117,31	-5.793,12
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DHFZ27	-8.515,83	97.260,96	92.980,62	4,26%	-412.359,71	310.373,84	587.044,85	-821.355,33
DHFZ28	-26.778,80	267.024,41	224.552,34	11,65%	-1.005.914,33	798.418,89	1.455.955,74	-1.956.971,43
DHIF29	-1.300,91	15.089,98	14.387,94	0,66%	-56.374,42	46.010,32	83.135,46	-107.659,78
DHIN26	-2.178,06	24.979,25	23.784,72	1,09%	-121.335,28	91.022,23	176.709,39	-252.166,46
ELET24	2.663.812,67	712,55	683,40	0,03%	-3.136,02	2.556,70	4.757,47	-6.672,66
GUAR15	1.035.289,39	81,13	77,27	0,00%	-451,43	364,58	707,56	-1.023,49
HAPV22	561.622,38	231,36	221,94	0,01%	-971,81	798,22	1.463,75	-2.023,25
HZTC14	2.458.467,18	45.016,64	43.592,57	2,00%	-255.008,53	-31.995,63	100.849,14	-127.833,07
IDIF25P421800	-9,98	32,46	-22,22	0,00%	9,98	-28.328,55	9,98	-57.893.431,45
IDIF25P421900	9,98	36,45	24,95	0,00%	-9,98	47.373,41	-9,98	57.990.893,50
INSSSN1	105.370,52	70.545,62	38.605,31	1,77%	0,00	0,00	0,00	0,00
IRJS14	3.235.308,17	116.703,31	109.792,52	5,02%	-530.662,36	-33.432,07	254.871,08	-307.416,75
JSMILB5	3.229.916,61	55.379,85	54.059,16	2,47%	-356.339,01	-65.612,89	126.000,84	-162.308,31
LCAMD1	7.407.379,30	131.737,88	128.342,32	5,87%	-835.756,52	-154.100,17	296.638,57	-381.893,01
LF001800FAU	4.178.064,75	57.396,78	45.905,82	2,10%	-436.170,15	-100.228,43	131.207,55	-172.395,41
LF002306ZBP	5.691.425,41	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306ZK1	5.709.473,72	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFSC190054B	989.305,29	0,00	0,00	0,00%	139,68	-138,25	-468,41	713,36
LFSC190059S	1.498.365,91	0,00	0,00	0,00%	211,55	-209,39	-709,44	1.080,43
LFSC19005L1	991.253,55	0,00	0,00	0,00%	174,56	-174,45	-552,52	856,78
LFSC22002IK	4.532.686,21	1.054,31	1.005,91	0,05%	-5.277,09	4.226,21	7.992,37	-11.448,53
LFSN210029N	4.837.466,76	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFSN2301ERT	4.700.315,87	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20250901 - 210100	21.654.332,67	4.916,19	1.931,88	0,09%	-48.585,28	59.072,03	-91,48	139,27
LIGHB4	4.295.398,81	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LIGHD3	1.033.813,56	276,00	264,58	0,01%	-1.183,19	962,15	1.770,01	-2.468,35
LMP17	2.722.514,00	116,33	108,03	0,00%	-825,43	670,40	1.361,91	-2.006,77
LRENB1	684.148,92	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
MAINT12	2.378.073,02	1.757,99	1.687,61	0,08%	-7.172,17	5.979,61	10.874,14	-14.704,74
MOVIZ7	1.146.652,92	756,27	725,99	0,03%	-3.179,48	2.617,31	4.813,26	-6.644,31
MTRJ19	2.722.962,05	30.816,56	28.716,39	1,31%	-227.337,51	-42.243,27	75.932,07	-98.552,73
NTEN11	3.177.804,22	28.112,71	21.170,36	0,97%	-212.256,57	-41.249,63	65.662,68	-86.117,35
NTNB20250515 - 760199 NEGOCIACAO	627.965,69	979,31	-415,07	-0,29%	-4.986,01	4.527,20	2.441,94	-3.298,33
NTNB20260815 - 760199 NEGOCIACAO	21.471.150,56	63.236,04	39.038,57	1,79%	-444.383,07	433.442,56	370.904,84	-492.913,84
NTNB20270515 - 760199 NEGOCIACAO	5.102.078,13	25.153,69	23.123,66	1,06%	-135.046,55	126.526,22	119.384,97	-157.367,64
NTNB20280815 - 760199 NEGOCIACAO	8.136.911,34	70.600,10	68.573,85	3,14%	-297.123,20	287.681,12	283.316,76	-388.178,78
NTNB20500815 - 760199 NEGOCIACAO	846.523,25	34.061,50	27.744,07	1,27%	-107.541,61	96.374,47	116.835,89	-127.549,41
NTSD36	2.861.004,69	4.262,41	4.064,60	0,19%	-16.248,18	14.099,57	25.173,71	-31.638,89
OMGE13	3.112.266,74	1.068,96	1.026,06	0,05%	-4.685,26	3.762,93	6.957,55	-8.666,28
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
OVSAT10	1.824.519,46	49,77	46,83	0,00%	-328,71	269,14	561,84	-828,17
OVSAA8	693.457,86	458,94	440,25	0,02%	-1.909,58	1.570,04	2.882,62	-3.975,56
RAHD11	3.163.200,86	82.147,44	78.709,50	3,60%	-404.070,95	-30.590,69	181.449,21	-223.580,51
RBCAPMZ	484.206,15	3.092,67	985,26	0,05%	0,00	0,00	0,00	0,00
RDCO10	3.821.514,88	171,89	163,13	0,01%	-1.028,35	835,20	1.674,14	-2.443,38
RDORB9	1.105.390,69	1.038,04	994,56	0,05%	-4.065,01	3.429,74	6.180,17	-8.183,64
RDORC9	1.580.708,68	1.484,39	1.422,23	0,07%	-5.812,96	4.904,53	8.837,64	-11.702,60
RIS412	2.741.737,34	57.452,08	55.498,26	2,54%	-326.868,23	-55.087,07	122.235,25	-155.700,11
RODB11	2.914.328,34	3.827,53	3.672,15	0,17%	-15.369,18	12.825,72	23.239,70	-31.328,49
RSAN24	1.832.789,90	21,98	20,15	0,00%	-165,77	139,74	294,66	-437,67
SNGO18	907.626,09	7,79	6,96	0,00%	-57,99	50,26	110,78	-165,33

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – OUTUBRO 2024

Relatório de Risco de Mercado



Data: 31/10/2024

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

Dados Gerais		Limite Fundo:		ENQUADRADO		0,00% Dutation DC:		1.128,51	
PL:	207.869.923,31	VAR / PL:	1,0511%	Status:		Dutation DC:			
VAR:	2.185.017,17	ETL / PL:	1,3182%	Benchmark:		Dutation DU:			775,05
ETL:	2.740.099,68	VAR / CDI:	0,0115%						

Cenários de STRESS										
Cenário Alta - 09999 (+):	724.013,01	Cenário Baixa - 10000 (+):	6.294.904,55	CENARIO BRADESCO 1 (+):	10.058.432,34	CENARIO BRADESCO 2 (+):	58.756.019,05			
Cenário Alta - 09999 (-):	-12.793.728,42	Cenário Baixa - 10000 (-):	-1.420.929,04	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-826.704,64	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-69.609.327,98			
Cenário Alta - 09999:	-12.069.715,41	Cenário Baixa - 10000:	4.873.975,52	CENARIO BRADESCO 1:	9.231.727,70	CENARIO BRADESCO 2:	-10.853.308,93			

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
TBSP11	2.297.110,59	398,15	381,78	0,02%	-1.893,34	1.540,43	2.915,40	-4.138,99
UNEG11	4.512.559,84	145.010,43	136.822,53	6,26%	-636.418,36	-26.881,61	304.562,57	-373.403,36
VAMO33	2.830.403,77	46.168,51	45.141,75	2,07%	-312.468,22	-63.769,82	106.418,16	-137.315,72
VCCS11	436.085,97	132,84	127,42	0,01%	-538,13	445,73	812,02	-1.107,88
VECS11	3.554.986,54	11,58	9,18	0,00%	-58,94	56,78	143,78	-216,58
VERDECS2	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
VIXL18	2.380.279,05	1.538,20	1.475,79	0,07%	-6.235,91	5.174,88	9.426,82	-12.808,86
VVRT11	2.495.012,69	193,68	185,40	0,01%	-1.003,34	815,02	1.575,27	-2.262,20
Total Var:	222.776.700,26	2.946.886,75	2.185.017,17	100,03%	-12.069.715,40	4.873.975,52	9.231.727,70	-10.853.308,93

Relatório de Risco de Mercado



Data: 31/10/2024

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

Dados Gerais		Limite Fundo:		ENQUADRADO		0,00% Dutation DC:		1.238,33	
PL:	229.082.302,92	VAR / PL:	1,3250%	Status:		Dutation DC:			
VAR:	3.035.442,23	ETL / PL:	1,6617%	Benchmark:		Dutation DU:			850,78
ETL:	3.806.567,01	VAR / CDI:	0,0145%						

Cenários de STRESS										
Cenário Alta - 09999 (+):	0,00	Cenário Baixa - 10000 (+):	63.011,68	CENARIO BRADESCO 1 (+):	7.057.736,96	CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00			
Cenário Alta - 09999 (-):	-17.748.648,33	Cenário Baixa - 10000 (-):	-2.253.700,03	CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-8.886.960,26			
Cenário Alta - 09999:	-17.748.648,33	Cenário Baixa - 10000:	-2.190.688,35	CENARIO BRADESCO 1:	7.057.736,96	CENARIO BRADESCO 2:	-8.886.960,26			

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
APPSA2	2.881.290,03	45.045,64	44.842,11	1,48%	-309.484,73	-60.281,23	106.250,38	-137.270,19
ASAB11	2.649.719,11	39.005,05	38.857,63	1,28%	-258.153,73	-52.938,27	87.340,63	-112.261,53
ASER12	2.747.495,50	102.145,70	98.838,86	3,26%	-456.583,68	-26.305,02	222.208,39	-267.034,98
BARU11	1.784.590,06	71.825,43	68.850,27	2,27%	-317.534,32	-23.112,98	151.111,33	-182.623,34
BRKP28	5.437.421,78	150.746,36	148.032,29	4,88%	-756.510,67	-121.351,36	296.473,36	-374.172,17
CAEC21	4.811.014,08	55.349,27	28.519,87	0,94%	-360.479,78	-76.506,37	107.153,57	-141.323,36
CAKA	999,92	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CART13	5.481.957,50	103.484,21	103.397,60	3,41%	-594.995,36	-83.537,82	230.414,61	-292.523,85
CGOS16	3.337.558,33	107.292,56	104.886,97	3,46%	-447.099,25	-8.929,26	217.676,10	-269.413,06
CJEN13	4.185.536,87	78.020,28	77.968,53	2,57%	-439.553,43	-54.352,03	174.618,92	-221.085,61
CNRD11	7.072.347,05	159.465,65	158.906,25	5,24%	-825.329,45	-87.116,10	344.267,99	-433.196,09
COMPROMISSADA_PRE	76.011.103,35	563,16	296,01	0,01%	-2.173,49	2.216,79	7.812,81	-11.891,68
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-143.786,28	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CRMG15	3.225.726,00	33.380,81	29.909,16	0,99%	-244.554,98	-37.644,98	84.339,50	-109.689,52
CSMG99	3.275.340,32	60.963,04	60.788,81	2,00%	-368.221,15	-63.174,51	134.802,26	-172.235,94
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ENEVA0	216.911,57	6.133,29	6.026,40	0,20%	-29.516,38	-3.756,00	12.181,67	-15.323,56
ERDV17	4.803.880,12	22.055,95	15.479,30	0,51%	-78.324,05	-6.965,96	18.989,69	-25.650,51
ERDV38	6.001.103,73	53.834,37	8.179,34	0,27%	-131.200,91	15.251,05	43.299,69	-58.015,46
GBSP11	3.592.636,11	124.403,78	120.564,18	3,97%	-576.116,31	-40.515,17	275.931,51	-330.935,04
GRRB24	8.612.671,94	93.021,19	75.173,36	2,48%	-767.049,48	-195.614,75	218.078,12	-286.752,32
HVRD15	3.627.668,37	77.886,67	77.783,84	2,56%	-438.128,40	-59.234,41	173.905,61	-220.039,71
IPIL11	1.929.631,30	29.672,82	29.576,12	0,97%	-179.666,66	-24.185,17	68.608,87	-87.319,49
IRBR12	11.634.017,28	164.214,58	4.708,81	0,16%	-415.644,32	15.295,76	147.276,87	-196.553,07
JALL15	649.092,37	18.083,37	17.766,28	0,59%	-86.423,85	-10.638,12	35.913,82	-45.140,01
LCAM01	10.342.045,08	183.929,98	182.758,13	6,02%	-1.166.867,70	-215.151,79	414.161,25	-533.191,91
LORTA7	6.335.844,11	116.832,48	115.656,68	3,81%	-698.893,39	-102.169,14	264.231,43	-339.955,39
MOVI37	8.560.817,48	147.955,37	147.235,91	4,85%	-949.087,58	-174.808,80	335.873,88	-432.601,29
MTRJ19	3.685.169,36	41.706,14	39.654,80	1,31%	-307.671,28	-57.170,68	102.764,03	-133.378,09
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PASN12	916.698,26	8.128,90	6.163,45	0,20%	-60.522,72	-11.025,33	18.975,89	-24.883,60
QUAT12	3.458.509,09	13.303,63	6.818,11	0,22%	-72.762,39	23.282,11	29.516,76	-39.635,49
RAHD11	8.230.488,31	213.743,47	211.561,35	6,97%	-1.051.372,14	-79.595,41	472.121,65	-581.745,15
RDVE11	5.011.673,40	103.126,90	102.937,76	3,39%	-545.964,29	-50.504,89	230.548,17	-288.747,41
RMSA12	7.958.527,92	280.778,43	272.678,98	8,98%	-1.266.408,31	-78.380,46	605.218,84	-732.454,48
TCH11	6.704.091,50	179.262,46	176.768,11	5,82%	-881.275,39	-68.192,38	399.875,42	-489.212,15
UNEG11	3.041.702,15	97.744,64	95.490,30	3,15%	-428.979,37	-18.119,61	205.291,16	-251.693,46
VAMO33	1.286.665,80	20.987,62	20.890,91	0,69%	-142.044,11	-28.988,95	48.376,35	-62.421,99
VAMO34	7.056.673,24	125.237,74	124.556,81	4,10%	-793.653,63	-146.499,05	281.510,55	-362.385,05
VERO12	3.461.693,46	36.893,31	30.244,65	1,00%	-291.910,68	-63.078,74	89.805,58	-117.619,53
VIMT13	3.722.751,52	84.675,93	83.989,17	2,77%	-432.740,21	-45.008,34	181.585,87	-227.854,49
VRDN12	5.320.000,85	98.775,26	98.683,11	3,25%	-574.750,76	-85.812,89	219.224,70	-278.730,30
Total Var:	248.939.297,94	3.349.675,42	3.035.442,23	100,03%	-17.748.648,33	-2.190.688,35	7.057.736,96	-8.886.960,26

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – OUTUBRO 2024



Data: 31/10/2024

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO:	FIM EMB I A		
CNPJ:	20725946000122		

Dados Gerais			
PL:	181.872.055,70	VAR / PL:	0,2363%
VAR:	429.798,97	ETL / PL:	0,2964%
ETL:	538.985,25	VAR / CDI:	0,0026%
Limite Fundo:		Status:	ENQUADRADO
0,00% Dutation DC:		0,00% Dutation DU:	
		Benchmark:	
			406,11
			278,90

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	6.192.035,69	Cenário Baixa - 10000 (+):	12.972.282,59	CENARIO BRADESCO 1 (+):	65.521.002,48
Cenário Alta - 09999 (-):	-7.928.249,84	Cenário Baixa - 10000 (-):	-11.315.974,61	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-64.362.965,09
Cenário Alta - 09999:	-1.736.214,15	Cenário Baixa - 10000:	1.656.307,98	CENARIO BRADESCO 1:	1.158.037,38
				CENARIO BRADESCO 2 (+):	553.029.790,28
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	-554.951.636,49
				CENARIO BRADESCO 2:	-1.921.846,21

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
ANIB10	364.723,11	6,66	5,36	0,00%	-44,31	36,08	72,01	-105,62
BCBF14	86.427,13	0,78	0,71	0,00%	-5,61	5,12	11,62	-17,44
CAIXA	9.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CBAN22	3.886.324,79	26.479,06	22.797,41	5,30%	-84.034,87	70.124,20	120.144,32	-157.983,17
CEBEA3	1.846.745,35	95,61	75,55	0,02%	-583,90	470,46	924,46	-1.347,71
CGBP13	1.861.772,71	633,48	531,75	0,12%	-2.714,50	2.232,56	4.113,86	-5.695,46
COMPROMISSADA_PRE	86.059.795,10	637,44	2,99	0,00%	-2.460,18	2.509,19	8.843,34	-13.460,22
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-36.661,08	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPMX24C100500	4.958,15	1.273,23	-854,81	-0,20%	-1,12	0,31	2,52	-3,83
CPMX24C100750	29,94	20,41	-4,71	0,00%	-0,01	0,00	0,02	-0,02
CPMZ24C100750	55,34	18,59	-10,83	0,00%	-0,08	0,03	0,17	-0,25
CPTI2	1.819.114,37	860,74	725,31	0,17%	-3.477,32	2.909,14	5.293,75	-7.118,09
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DHF25	5,47	1.554,96	1.258,81	0,29%	-6.480,35	3.630,49	14.900,79	-22.556,07
DHF26	-6.368,45	75.058,07	56.653,71	13,18%	-471.380,02	338.896,30	887.994,65	-1.001.104,24
DHF27	-6.115,77	69.851,06	57.486,54	13,38%	-296.149,25	222.904,85	421.604,94	-589.882,46
DHF31	2.501,32	26.109,44	-21.843,93	-5,08%	97.427,41	-82.839,79	-148.397,63	179.290,19
DHJ25	-58,26	3.595,41	3.599,13	0,84%	-30.720,49	23.477,37	56.860,43	-85.299,76
DHN25	86,10	2.928,87	-2.245,80	-0,52%	25.177,71	-19.174,33	-41.314,63	61.389,59
DHN26	16.308,87	187.039,77	-147.847,74	-34,40%	908.534,90	-681.556,73	-1.323.165,45	1.888.173,27
DHX24	8,33	185,10	0,87	0,00%	-714,39	728,62	2.567,92	-3.908,57
ELET13	1.994.629,32	54,08	43,17	0,01%	-403,06	329,92	668,69	-987,88
GRRB14	1.074.278,72	11,74	9,72	0,00%	-75,20	61,95	128,44	-189,11
IDIF25P419600	26,12	26,40	24,58	0,01%	-25,56	621,60	-26,12	145.908.734,91
IDIF25P419700	-26,12	27,21	-25,34	-0,01%	25,63	-681,68	26,12	-146.163.830,42
IDIF25P422300	746,55	2.129,99	1.983,49	0,46%	-746,55	126.044,76	-746,55	23.105.862,60
IDIF25P422400	-4.447,70	11.708,35	-10.903,07	-2,54%	4.447,70	-325.716,01	4.447,70	-46.285.918,92
IDIF25P422500	28.977,20	25.448,85	23.698,53	5,51%	-28.693,78	177.092,21	-28.977,20	23.154.780,18
IDU25P432500	880,78	1.212,19	1.082,46	0,25%	-880,78	369.939,30	-880,78	49.181.973,14
IDU25P432600	-2.717,30	3.592,13	-3.207,70	-0,75%	2.717,30	-851.351,07	2.717,30	-98.538.778,64
IDU25P432700	2.061,40	2.614,40	2.334,60	0,54%	-2.061,40	485.424,54	-2.061,40	49.356.590,76
IDN25CA47900	448.125,66	292.114,25	-224.052,14	-52,13%	4.906.658,90	-448.024,09	62.142.993,53	-448.125,66
IDN25CA48000	-422.983,65	273.970,53	210.135,67	48,89%	-4.822.642,51	422.856,14	-62.056.534,67	422.983,65
IDN25P442900	3.088,66	3.020,20	2.316,50	0,54%	-3.088,62	370.632,63	-3.088,66	35.046.622,07
IDN25P443000	-3.641,04	3.504,95	-2.688,30	-0,63%	3.640,98	-399.080,34	3.641,04	-35.116.130,56
IDN25P443100	-4.279,00	4.054,72	-3.109,98	-0,72%	4.278,92	-428.892,24	4.279,00	-35.185.553,48
IDN25P443200	4.854,72	4.559,28	3.496,98	0,81%	-4.854,62	457.944,00	-4.854,72	35.255.038,63
IDN25P445400	36.194,12	32.519,98	24.942,88	5,80%	-36.193,90	1.455.319,21	-36.194,12	37.616.480,91
IDN25P445500	-40.508,44	36.003,87	-27.615,04	-6,43%	40.508,19	-1.516.607,79	40.508,44	-37.683.848,41
IDN25P445600	67.389,36	59.414,31	45.570,88	10,60%	-67.388,96	2.367.758,12	-67.389,36	56.626.668,64
IDN25P445700	-198.619,20	173.839,62	-133.335,29	-31,02%	198.618,05	-6.562.050,54	198.619,20	-151.224.690,25
IDN25P445800	137.767,70	119.488,44	91.647,84	21,32%	-137.766,92	4.259.974,08	-137.767,70	94.710.738,08
LCAMC3	2.928.390,06	402,63	324,08	0,08%	-2.101,54	1.692,34	3.243,64	-4.668,89
LF002100HDQ	3.070.302,57	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20250301 - 210100	1.554.492,19	214,19	19,71	0,00%	-1.145,54	1.290,31	-1,86	2,83
LFT20250901 - 210100	10.663.942,72	2.421,04	-36,65	-0,01%	-23.926,42	29.090,75	-45,05	68,59
LFT20260301 - 210100	13.181.892,52	2.418,26	-896,75	-0,21%	-50.357,07	68.081,57	35,77	-54,45
LFT20260901 - 210100	9.279.852,53	1.964,39	411,63	0,10%	-48.709,54	68.616,84	62,54	-125,66
LFT20270301 - 210100	6.615.660,83	1.426,78	674,10	0,16%	-36.937,23	73.799,95	2.206,88	-3.356,53
LFT20290301 - 210100	4.452.978,39	3.280,31	-205,55	-0,05%	-36.209,92	103.835,27	6.113,57	-9.291,62
LTM20260701 - 100000	25.116.122,13	189.252,82	150.298,23	34,97%	-906.601,26	683.438,57	1.323.534,76	-1.888.654,20
NTNB20500815 - 760199. NEGOCIACAO	3.329.443,59	313.650,83	120.770,39	28,10%	-421.972,78	378.143,31	458.441,76	-500.479,58
OMGE13	912.293,90	313,31	262,70	0,06%	-1.344,07	1.103,02	2.039,46	-2.833,46
OUTRAS DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
SBSPC7	2.419.998,65	491,97	404,45	0,09%	-2.395,63	1.936,02	3.691,23	-5.268,55
VAMO22	713.670,49	23,31	19,02	0,00%	-147,80	121,76	248,64	-365,29
WDOZ24	-11.861,95	215.193,21	185.072,64	43,06%	-392.812,82	399.209,71	-511.519,20	514.402,27
Total Var:	183.457.629,02	1.997.087,19	429.798,97	99,96%	-1.736.214,15	1.656.307,98	1.158.037,39	-1.921.846,20

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – OUTUBRO 2024

Relatório de Risco de Mercado



Data: 31/10/2024

FUNDO: EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA
CNPJ: 55699189000198

Dados Gerais			
PL:	63.064,689,42	VAR / PL:	0,1572%
VAR:	99.107,60	ETL / PL:	0,1971%
ETL:	124.284,93	VAR / CDI:	0,0017%
Limite Fundo:		Status:	ENQUADRADO
Benchmark:		Dutacion DC:	0,00%
		Dutacion DU:	
			455,49
			313,48

Cenários de STRESS			
Cenário Alta - 09999 (+):	581.935,68	Cenário Baixa - 10000 (+):	496.134,69
Cenário Alta - 09999 (-):	-736.291,70	Cenário Baixa - 10000 (-):	-800.313,95
Cenário Alta - 09999:	-154.356,02	Cenário Baixa - 10000:	-304.179,26
CENARIO BRADESCO 1 (+):	336.098,80	CENARIO BRADESCO 2 (+):	794.390,73
CENARIO BRADESCO 1 (-):	-606.566,27	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-382.114,68
CENARIO BRADESCO 1:	-270.467,47	CENARIO BRADESCO 2:	412.276,06

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	13.223.091,45	97,94	-53,09	-0,05%	-378,01	385,54	1.358,78	-2.068,16
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-8.187,89	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DAPQ28	3.291,37	16.581,63	14.844,67	14,98%	69.350,23	-60.556,27	-72.017,66	69.375,50
DAPQ32	-52,69	14.396,61	11.479,68	11,58%	42.067,63	-36.956,88	-48.296,52	44.446,60
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DHF26	1.702,17	20.061,60	18.569,12	18,74%	125.990,97	-90.580,58	-183.887,97	267.576,25
DHF27	2.322,45	26.525,72	24.419,41	24,64%	112.461,74	-84.847,41	-160.103,14	224.006,00
DHF28	1.811,13	18.059,62	16.391,69	16,54%	68.032,85	-53.999,35	-98.470,44	132.490,82
DHF29	390,27	4.526,99	4.073,22	4,11%	16.912,33	-13.803,10	-24.940,64	32.297,94
DHF30	136,76	1.669,32	1.493,93	1,51%	6.170,28	-5.154,51	-9.274,27	11.559,48
DHF31	-2.501,32	26.109,44	-23.192,30	-23,40%	-97.427,41	82.839,79	149.397,63	-179.290,19
DHN25	11,23	382,03	349,59	0,35%	3.284,05	-2.501,00	-5.388,87	8.007,34
DI224	0,40	68,74	-25,24	-0,03%	413,17	-76,36	-844,60	1.282,28
DOLF28	2.344,98	17.532,74	5.970,49	6,02%	53.132,26	-49.911,79	19.221,45	-9.526,48
DOLX24	1.552,40	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
EUPZ24	41,76	16.679,33	-10.748,04	-10,84%	-410.838,32	-317.176,22	-236,69	217,65
ITAGRADE	5.101.296,71	1.046,41	-260,06	-0,26%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20270901 - 210100	25.647.200,90	7.281,81	2.340,45	2,36%	-160.943,51	348.446,43	12.385,84	-18.845,58
NTNB20250515 - 760199_NEGOCIACAO	313.982,85	489,65	169,46	0,17%	-2.493,01	2.263,60	1.220,97	-1.649,17
NTNB20260815 - 760199_NEGOCIACAO	73.694,64	217,04	-132,87	-0,13%	-1.525,24	1.487,69	1.273,04	-1.691,81
NTNB20270515 - 760199_NEGOCIACAO	26.299,37	129,66	-114,38	-0,12%	-696,11	652,20	615,39	-811,17
NTNB20280815 - 760199_NEGOCIACAO	1.618.819,68	14.045,90	-12.620,52	-12,73%	-59.112,70	57.234,20	56.365,91	-73.249,22
NTNB20350515 - 760199_NEGOCIACAO	4.232,73	109,54	-83,48	-0,08%	-333,03	284,91	333,54	-406,20
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
SWIZZ4	-855,19	21.964,48	17.201,28	17,36%	50.779,53	-51.683,54	67.719,50	-68.251,62
T10Z24	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
UNI_PREV	17.067.594,07	11.081,74	5.767,73	5,82%	0,00	0,00	0,00	0,00
WINZ24	-1.399,60	10.315,88	-7.493,65	-7,56%	33.340,65	-33.266,96	26.206,76	-26.325,08
WSPZ24	-21.163,23	37.926,64	30.760,51	31,04%	-2.544,38	2.540,35	-3.105,46	3.130,88
Total Var:	63.056.638,39	267.300,46	99.107,60	100,02%	-154.356,02	-304.179,26	-270.467,47	412.276,06

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – OUTUBRO 2024

Relatório de Risco de Mercado



Data: 31/10/2024

FUNDO: FIM EMB III A IMOBILIÁRIO
CNPJ: 3271199000162

Dados Gerais							
PL:	66.846.103,56	VAR / PL:	3,5724%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	1,00
VAR:	2.387.999,06	ETL / PL:	4,4799%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1,00
ETL:	2.994.647,16	VAR / CDI:	0,0392%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	35.882.950,67	Cenário Baixa - 10000 (-):	59,63	CENARIO BRADESCO 1 (+):	8.733.035,18	CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00
Cenário Alta - 09999 (-):	-58,47	Cenário Baixa - 10000 (-):	-35.882.253,89	CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-8.804.627,78
Cenário Alta - 09999:	35.882.892,20	Cenário Baixa - 10000:	-35.882.194,25	CENARIO BRADESCO 1:	8.733.035,18	CENARIO BRADESCO 2:	-8.804.627,78

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
AIEC11	1.955.203,20	284.093,39	235.172,22	9,85%	977.601,60	-977.601,60	286.632,79	-288.979,03
BMLC11	3.497.140,00	155.468,95	114.347,77	4,79%	3.497.140,00	-3.497.140,00	512.680,72	-516.877,29
BPML11	5.013.021,42	540.484,27	442.079,97	18,51%	5.013.021,42	-5.013.021,42	734.908,94	-740.924,57
BRCR11	26.100,00	1.922,32	1.772,34	0,07%	6.786,00	-6.786,00	3.826,26	-3.857,58
CAIXA	1.682,27	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CBOP11	17.072,00	1.240,68	1.049,08	0,04%	8.536,00	-8.536,00	2.502,76	-2.523,24
CEOC11	560.700,92	41.669,18	36.254,13	1,52%	280.350,46	-280.350,46	82.198,76	-82.871,60
CNES11	231.381,80	23.496,33	17.761,25	0,74%	115.690,90	-115.690,90	33.920,57	-34.198,23
COMPROMISSADA_PRE	2.045.324,38	15,15	6,12	0,00%	-58,47	59,63	210,17	-319,90
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-215.194,81	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
EVBI11	4.357.370,00	209.473,15	177.752,61	7,44%	4.357.370,00	-4.357.370,00	638.790,44	-644.019,29
FIGS11	666.837,36	12.270,99	5.871,07	0,25%	333.417,36	-333.418,68	97.758,36	-98.558,56
FMOF11	703,84	79,61	27,81	0,00%	1.407,68	-703,84	103,18	-104,03
FVPQ11	621.881,05	47.283,17	32.409,68	1,36%	310.940,53	-310.940,53	91.167,76	-91.914,02
HOCF11	442.260,00	43.914,96	31.334,21	1,31%	0,00	0,00	64.835,32	-65.366,03
HSRE11	4.579.968,00	211.987,61	-2.533,62	-0,11%	4.579.968,00	-4.579.968,00	671.423,31	-676.919,27
JSRE11	96.456,83	2.980,71	1.090,84	0,05%	25.078,78	-25.078,78	14.140,57	-14.256,32
MALL11	5.571.509,72	248.360,01	168.910,13	7,07%	1.448.592,53	-1.448.592,53	816.783,33	-823.469,14
MAXR11	2.170.166,18	212.799,25	183.887,69	7,70%	1.085.083,09	-1.085.083,09	318.146,36	-320.750,56
NEWL11	5.955.291,24	405.016,83	283.924,01	11,89%	2.977.639,88	-2.977.645,62	873.045,70	-880.192,05
NEWU11	1.783.684,09	213.557,26	7.283,20	0,30%	1.783.684,09	-1.783.684,09	261.488,09	-263.628,51
OULG11	988.078,10	44.350,00	-33.619,94	-1,41%	494.039,05	-494.039,05	144.852,25	-146.037,94
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PATC11	4.024.104,00	196.004,40	184.893,11	7,74%	2.012.052,00	-2.012.052,00	589.933,65	-594.762,57
QAGR11	5.244.149,20	155.000,57	149.797,73	6,27%	2.622.074,60	-2.622.074,60	768.792,27	-775.085,25
RBRP11	1.871.428,00	142.737,30	114.186,65	4,78%	935.714,00	-935.714,00	274.351,35	-276.597,06
RCRB11	5.445.224,00	251.084,21	-136.237,78	-5,71%	0,00	0,00	0,00	0,00
SARE11	1.108.087,72	44.031,33	-20.285,31	-0,85%	554.043,86	-554.043,86	162.445,66	-163.775,37
VSHO11	25.472,72	1.728,71	1.432,89	0,06%	12.736,36	-12.736,36	3.734,30	-3.764,87
VVMR11	3.861.033,15	112.416,99	66.689,44	2,79%	0,00	0,00	566.027,46	-570.660,70
XPIN11	2.659.952,50	129.533,39	86.642,62	3,63%	1.329.976,25	-1.329.976,25	389.949,04	-393.140,98
XPPR11	2.240.012,48	299.663,30	236.099,11	9,89%	1.120.006,24	-1.120.006,24	328.385,83	-331.073,85
Total Var:	66.846.101,36	3.992.664,04	2.387.999,06	99,97%	35.882.892,20	-35.882.194,25	8.733.035,18	-8.804.627,79

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – OUTUBRO 2024

Relatório de Risco de Mercado



Data: 31/10/2024

FUNDO: FIA RVA EMB II CNPJ: 13294268000125

Dados Gerais		Limite Fundo:		ENQUADRADO		0,00% Dutation DC:		1,00	
PL:	95.978.236,44	VAR / PL:	5,7042%	Status:		Dutation DU:			
VAR:	5.474.825,88	ETL / PL:	7,1533%	Benchmark:					
ETL:	6.865.652,52	VAR / CDI:	0,0626%						

Cenários de STRESS				
Cenário Alta - 09999 (+):	24.124.279,95	Cenário Baixa - 10000 (+):	18,95	CENÁRIO BRADESCO 1 (+): 13.783.140,63 CENÁRIO BRADESCO 2 (+): 0,00
Cenário Alta - 09999 (-):	-18,58	Cenário Baixa - 10000 (-):	-24.005.930,38	CENÁRIO BRADESCO 1 (-): 0,00 CENÁRIO BRADESCO 2 (-): -13.895.997,38
Cenário Alta - 09999:	24.124.261,37	Cenário Baixa - 10000:	-24.005.911,43	CENÁRIO BRADESCO 1: 13.783.140,63 CENÁRIO BRADESCO 2: -13.895.997,38

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
ABEV3	2.038.895,20	165.788,30	129.599,92	2,37%	285.445,33	-611.684,69	298.902,04	-301.348,71
B3SA3	2.017.045,98	305.630,29	270.801,28	4,95%	504.261,50	-504.261,50	295.698,94	-298.119,40
BBAS3	2.864.704,00	253.790,69	237.179,54	4,33%	716.176,00	-716.176,00	419.965,61	-423.403,25
BBDC4	2.784.618,60	360.481,60	328.068,11	5,99%	696.154,65	-696.154,65	408.225,09	-411.566,63
BBSE3	562.028,00	55.607,65	53.834,51	0,98%	112.405,60	-112.405,60	82.393,31	-83.067,74
BPAC11	2.790.216,00	275.417,40	248.349,65	4,54%	837.064,80	-976.575,60	409.045,67	-412.393,93
BRFS3	742.309,00	92.057,57	66.600,33	1,22%	185.577,25	-185.577,25	108.822,50	-109.713,27
CAIXA	10.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CMG4	1.166.903,10	113.517,98	106.267,53	1,94%	291.725,78	-350.070,93	171.067,99	-172.468,28
COMPROMISSADA_PRE	649.869,78	4,81	2,45	0,00%	-18,58	18,95	66,78	-101,64
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	1.300.126,87	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPL66	1.476.405,00	137.440,12	125.153,08	2,29%	324.809,10	-324.809,10	216.440,97	-218.212,66
CURY3	684.320,00	94.392,61	51.863,43	0,95%	205.296,00	-205.296,00	100.321,31	-101.142,50
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DIRR3	1.072.904,00	134.926,24	87.438,26	1,60%	321.871,20	-321.871,20	157.287,73	-158.575,21
ELET3	4.625.581,34	514.241,25	488.045,64	8,91%	1.387.674,40	-1.387.686,58	678.110,22	-683.660,92
ENGH11	599.785,00	57.624,89	54.955,09	1,00%	101.962,06	-131.952,70	87.928,48	-88.648,22
EQTL3	2.543.904,00	187.811,76	168.855,71	3,08%	508.772,88	-508.788,72	372.936,33	-375.989,01
IGBR4	1.458.876,00	94.038,48	24.213,85	0,44%	364.719,00	-364.719,00	213.871,22	-215.621,87
GMAT3	840.622,00	82.534,20	55.617,29	1,02%	151.311,96	-134.510,61	123.235,19	-124.243,93
HAPV3	662.069,76	127.675,28	111.041,48	2,03%	225.103,72	-225.103,72	97.059,43	-97.853,91
IGT11	331.898,00	22.013,15	16.233,44	0,30%	66.379,60	-66.379,60	48.656,25	-49.054,52
ITS44	2.863.044,84	254.406,17	232.137,82	4,24%	543.951,54	-543.978,52	419.722,37	-423.158,03
ITUB4	8.878.865,74	755.079,73	718.351,89	13,12%	1.775.773,15	-1.686.984,49	1.301.641,72	-1.312.296,36
JBSS3	2.257.827,00	313.117,82	90.482,50	1,65%	790.239,45	-790.239,45	330.997,44	-333.706,83
LREN3	1.089.130,50	153.718,69	143.860,10	2,63%	217.826,10	-217.826,10	159.666,53	-160.973,49
LWSA3	387.610,00	40.014,27	20.630,89	0,38%	155.044,00	-155.044,00	56.823,63	-57.288,76
MRFG3	1.939.284,00	305.157,28	209.478,51	3,83%	775.701,24	-581.797,56	284.299,03	-286.626,18
MULT3	465.738,00	35.431,94	31.324,50	0,57%	139.721,40	-116.434,50	68.277,19	-68.836,08
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PETR3	1.898.316,00	121.037,72	69.915,78	1,28%	474.579,00	-569.494,80	278.293,13	-280.571,11
PETR4	8.440.968,69	482.774,15	235.789,73	4,31%	2.110.242,17	-2.532.290,61	1.237.446,01	-1.247.575,17
PRI03	1.532.652,00	147.305,45	37.188,85	0,68%	812.305,56	-505.775,16	224.686,78	-226.525,97
RAOL3	1.151.184,64	119.432,47	94.182,32	1,72%	230.236,93	-230.236,93	168.763,67	-170.145,09
RAIL3	971.120,00	88.097,09	56.573,71	1,03%	437.004,00	-320.469,60	142.366,19	-143.531,54
RDOR3	2.025.840,00	332.126,97	308.569,34	5,64%	607.752,00	-607.752,00	296.988,14	-299.419,15
RENT3	3.201.924,00	205.641,41	-54.867,31	-1,00%	1.056.634,92	-832.500,24	469.402,06	-473.244,37
SBFG3	795.501,00	238.420,09	212.295,65	3,88%	302.284,89	-318.205,89	116.620,45	-117.575,05
SBSPP3	2.633.488,00	296.943,58	256.914,20	4,69%	658.372,00	-658.372,00	386.069,34	-389.229,53
SRNA3	658.190,00	45.543,99	11.288,18	0,21%	0,00	0,00	96.490,65	-97.280,48
STBP3	477.414,00	86.326,77	3.476,03	0,06%	167.094,90	-167.094,90	69.988,89	-70.561,79
SUZB3	3.436.775,00	323.939,57	-75.932,79	-1,39%	859.193,75	-687.355,00	503.831,22	-507.955,35
TIMS3	706.308,00	105.762,02	75.732,43	1,38%	226.018,56	-162.456,84	103.544,75	-104.392,32
TOTS3	1.083.192,00	80.991,53	45.788,88	0,84%	216.638,40	-216.638,40	158.795,95	-160.095,78
VALE3	11.567.673,70	922.370,29	-404.249,28	-7,38%	2.891.918,43	-2.891.918,43	1.695.820,96	-1.709.702,17
VBBR3	966.023,00	143.379,51	135.132,44	2,47%	241.505,75	-241.510,08	141.618,97	-142.778,20
VIVT3	1.842.400,00	205.360,98	151.220,01	2,76%	276.360,00	-276.360,00	270.095,84	-272.306,72
WEGE3	3.484.684,00	317.598,54	245.420,89	4,48%	871.171,00	-871.177,44	510.854,67	-515.036,30
Total Var:	95.978.235,74	9.194.972,30	5.474.825,88	100,02%	24.124.261,37	-24.005.911,43	13.783.140,63	-13.895.997,38

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – OUTUBRO 2024



Data: 31/10/2024

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIA RVA EMB III
CNPJ: 38452593000108

Dados Gerais	
PL: 109.406.485,30	VAR / PL: 5,4829%
VAR: 5.998.636,74	ETL / PL: 6,8758%
ETL: 7.522.532,48	VAR / CDI: 0,0682%
Limite Fundo: ENQUADRADO	0,00% Duration DC: 1,00
Status: ENQUADRADO	Duration DU: 1,00
Benchmark:	

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	28.781.331,33	Cenário Baixa - 10000 (+):	1.210.834,38	CENARIO BRADESCO 1 (+):	15.225.475,02	CENARIO BRADESCO 2 (+):	1.560.072,46
Cenário Alta - 09999 (-):	-1.191.431,71	Cenário Baixa - 10000 (-):	-26.306.664,01	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-1.551.328,73	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-15.349.780,14
Cenário Alta - 09999:	27.589.899,63	Cenário Baixa - 10000:	-25.095.829,63	CENARIO BRADESCO 1:	13.674.146,29	CENARIO BRADESCO 2:	-13.789.707,68

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
ALOS3	4.626.486,48	258.032,55	235.230,20	3,92%	0,00	0,00	678.242,92	-683.794,70
ALPA4	135.513,00	14.139,08	-1.890,68	-0,03%	33.878,25	-33.880,14	19.866,21	-20.028,82
ASA3	1.036.616,00	212.295,65	124.291,57	2,07%	290.252,48	-269.520,16	151.967,91	-153.211,85
AZZA3	3.144.426,28	386.446,20	354.829,48	5,92%	0,00	0,00	0,00	0,00
BBAS3	1.681.065,18	148.929,42	120.936,34	2,02%	420.266,30	-420.266,30	246.444,16	-248.461,43
BBDC4	1.647.994,71	213.340,45	187.973,24	3,13%	411.998,68	-411.998,68	241.596,02	-243.573,62
BBSE3	1.617.544,00	160.041,52	142.259,70	2,37%	323.508,80	-323.508,80	237.131,95	-239.073,00
BPAC11	3.163.252,92	312.239,24	295.377,23	4,92%	948.975,88	-1.107.138,52	463.732,88	-467.528,78
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	3.992.426,41	29,57	19,89	0,00%	-114,13	116,41	410,25	-624,44
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-128.162,70	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPLE3	3.124.372,81	311.652,96	264.542,58	4,41%	687.362,02	-687.362,02	458.033,05	-461.782,30
CPLE6	4.079.655,27	379.779,46	320.154,07	5,34%	897.524,16	-897.524,16	598.077,46	-602.973,05
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DIOLZ24	-35.974,78	652.635,14	131.508,92	2,19%	-1.191.317,58	1.210.717,97	-1.551.328,73	1.560.072,46
ELET3	7.083.569,29	787.503,94	715.789,96	11,93%	2.125.070,79	-2.125.089,44	1.038.451,26	-1.046.951,54
ENEV3	1.420.684,20	107.867,19	29.094,97	0,49%	525.653,15	-724.548,94	208.272,30	-209.977,13
ENGH1	3.292.345,00	316.315,05	281.487,76	4,69%	559.691,02	-724.315,90	482.657,78	-486.608,59
EQTL3	9.661.663,88	713.302,89	663.142,49	11,05%	1.932.302,70	-1.932.362,86	1.416.399,93	-1.427.993,92
FLRY3	2.809.872,00	336.946,04	265.252,79	4,42%	561.974,40	-561.974,40	411.927,24	-415.299,08
GGPS3	1.371.624,00	122.615,34	36.033,75	0,60%	617.222,76	-617.230,80	201.080,08	-202.726,03
HAPV3	3.324.407,68	641.087,57	509.543,36	8,49%	1.130.298,61	-1.130.298,61	487.358,17	-491.347,46
IGTH1	8.578.759,98	568.986,55	512.630,22	8,55%	1.715.752,00	-1.715.752,00	1.257.646,21	-1.267.940,73
ITSA4	3.506.605,00	311.592,03	239.471,31	3,99%	666.221,90	-666.254,95	514.068,29	-518.276,22
MGLU3	143.546,04	23.452,71	20.208,60	0,34%	74.643,94	-64.595,72	21.043,85	-21.216,11
NTOC3	3.682.080,99	428.644,60	-286.607,82	-4,78%	920.520,25	-920.520,25	539.793,07	-544.211,57
ONCO3	80.500,00	14.500,55	7.587,18	0,13%	28.175,00	-28.175,00	11.801,30	-11.897,90
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PRI03	4.106.564,82	394.688,03	75.125,92	1,25%	2.176.479,36	-1.355.166,39	602.022,40	-606.950,28
RAIL3	7.975.800,60	723.540,66	592.689,59	9,88%	3.589.110,27	-2.632.014,20	1.169.252,37	-1.178.823,33
RECV3	813.681,60	73.441,00	54.132,66	0,90%	488.208,96	-488.208,96	119.285,72	-120.262,14
RENT3	7.748.992,24	497.673,79	8.974,80	0,15%	2.557.167,44	-2.014.737,98	1.136.002,26	-1.145.301,05
SCAR3	137.860,00	10.245,76	7.385,30	0,12%	82.716,00	-82.716,00	20.210,26	-20.375,71
SMFT3	5.119.455,00	254.839,50	148.890,89	2,48%	2.047.782,00	-2.047.782,00	750.512,10	-756.655,45
SUZB3	9.067.527,39	854.676,53	6.060,98	0,10%	2.266.881,85	-1.813.505,48	1.329.299,52	-1.340.180,55
WDOX24	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
WDOZ24	4.861,46	88.193,94	-17.771,48	-0,30%	160.988,86	-163.610,54	209.639,02	-210.820,60
YDUQ3	1.386.419,31	273.228,97	-45.719,04	-0,76%	540.703,53	-346.604,83	203.249,07	-204.912,77
Total Var:	109.403.036,06	10.592.903,84	5.998.636,74	99,98%	27.589.899,63	-25.095.829,63	13.674.146,29	-13.789.707,68

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – OUTUBRO 2024



Data: 31/10/2024

Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIA RVA EMB IV
CNPJ: 38452613000132

Dados Gerais			
PL:	100.798.332,90	VAR / PL:	7,1731%
VAR:	7.230.351,28	ETL / PL:	8,9953%
ETL:	9.067.152,20	VAR / CDI:	0,0787%
Limite Fundo:		Status:	ENQUADRADO
Benchmark:		Dutacion DC:	0,00%
		Dutacion DU:	1,00

Cenários de STRESS			
Cenário Alta - 09999 (+):	27.633.506,30	Cenário Baixa - 10000 (+):	160,00
Cenário Alta - 09999 (-):	-156,87	Cenário Baixa - 10000 (-):	-24.181.628,80
Cenário Alta - 09999:	27.633.349,43	Cenário Baixa - 10000:	-24.181.468,80
CENARIO BRADESCO 1 (+):	13.930.352,71	CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00
CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-14.044.669,93
CENARIO BRADESCO 1:	13.930.352,71	CENARIO BRADESCO 2:	-14.044.669,93

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	1.690.901,50	99.233,36	15.004,72	0,21%	507.270,45	-507.270,45	247.886,16	-249.915,24
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA PRE	5.487.507,65	40,65	20,84	0,00%	-156,87	160,00	563,89	-858,28
CONTAS_A PAGAR_RECEBER	290.796,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPLE3	2.490.337,07	248.408,55	234.072,95	3,24%	547.874,16	-547.874,16	365.083,41	-368.071,82
CPLE6	3.627.816,48	337.717,31	311.926,21	4,31%	798.119,63	-798.119,63	531.837,90	-536.191,28
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ENG11	11.676.346,85	1.121.815,67	1.050.385,48	14,53%	1.984.951,91	-2.568.796,31	1.711.752,45	-1.725.764,06
ENG4	15,08	1,58	1,47	0,00%	12,06	-12,06	2,21	-2,23
EQTL3	15.126.111,00	1.116.732,99	1.025.479,41	14,18%	3.025.175,11	-3.025.269,29	2.217.487,87	-2.235.639,21
GGPS3	5.243.254,52	468.716,97	233.737,70	3,23%	2.359.433,80	-2.359.464,53	768.661,11	-774.953,02
GMAT3	5.369.202,04	527.160,62	349.014,09	4,83%	966.456,37	-859.143,16	787.125,02	-793.568,06
HAPV3	5.495.952,00	1.059.853,92	940.469,16	13,01%	1.868.623,68	-1.868.623,68	805.706,56	-812.301,71
ITUB4	5.169.932,56	439.663,29	414.008,01	5,73%	1.033.986,51	-982.287,19	757.912,11	-764.116,03
MATD3	644.274,90	50.024,75	32.136,01	0,44%	193.282,35	-193.297,51	94.450,64	-95.223,77
MULT3	4.945.369,86	376.228,78	349.028,54	4,83%	1.483.610,96	-1.236.342,47	724.991,22	-730.925,67
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PRIO3	11.068.165,26	1.063.777,76	338.766,09	4,69%	5.866.127,59	-3.652.494,54	1.622.593,03	-1.635.874,83
RAIL3	6.903.727,90	626.285,44	450.401,58	6,23%	3.106.677,56	-2.278.230,21	1.012.086,51	-1.020.370,98
UBPA3	11.750.353,43	1.039.568,67	938.833,44	13,00%	2.937.588,36	-2.350.070,69	1.722.601,81	-1.736.702,24
VBBR3	3.817.263,31	566.567,62	546.065,56	7,55%	954.315,83	-954.332,94	559.610,80	-564.191,52
Total Var:	100.798.327,01	9.141.797,89	7.230.351,28	100,01%	27.633.349,43	-24.181.468,80	13.930.352,71	-14.044.669,93

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – OUTUBRO 2024

Relatório de Risco de Mercado



Data: 31/10/2024

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

Dados Gerais									
PL:	119.217.888,66	VAR / PL:	5,6177%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	3,34		
VAR:	6.697.357,26	ETL / PL:	7,0449%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	2,59		
ETL:	8.398.756,20	VAR / CDI:	0,0616%	Benchmark:					

Cenários de STRESS									
Cenário Alta - 09999 (+):	30.051.732,57	Cenário Baixa - 10000 (+):	2.535,29	CENARIO BRADESCO 1 (+):	17.230.789,95	CENARIO BRADESCO 2 (+):	5,90		
Cenário Alta - 09999 (-):	-2.090,48	Cenário Baixa - 10000 (-):	-30.312.468,24	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-3,87	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-17.370.698,02		
Cenário Alta - 09999:	30.049.642,09	Cenário Baixa - 10000:	-30.309.932,95	CENARIO BRADESCO 1:	17.230.786,07	CENARIO BRADESCO 2:	-17.370.692,12		

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
USIM5	185.000,68	33.306,43	-22.120,83	-0,33%	72.150,27	-40.700,15	27.121,10	-27.343,10
VALE3	14.398.664,72	1.148.104,70	-439.632,12	-6,56%	3.599.666,18	-3.599.666,18	2.110.844,25	-2.128.122,65
VAMO3	165.810,69	29.490,56	10.571,60	0,16%	58.033,74	-66.324,28	24.307,85	-24.506,82
VBBR3	1.240.324,45	184.092,01	171.939,75	2,57%	310.081,11	-310.086,67	181.831,56	-183.319,95
VIV3	174.898,80	30.314,29	25.370,31	0,38%	52.469,64	-52.470,32	25.640,16	-25.850,04
VIVT3	1.164.396,80	129.788,14	97.355,24	1,45%	174.659,52	-174.659,52	170.700,57	-172.097,85
WEGE3	3.730.451,62	339.998,11	271.304,65	4,05%	932.612,91	-932.619,80	546.884,21	-551.360,75
WINZ4	-17.382,60	128.211,66	128.050,21	1,91%	414.376,60	-413.460,79	325.712,57	-327.183,13
YDUQ3	167.139,33	32.939,03	-16.517,45	-0,25%	65.184,34	-41.784,83	24.502,63	-24.703,19
Total Var:	119.217.423,22	11.429.500,76	6.697.357,26	99,95%	30.049.642,10	-30.309.932,95	17.230.786,07	-17.370.692,12

Relatório de Risco de Mercado



Data: 31/10/2024

FUNDO: FIA EMB VIII ETF
CNPJ: 45622039000189

Dados Gerais									
PL:	89.152.949,27	VAR / PL:	5,6062%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	1,00		
VAR:	4.998.091,92	ETL / PL:	7,0304%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1,00		
ETL:	6.267.808,91	VAR / CDI:	0,0615%	Benchmark:					

Cenários de STRESS									
Cenário Alta - 09999 (+):	8.000.936,46	Cenário Baixa - 10000 (+):	3,60	CENARIO BRADESCO 1 (+):	6.516.330,93	CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00		
Cenário Alta - 09999 (-):	-3,53	Cenário Baixa - 10000 (-):	-8.000.936,46	CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-6.569.677,12		
Cenário Alta - 09999:	8.000.932,93	Cenário Baixa - 10000:	-8.000.932,86	CENARIO BRADESCO 1:	6.516.330,93	CENARIO BRADESCO 2:	-6.569.677,12		

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
BOVA11	44.569.780,75	2.496.364,07	2.495.932,09	49,94%	0,00	0,00	0,00	0,00
BOVV11	44.449.647,00	2.502.590,28	2.502.159,38	50,06%	8.000.936,46	-8.000.936,46	6.516.318,25	-6.569.657,83
CAIXA	8.989,62	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	123.355,70	0,91	0,45	0,00%	-3,53	3,60	12,68	-19,29
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	1.176,82	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
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
Total Var:	89.152.949,89	4.998.955,26	4.998.091,92	100,00%	8.000.932,93	-8.000.932,86	6.516.330,93	-6.569.677,12

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 – OUTUBRO 2024



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/10/2024

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	18/12/17	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	2.656.099,99	-	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	21/12/17	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	775.335,95	-	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	26/01/18	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	2.749.560,63	-	-	AAA(bra)
FIR F EMB II	19/02/18	19/02/18	15/02/25	SABESP	5.091.518,73	brAAA	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/02/18	19/02/18	15/02/25	SABESP	3.159.843,57	brAAA	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	13/03/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	13.737.466,93	brAA	-	AA(bra)
FIR F EMB II	23/05/18	23/05/18	15/05/28	COMGAS	27.525.588,57	-	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	676.727,96	brAA	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	676.727,96	brAA	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	676.727,96	brAA	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	676.727,96	brAA	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	676.727,96	brAA	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	04/07/18	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	6.469.618,30	brAAA	A2.br	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	26/07/18	26/07/18	15/07/25	AEGEA SA	7.459.558,93	brA	Aa1.br	AA(bra)
FIR F EMB II	26/07/18	26/07/18	15/07/25	CSMG	5.571.712,04	-	Aa3.br	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/02/13	15/02/25	CEMG	730.418,39	brA+	A1.br	AA-(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	583.161,65	-	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	3.692.422,55	-	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	2.102.746,32	-	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	6.357.303,06	-	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	745.637,25	-	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	6.032.883,21	-	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	8.947.647,01	-	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	921.878,78	-	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	637.833,05	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	30/09/20	28/09/20	22/09/25	HAPVIDA	85.579,09	-	-	AAA(bra)
FIR F EMB II	12/02/21	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	6.647.006,40	brAA	-	AA(bra)
FIR F EMB II	12/02/21	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	6.658.075,57	brAA	-	AA(bra)
FIR F EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	4.609.690,11	brAAA	-	-
FIR F EMB II	12/02/21	17/07/19	15/06/29	NEOENERG	655.429,17	brAAA+	-	-
FIR F EMB II	12/02/21	17/07/19	15/06/29	NEOENERG	6.515.293,02	brAAA+	-	-
FIR F EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	1.908.852,71	brAAA	-	-
FIR F EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	3.658.559,53	brAAA	-	-
FIR F EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	3.914.293,37	brAAA	-	-
FIR F EMB II	12/02/21	31/07/20	15/07/34	IGUA SAN	2.643.835,20	brAA	-	-
FIR F EMB II	12/02/21	23/05/18	15/05/28	COMGAS	23.972.099,91	-	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	26/10/16	27/01/25	BRADESCO	15.859.087,35	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	12/12/17	15/11/24	CCR	3.317.606,28	brAAA	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	14/12/17	15/11/24	ECORODOV	2.274.938,11	brAA	A2.br	-
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	19/02/18	15/02/25	SABESP	742.091,93	brAAA	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	23/05/18	15/05/28	COMGAS	10.654.158,71	-	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	28/06/18	15/06/27	JAGUARA	1.416.867,77	-	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	28/06/18	15/06/27	ENERGMIR	923.545,94	-	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	31/07/18	01/08/25	BRADESCO	5.094.356,10	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	22/12/20	15/12/26	IRB	2.836.775,21	brAAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	07/04/21	15/03/31	LOCALIZA	5.415.719,81	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/06/21	06/01/21	15/11/25	QUATA	604.792,49	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	222.205,55	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	346.234,75	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	346.234,75	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	179.957,51	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	365.767,30	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	360.280,79	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	902.480,21	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	225.357,40	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	1.037.991,83	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	14/06/21	19/06/19	16/12/24	BNBBM	630.480,29	brAAA	AAbr	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	14/06/21	12/06/19	09/12/24	BNBBM	955.319,80	brAAA	AAbr	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	16/06/21	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	377.590,41	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	17/06/21	18/03/21	15/02/26	CORSAN	515.110,55	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	25/06/21	25/06/21	20/06/26	OURO VER	1.486.590,82	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	1.789.948,96	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	01/07/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	3.022.410,59	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/07/21	01/03/21	18/02/25	RENNER	563.532,87	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/07/21	01/03/21	18/02/25	RENNER	119.179,24	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	08/07/21	08/07/21	15/06/31	VAMOS	271.205,79	brAAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/07/21	07/04/21	15/03/29	CAGECE	257.526,52	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	12/07/21	12/07/21	12/07/26	BRADESCO	4.802.539,20	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	2.228.167,25	brAAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	1.082.252,66	brAAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	562.771,38	brAAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	21.986,78	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	4.456.334,49	brAAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	815.241,77	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.040.172,47	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	889.845,93	-	-	AA-(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	20/09/19	20/08/26	VAMOS	698.904,92	brAAA+	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/07/21	23/12/20	15/12/26	RD COLIN	2.162.516,20	brAAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	04/08/21	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	366.014,83	brA	-	-

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – OUTUBRO 2024



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/10/2024

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	06/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	658.171,21	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	11/08/21	11/08/21	15/08/31	CSAN	1.058.501,64	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	11/08/21	19/11/19	15/06/27	AUTOPIST	1.032.864,99	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	17/08/21	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	2.908.109,10	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	18/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	1.220.822,54	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	27/08/21	27/08/21	20/08/31	S LUIZ A	1.050.396,57	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	693.407,90	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	62.096,23	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	310.481,15	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	12/05/21	15/04/26	ELETROB	1.984.668,66	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/09/21	22/10/19	21/10/26	AUTOBAN	362.923,47	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/09/21	20/09/21	15/09/29	MOV_PART	1.028.710,29	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	1.108.861,01	brAAA	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	833.831,82	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	833.831,82	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	1.071.480,76	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	416.229,06	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	416.229,06	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	23/09/21	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	3.551.601,09	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	23/09/21	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	4.304.971,02	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	30/09/21	30/09/21	15/09/31	SIMPAR	853.895,75	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	04/10/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	646.394,78	brAA	-	AA-(bra)
FIM EMB I A	20/10/21	20/10/21	20/10/25	DAYCOVAL	3.059.057,87	brAAA	AA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	22/10/21	22/10/21	15/12/35	CART	901.139,09	brAAA	-	-
FIM EMB I A	27/10/21	27/10/21	15/10/29	CONT GLO	1.793.847,06	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	04/11/21	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	3.311.562,72	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/11/21	10/11/21	15/10/28	LIGHT	367.500,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	12/11/21	12/11/21	15/10/31	VAMOS	2.077.476,28	brAAA	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/11/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	2.373.741,99	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	03/12/21	11/06/19	09/12/24	BNBBM	631.046,73	brAAA	AA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/12/21	06/12/21	15/12/35	TESC	289.726,56	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/12/21	06/01/21	15/11/25	QUATA	2.709.048,72	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/12/21	20/12/21	15/11/35	ORIZON	2.257.071,60	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	713.889,41	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	667.076,99	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	19/04/22	19/04/22	16/04/29	VERT-10	88.436,15	-	-	AAAs(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/04/22	26/04/22	15/04/50	LIGHT	980.000,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	12/05/22	12/05/22	15/04/27	BRKA	1.493.527,40	-	A+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/05/22	26/05/22	10/05/27	GUAR	1.015.448,60	-	-	A
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	864.565,21	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	03/03/22	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	3.083.140,29	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/03/22	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	1.106.500,30	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/03/22	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	548.200,93	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/03/22	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	2.007.434,90	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/03/22	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	703.713,34	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/06/22	06/12/21	15/12/35	TESC	863.242,65	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	06/12/21	15/12/35	TESC	541.456,19	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	30/09/21	15/09/31	SIMPAR	1.838.122,95	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	08/07/21	15/06/31	VAMOS	923.391,15	brAAA	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	08/07/21	15/06/31	VAMOS	75.334,94	brAAA	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	740.218,03	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	837.036,08	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	12/11/21	15/10/31	VAMOS	2.008.919,56	brAAA	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	12/11/21	15/10/31	VAMOS	1.506.170,30	brAAA	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/07/22	28/07/22	18/07/25	1V11	1.696.279,97	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	29/07/22	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	1.755.312,25	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/08/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	1.317,63	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	07/04/21	15/03/29	CAGECE	1.588.668,19	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	07/04/21	15/03/29	CAGECE	2.646.996,37	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/09/22	02/09/22	02/09/29	AEGEA SA	1.751.384,65	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	27/09/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	56.658,12	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/09/22	28/09/22	28/09/27	B.BRASIL	4.425.198,29	-	AAA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/10/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	39.528,92	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/11/22	08/11/22	15/06/42	BRK AMBI	2.660.837,41	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	11/11/22	11/11/22	15/10/40	RAHOLD	2.636.544,87	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	11/11/22	11/11/22	15/10/40	RAHOLD	6.860.156,13	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	3.657.036,48	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	1.757.736,89	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	1.439.220,81	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	471.524,56	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	2.149.536,01	brAAA	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	2.280.319,01	brAAA	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	1.663.291,51	brAAA	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/12/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	1.714.091,72	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	02/05/22	15/04/38	RDVE	359.758,73	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/01/23	26/01/23	20/01/26	CELG	456.237,49	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/03/23	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	323.437,40	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	1.171.402,26	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	27/07/22	15/04/36	BRV_VDR	2.943.002,25	-	A.br	-

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – OUTUBRO 2024



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/10/2024

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	20/04/23	12/05/22	15/04/27	BRKA	1.134.030,61	-	A+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	20/04/23	12/05/22	15/04/27	BRKA	31.304,50	-	A+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	2.251.499,84	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	18/06/21	15/12/30	MG050	1.775.324,61	brAAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	08/11/22	15/06/42	BRK AMBI	1.393.657,26	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	08/07/21	15/06/31	VAMOS	1.061.146,48	brAAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	22/10/21	15/12/35	CART	830.920,46	brAAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	02/10/20	15/09/34	BRKA	297.922,88	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	02/10/20	15/09/34	BRKA	2.843.707,48	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	22/10/21	15/12/35	CART	667.076,99	brAAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	10/02/21	15/12/31	METRORIO	2.920.552,95	brAAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/05/23	08/11/22	15/06/42	BRK AMBI	2.437.996,79	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/05/23	22/10/21	15/12/35	CART	2.200.183,74	brAAA+	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.080.300,94	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	16/05/23	23/12/20	15/12/27	SABESP	2.365.624,15	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	21/07/21	15/07/31	CACHOEIR	1.769.239,14	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	29/10/21	15/10/26	COELBA	1.832.882,38	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	04/05/22	15/04/27	LOCALIZA	2.834.304,89	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	26/05/23	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	58.823,81	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	02/06/23	25/06/21	20/06/26	OURO VER	298.158,05	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	23/06/23	23/06/23	15/05/43	IGUA RJ	1.368.813,84	brAAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	28/06/23	08/07/21	15/06/31	VAMOS	1.064.375,12	brAAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	28/06/23	28/07/22	18/07/25	1V11	385.358,94	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	13/07/23	28/07/22	18/07/25	1V11	1.168.541,27	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	13/07/23	28/07/22	18/07/25	1V11	285.643,42	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	21/07/23	23/12/20	15/12/26	RD COLIN	1.611.265,76	brAAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	763.874,72	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	763.874,72	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	26/07/21	15/06/33	ASA BRAN	2.320.188,44	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	01/08/23	31/07/23	25/07/28	TIMSA	2.263.073,40	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/23	17/04/23	17/03/30	VERO	202.479,47	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/23	06/12/21	15/12/35	TESC	2.026.898,50	-	-	A-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/23	02/05/22	15/04/38	RDVE	2.914.968,15	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/08/23	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.159.501,90	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	10/08/23	05/06/18	05/06/28	BRADESCO	4.355.922,83	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	21/08/23	08/08/23	15/01/34	SPERIO4	2.437.880,42	brAAA+	-	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	29/08/23	29/08/23	29/08/25	BRADESCO	11.475.482,54	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	30/08/23	30/08/23	01/09/25	VOLKSWAG	6.904.363,54	brAAA	AAA.br	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	08/09/23	08/09/23	08/09/25	B VOTORA	6.889.912,67	brAAA	AA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/09/23	06/01/21	15/11/25	QUATA	2.635,26	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	19/09/23	13/09/23	15/09/25	PANAMERI	5.689.345,42	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	21/09/23	21/09/23	15/09/28	ELETROB	2.609.285,44	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	28/09/23	28/09/23	15/09/30	CSMG	2.593.452,92	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	29/09/23	19/05/30	10/05/30	RODO BR	2.692.862,73	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	29/09/23	06/09/21	20/08/31	S LUZA A	1.503.163,92	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	29/09/23	13/09/23	15/09/25	B VOTORA	5.675.786,72	brAAA	AA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	02/10/23	14/11/22	10/10/31	CORREDOR	2.279.133,59	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	20/10/23	20/10/23	20/10/28	SANTANDE	4.608.625,26	-	AAA.br	A-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/11/23	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	3.011.327,23	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/11/23	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	1.532.077,34	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/11/23	18/06/21	15/12/30	MG050	931.687,08	brAAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	23/11/23	29/09/22	15/09/28	VERT5	2.442.249,36	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	23/11/23	10/12/21	17/11/28	DESKTOP	2.705.384,02	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/12/23	12/02/21	15/12/35	MS 306	1.078.115,97	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/12/23	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.013.609,79	-	Aa3.br	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	26/12/23	27/12/22	02/06/26	BRADESCO	11.068.105,41	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	08/01/24	08/01/24	08/01/26	DAYCOVAL	10.986.766,58	brAAA+	AA.br	AA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	08/01/24	08/01/24	08/01/26	B.ALFA	10.980.497,77	-	AAA.br	AA+(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	08/01/24	08/01/24	08/01/26	ABC	11.018.354,76	brAAA	AA+.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	17/04/23	17/03/30	VERO	2.934.851,93	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	2.092.215,65	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	2.092.215,65	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	25/03/22	15/03/44	GBS PART	1.152.020,11	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	25/03/22	15/03/44	GBS PART	1.954.319,82	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	53.377,16	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	1.903.059,24	brA	-	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	11/01/24	27/12/22	02/06/26	BRADESCO	11.635.827,01	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	18/01/24	18/01/24	04/01/27	TOYOTA	6.528.551,41	brAAA	-	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	24/01/24	24/01/24	26/01/26	ABC	10.960.501,00	brAAA	AA+.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	24/01/24	24/01/24	25/01/27	BTG PACT	4.692.086,57	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	25/01/24	25/01/24	26/01/26	BTG PACT	7.018.721,49	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	26/01/24	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	1.080.841,54	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	26/01/24	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.202.798,42	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	30/01/24	28/04/21	08/11/24	MANAUSEN	2.271.070,34	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	30/01/24	01/06/23	25/05/26	LM TRANS	2.663.467,82	-	AA+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	30/01/24	27/10/21	15/10/29	CONT GLO	2.275.994,19	-	-	AA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	31/01/24	31/01/24	02/02/26	B.ALFA	11.552.361,01	-	AAA.br	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/02/24	08/02/24	15/09/31	PLANALTO	2.136.928,00	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	15/02/24	15/02/24	15/12/43	AGUAS SE	2.166.109,65	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	20/02/24	12/11/21	30/04/29	HAPVIDA	541.848,57	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	21/02/24	18/03/21	15/02/26	CORSAN	1.292.927,48	-	-	AA(bra)

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – OUTUBRO 2024



RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/10/2024

Fundo	INFORMAÇÕES DOS ATIVOS				INFORMAÇÕES DE RATING			
	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/02/24	19/04/22	16/04/29	VERT-10	342.992,95	-	-	AAAsf(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/02/24	07/04/21	15/03/26	CAGECE	1.863.372,02	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/02/24	24/03/22	11/03/27	ARTERIS	2.515.627,08	brAAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/02/24	16/02/24	15/02/34	NTRASSUD	2.705.384,82	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	281.047,10	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	18/06/21	15/12/30	MG050	291.792,11	brAAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	02/05/22	15/04/38	RDVE	736.813,55	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	790.391,75	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	281.047,10	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	12/02/21	15/12/35	MS 306	316.754,16	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	92.064,75	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	513.234,54	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	10/02/21	15/12/31	METRORIO	497.226,76	brAA	-	AA-(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	26/02/24	26/02/24	01/03/27	BTG PACT	11.521.235,91	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	05/03/24	05/03/24	24/08/26	B VOTORA	7.044.029,63	brAAA	AA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	12/03/24	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	2.008.268,98	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/03/24	23/06/23	15/05/43	IGUA RJ	1.213.681,60	brAAA+	-	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	05/04/24	05/04/24	06/04/26	PSA	6.943.023,77	-	AAA.br	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	16/05/24	16/05/24	18/05/26	BANSICRE	3.485.289,46	brAAA	AAA.br	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/05/24	10/11/21	30/10/31	DASA	1.554.278,98	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/06/24	18/06/24	10/06/29	OURO VER	642.011,50	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	17/07/24	17/07/24	15/07/34	CSMG	2.964.353,78	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/07/24	13/06/24	15/05/36	CELG	2.789.879,58	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	05/08/24	01/08/24	15/07/27	CEA MODA	1.477.343,08	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/08/24	06/08/24	15/03/43	BARUERI	1.470.058,86	brAA-	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	06/08/24	01/08/24	11/06/30	VIX LOGI	2.256.543,03	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/08/24	05/06/24	15/05/34	JALLES M	590.840,09	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	08/08/24	06/08/24	15/03/43	BARUERI	1.267.292,12	brAA-	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/08/24	09/05/24	15/04/34	ENEVA	197.198,07	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	30/08/24	30/08/24	15/08/41	ROD TRIA	2.488.533,20	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/10/24	02/05/22	15/04/38	RDVE	593.832,52	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/10/24	13/06/24	15/05/36	CELG	247.769,06	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/10/24	08/02/24	15/09/31	PLANALTO	504.059,43	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/10/24	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	517.267,92	-	-	AA-(bra)
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	VERDECARD FIDC SN6	739.618,93	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	FIDC VERDECARD SN8	1.334.593,63	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	RB CAP CREDIT AL SN3	462.494,69	brAA-(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	INSS CONS PDL I FIDC	105.319,94	-	-	AAAsf(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	-	-	-	DRIVER SIX FIDC SN	539.802,85	-	AAA.br	-

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

4. RISCO OPERACIONAL

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

5. RISCO DE LIQUIDEZ

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

6. RISCO LEGAL

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

6.1. Relatório de Enquadramentos Legais



Relatório Resumo de Enquadramento

Patrimônio Líquido da Fundação **5.123.369.512,14**

Tópico do Enquadramento	Limite	Aplicação Atual	Valor Limite	% Aplicado	Status
% do Segmento RF/PL PLANO	100,00%	4.520.538.153,14	5.123.369.512,14	88,23%	Enquadrado
% do PL em Títulos de Emissão do Tesouro Nacional e/ou do BACEN	100,00%	3.845.442.632,24	5.123.369.512,14	75,06%	Enquadrado
% do PL em Títulos RF1, exceto títulos do Tesouro Nacional	80,00%	675.095.520,90	4.098.695.670,79	13,18%	Enquadrado
% do PL em FIDC	20,00%	Verificar Rel. de Diversificação de FIDC's	1.024.673.917,70	0,00%	Enquadrado
% do PL em uma mesma pessoa jurídica não-financeira	10,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Não Financ.	512.336.958,85	0,00%	Enquadrado
% do PL em Instituições Financeiras	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Financ.	1.280.842.378,04	0,00%	Enquadrado
% de uma mesma Série de Debêntures	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Debêntures	1.280.842.378,04	0,00%	Enquadrado
% do PL em RV	70,00%	499.652.534,83	3.586.358.597,42	9,75%	Enquadrado
% do capital votante de uma empresa	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação RV	1.280.842.378,04	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Imobiliários	20,00%	72.058.194,16	1.024.673.917,70	1,41%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Empréstimos	15,00%	28.907.098,58	768.505.457,36	0,56%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Estruturados	20,00%	0,00	1.024.673.917,70	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos no Exterior	10,00%	0,00	512.336.958,85	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 OUTUBRO DE 2024 À 31 DE OUTUBRO 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
11/10/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	6,4795%	6,4933%	6,3260%	6,5870%	-0,0138%	NÃO
15/10/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	6,5295%	6,5634%	6,3794%	6,6398%	-0,0339%	NÃO
16/10/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,5405%	6,6121%	6,4141%	6,6747%	-0,0716%	NÃO
16/10/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,5405%	6,6121%	6,4141%	6,6747%	-0,0716%	NÃO
16/10/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,5405%	6,6121%	6,4141%	6,6747%	-0,0716%	NÃO
16/10/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,5405%	6,6121%	6,4141%	6,6747%	-0,0716%	NÃO
16/10/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,5405%	6,6121%	6,4141%	6,6747%	-0,0716%	NÃO
16/10/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,5405%	6,6121%	6,4141%	6,6747%	-0,0716%	NÃO
16/10/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,5405%	6,6121%	6,4141%	6,6747%	-0,0716%	NÃO
16/10/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,5405%	6,6121%	6,4141%	6,6747%	-0,0716%	NÃO
16/10/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,5405%	6,6121%	6,4141%	6,6747%	-0,0716%	NÃO
25/10/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	6,6695%	6,7154%	6,5160%	6,7762%	-0,0459%	NÃO
29/10/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	6,6990%	6,7677%	6,5968%	6,8572%	-0,0687%	NÃO
29/10/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	6,6990%	6,7677%	6,5968%	6,8572%	-0,0687%	NÃO
29/10/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	6,6990%	6,7677%	6,5968%	6,8572%	-0,0687%	NÃO
29/10/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	6,6990%	6,7677%	6,5968%	6,8572%	-0,0687%	NÃO
29/10/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	6,7495%	6,7677%	6,5968%	6,8572%	-0,0182%	NÃO
29/10/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	6,6990%	6,7677%	6,5968%	6,8572%	-0,0687%	NÃO

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE OUTUBRO DE 2024 À 31 DE OUTUBRO DE 2024



FIRF EMB II A CRED PRIV												
FONTE ANBIMA												
DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
14/10/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2050	Compra	6,4845%	6,5285%	6,3442%	6,6049%	-0,0440%	NÃO
15/10/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/05/2029	Compra	6,6860%	6,7026%	6,4710%	6,8099%	-0,0166%	NÃO
15/10/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2050	Compra	6,5559%	6,5634%	6,3794%	6,6398%	-0,0075%	NÃO
17/10/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	LIQUIDEZ	NTN-B	15/08/2028	Venda	6,8410%	6,8100%	6,6629%	7,0000%	0,0310%	NÃO
17/10/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	LIQUIDEZ	NTN-B	15/08/2028	Venda	6,8410%	6,8100%	6,6629%	7,0000%	0,0310%	NÃO
17/10/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	LIQUIDEZ	NTN-B	15/08/2028	Venda	6,8410%	6,8100%	6,6629%	7,0000%	0,0310%	NÃO

RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE OUTUBRO DE 2024 À 31 DE OUTUBRO DE 2024



EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA												
FONTE ANBIMA												
DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
09/10/2024	EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA	ITAU UNI	XP CCTVM	NTN-B	15/08/2028	Compra	6,7400%	6,8825%	6,5660%	7,0449%	-0,1425%	NÃO
16/10/2024	EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA	ITAU UNI	RENASCEN	NTN-B	15/05/2025	Compra	5,3272%	5,4104%	5,0489%	6,0021%	-0,0832%	NÃO
16/10/2024	EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA	ITAU UNI	RENASCEN	NTN-B	15/08/2026	Compra	6,7591%	6,7900%	6,5973%	7,0303%	-0,0309%	NÃO
16/10/2024	EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA	ITAU UNI	RENASCEN	NTN-B	15/08/2028	Compra	6,8144%	6,8373%	6,6517%	6,9889%	-0,0229%	NÃO
16/10/2024	EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA	ITAU UNI	RENASCEN	NTN-B	15/05/2035	Compra	6,5834%	6,5867%	6,3844%	6,6646%	-0,0033%	NÃO

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – OUTUBRO 2024

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

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



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
01-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALPA4	6,95	5.200,00	36.159,45	6,88	6,94	7,04	6.247,00
01-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	35,72	2.200,00	78.593,48	35,42	35,72	35,95	14.481,00
01-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	10,07	9.700,00	97.715,69	9,97	10,07	10,17	15.568,00
01-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	44,60	2.200,00	98.118,66	44,19	44,62	45,35	14.333,00
01-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	GGPS3	18,76	1.200,00	22.515,61	18,29	18,61	19,44	9.778,00
01-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	GGPS3	19,24	900,00	17.316,00	18,29	18,61	19,44	9.778,00
01-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	19,99	3.500,00	69.975,65	19,71	19,92	20,25	24.352,00
01-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	19,91	7.200,00	143.321,78	19,71	19,92	20,25	24.352,00
01-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	41,14	6.100,00	250.978,04	40,67	41,11	41,70	19.815,00
01-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	54,76	2.700,00	147.853,61	54,46	54,80	55,19	20.430,00
01-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	54,72	900,00	49.248,00	54,46	54,80	55,19	20.430,00
02-10-24	FIA RVA EMB II	Compra	PRI03	45,51	5.000,00	227.573,84	44,12	44,73	45,68	37.759,00
02-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	42,36	2.300,00	97.418,12	41,68	42,32	43,00	13.244,00
02-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	45,20	1.300,00	58.764,59	44,59	45,06	45,74	10.362,00
02-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	21,25	1.800,00	38.243,25	21,08	21,21	21,39	11.555,00
02-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ONCO3	4,50	10.100,00	45.450,00	4,44	4,51	4,59	5.746,00
02-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	42,02	1.400,00	58.831,60	41,45	41,98	42,43	16.333,00
02-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	55,25	1.800,00	99.442,39	54,81	55,26	55,77	12.516,00
03-10-24	FIA RVA EMB II	Venda	LWSA3	4,02	8.000,00	32.159,20	4,00	4,04	4,12	8.764,00
03-10-24	FIA RVA EMB II	Compra	PETRA	37,82	14.500,00	548.380,00	37,21	37,75	38,04	56.194,00
03-10-24	FIA RVA EMB II	Venda	RAIL3	19,51	10.100,00	197.015,29	19,48	19,70	19,84	22.589,00
03-10-24	FIA RVA EMB II	Venda	VBBR3	22,68	8.000,00	181.430,07	22,48	22,78	23,00	22.850,00
03-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	22,04	2.300,00	50.687,35	21,87	22,03	22,19	12.706,00
03-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	40,78	2.400,00	97.868,55	40,44	40,74	41,79	10.773,00
03-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	40,65	1.700,00	69.107,25	40,44	40,74	41,79	10.773,00
03-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	26,84	900,00	24.152,55	26,75	26,87	27,12	46.568,00
03-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBDC4	15,02	2.000,00	30.040,40	14,94	15,02	15,21	37.473,00
03-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	35,04	800,00	28.029,61	34,98	35,08	35,27	15.803,00
03-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	32,23	1.200,00	38.680,28	31,61	32,02	32,42	23.717,00
03-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPL6	8,87	3.600,00	31.924,84	8,81	8,86	9,01	5.752,00
03-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	9,95	6.100,00	60.681,09	9,87	9,95	10,07	20.002,00
03-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	38,22	1.800,00	68.798,09	37,94	38,28	39,01	27.374,00
03-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	14,02	1.900,00	26.641,28	13,90	14,05	14,18	13.964,00
03-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	43,76	2.100,00	91.901,31	43,37	43,78	44,44	14.782,00
03-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	43,63	2.900,00	126.538,46	43,37	43,78	44,44	14.782,00
03-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	43,64	1.100,00	48.003,65	43,37	43,78	44,44	14.782,00
03-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	15,09	2.500,00	37.734,35	15,01	15,11	15,17	13.075,00
03-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	GGPS3	18,18	1.000,00	18.184,52	18,12	18,17	18,39	5.063,00
03-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,06	9.400,00	38.170,26	3,99	4,04	4,11	35.852,00
03-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	10,63	8.700,00	92.506,38	10,58	10,64	10,86	31.980,00
03-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	MGLU3	9,73	400,00	3.890,67	9,43	9,65	9,91	26.619,00
03-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	14,61	6.300,00	92.030,04	14,03	14,44	14,73	19.780,00
03-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	14,65	2.300,00	33.688,91	14,03	14,44	14,73	19.780,00
03-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	14,58	7.900,00	115.179,01	14,03	14,44	14,73	19.780,00
03-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ONCO3	4,53	800,00	3.624,00	4,40	4,50	4,58	6.586,00
03-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ONCO3	4,51	1.700,00	7.673,39	4,40	4,50	4,58	6.586,00
03-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ONCO3	4,50	600,00	2.700,00	4,40	4,50	4,58	6.586,00
03-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	44,54	1.100,00	48.991,35	43,78	44,53	44,92	36.483,00
03-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	REC3	18,31	300,00	5.492,31	17,93	18,23	18,50	7.270,00
03-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	40,57	3.800,00	154.172,58	40,22	40,61	41,25	25.502,00
03-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	SCAR3	23,19	100,00	2.319,00	22,60	23,14	23,20	10,00
03-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	21,58	2.700,00	58.255,08	21,17	21,53	21,75	5.520,00
03-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	54,67	2.300,00	125.739,11	54,14	54,59	54,94	13.772,00
03-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	9,27	2.800,00	25.948,20	8,93	9,21	9,41	12.468,00
04-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	22,42	1.200,00	26.908,57	21,92	22,36	22,56	14.200,00
04-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ASA3	6,94	1.000,00	6.940,00	6,67	6,85	7,03	18.897,00
04-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ASA3	6,95	17.400,00	120.908,20	6,67	6,85	7,03	18.897,00
04-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ASA3	6,80	30.600,00	208.073,56	6,67	6,85	7,03	18.897,00
04-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ASA3	6,77	6.500,00	44.005,00	6,67	6,85	7,03	18.897,00
04-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	40,96	600,00	24.574,82	40,10	40,99	41,70	8.780,00
04-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	26,84	400,00	10.735,22	26,77	26,86	27,04	23.235,00
04-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBDC4	15,07	800,00	12.052,98	14,90	15,11	15,31	44.115,00
04-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	35,01	200,00	7.001,84	34,85	35,03	35,17	10.344,00
04-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	32,37	500,00	16.184,00	32,00	32,49	32,72	13.906,00
04-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	8,92	700,00	6.244,00	8,83	8,93	9,00	6.303,00
04-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	8,92	6.100,00	54.410,58	8,83	8,93	9,00	6.303,00
04-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPL6	9,95	1.900,00	18.909,32	9,87	9,96	10,04	19.898,00
04-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	38,24	1.200,00	45.884,22	37,95	38,13	38,38	19.055,00
04-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	38,11	1.500,00	57.160,81	37,95	38,13	38,38	19.055,00
04-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	14,09	900,00	12.685,01	13,95	14,07	14,14	12.416,00
04-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	43,92	3.000,00	131.767,11	43,59	43,92	44,25	11.058,00
04-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	32,35	300,00	9.704,26	31,93	32,35	32,58	19.097,00
04-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	15,12	1.100,00	16.637,28	14,97	15,12	15,15	8.750,00
04-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	GGPS3	18,43	400,00	7.373,87	18,07	18,39	18,53	5.899,00
04-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,06	4.400,00	17.879,05	3,94	4,04	4,09	49.078,00
04-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	21,44	2.900,00	62.179,34	21,02	21,32	21,60	11.492,00
04-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,63	4.900,00	52.088,70	10,53	10,62	10,68	14.827,00
04-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	9,58	8.100,00	77.632,00	9,51	9,62	9,77	19.319,00
04-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	9,59	200,00	1.917,41	9,51	9,62	9,77	19.319,00
04-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	14,70	2.900,00	42.621,07	14,41	14,71	14,90	17.174,00
04-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	14,68	2.100,00	30.828,00	14,41	14,71	14,90	17.174,00
04-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	14,67	3.800,00	55.754,51	14,41	14,71	14,90	17.174,00
04-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ONCO3	4,87	1.700,00	8.277,30	4,50	4,82	5,17	5.677,00
04-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ONCO3	4,77	2.600,00	12.392,93	4,50	4,82	5,17	5.677,00
04-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	44,44	700,00	31.107,60	44,02	44,50	44,90	29.152,00
04-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	REC3	18,43	300,00	5.529,00	18,20	18,38	18,55	6.484,00
04-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	41,68	1.000,00	41.678,75	40,52	41,67	42,14	21.225,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – OUTUBRO 2024

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE OUTUBRO DE 2024 À 31 DE OUTUBRO 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
04-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	22,07	1.300,00	28.687,88	21,61	22,02	22,18	5.263,00
04-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	22,08	3.500,00	77.278,64	21,61	22,02	22,18	5.263,00
04-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	55,41	1.100,00	60.949,59	54,50	55,41	55,75	17.243,00
04-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	10,07	800,00	8.058,34	9,28	9,88	10,25	11.909,00
07-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	22,53	700,00	15.772,84	22,16	22,50	22,68	18.211,00
07-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	6,88	33.100,00	227.609,01	6,75	6,87	7,09	19.869,00
07-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	6,78	2.700,00	18.306,00	6,75	6,87	7,09	19.869,00
07-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	6,79	5.700,00	38.676,18	6,75	6,87	7,09	19.869,00
07-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBDC4	15,19	11.300,00	171.634,49	15,12	15,23	15,43	43.783,00
07-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	32,36	400,00	12.942,94	32,07	32,37	32,81	13.269,00
07-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPL6	9,02	1.300,00	11.728,73	9,00	9,03	9,08	5.950,00
07-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPL6	10,08	1.300,00	13.101,52	10,01	10,08	10,14	19.327,00
07-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	38,22	700,00	26.753,80	38,08	38,25	38,72	11.179,00
07-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	43,90	1.900,00	83.408,01	43,72	43,99	44,60	7.718,00
07-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQT3	32,24	600,00	19.345,42	32,17	32,33	32,80	14.881,00
07-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	14,98	3.100,00	46.451,29	14,94	15,03	15,31	10.764,00
07-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	15,02	3.300,00	49.560,18	14,94	15,03	15,31	10.764,00
07-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,99	20.500,00	81.834,43	3,96	4,01	4,06	40.910,00
07-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	21,62	1.600,00	34.593,41	21,49	21,61	21,74	11.998,00
07-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	10,67	15.600,00	166.384,23	10,57	10,65	10,72	17.017,00
07-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	9,56	10.100,00	96.516,67	9,38	9,58	9,93	25.039,00
07-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	15,01	6.300,00	94.538,54	14,67	14,98	15,26	16.722,00
07-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	15,13	8.300,00	125.579,00	14,67	14,98	15,26	16.722,00
07-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	14,96	900,00	13.459,99	14,67	14,98	15,26	16.722,00
07-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	45,26	300,00	13.579,32	44,77	45,26	45,55	23.515,00
07-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	19,98	2.600,00	51.946,34	19,86	19,98	20,17	14.673,00
07-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	19,98	900,00	17.982,00	19,86	19,98	20,17	14.673,00
07-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	41,60	800,00	33.278,47	41,37	41,75	42,74	19.097,00
07-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	21,74	800,00	17.393,96	21,61	21,77	22,26	5.505,00
07-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	55,75	600,00	33.450,59	55,41	55,81	56,38	16.869,00
07-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	55,80	2.400,00	133.931,42	55,41	55,81	56,38	16.869,00
07-10-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ITUB4	35,14	14.800,00	520.025,00	34,85	35,11	35,32	22.970,00
07-10-24	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	21,06	14.700,00	309.563,00	20,93	21,08	21,44	10.050,00
07-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	TRXF11	104,56	459,00	47.993,84	104,18	104,30	104,70	8.616,00
08-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	22,68	4.600,00	104.347,44	22,46	22,66	22,81	19.621,00
08-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	22,67	3.500,00	79.356,64	22,46	22,66	22,81	19.621,00
08-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	22,67	1.900,00	43.073,00	22,46	22,66	22,81	19.621,00
08-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	22,75	2.600,00	59.150,00	22,46	22,66	22,81	19.621,00
08-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	6,80	32.300,00	219.671,96	6,68	6,79	6,86	23.466,00
08-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	6,81	1.100,00	7.488,94	6,68	6,79	6,86	23.466,00
08-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	41,20	900,00	37.078,81	40,31	41,26	41,83	8.668,00
08-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	43,90	2.100,00	92.194,71	43,33	43,84	44,07	9.282,00
08-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	43,80	600,00	26.280,00	43,33	43,84	44,07	9.282,00
08-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	15,07	1.800,00	27.122,01	14,92	15,09	15,15	8.100,00
08-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	15,12	1.700,00	25.704,00	14,92	15,09	15,15	8.100,00
08-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,98	6.500,00	25.870,00	3,90	3,97	4,04	43.937,00
08-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,99	6.700,00	26.732,90	3,90	3,97	4,04	43.937,00
08-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	21,60	500,00	10.802,02	21,19	21,54	21,72	13.199,00
08-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	21,57	5.000,00	107.833,33	21,19	21,54	21,72	13.199,00
08-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	21,61	25.000,00	540.178,81	21,19	21,54	21,72	13.199,00
08-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	21,54	4.200,00	90.468,00	21,19	21,54	21,72	13.199,00
08-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	15,36	2.200,00	33.788,64	15,00	15,61	15,85	19.947,00
08-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	15,74	4.000,00	62.941,53	15,00	15,61	15,85	19.947,00
08-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	15,69	10.200,00	160.015,12	15,00	15,61	15,85	19.947,00
08-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	19,70	9.700,00	191.058,21	19,59	19,72	19,98	18.712,00
08-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	55,34	3.400,00	188.153,46	54,58	55,43	55,81	17.718,00
08-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	GZTI11	47,59	5.253,00	249.980,02	45,82	47,59	48,99	4.381,00
08-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	TRXF11	104,33	1.292,00	134.800,47	104,00	104,26	104,67	7.851,00
09-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	21,91	1.000,00	21.905,61	21,80	22,03	22,42	30.289,00
09-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	6,66	1.700,00	11.322,00	6,50	6,61	6,78	27.726,00
09-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	6,64	12.100,00	80.307,23	6,50	6,61	6,78	27.726,00
09-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	41,04	300,00	12.313,00	40,57	41,08	41,49	9.532,00
09-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	26,44	600,00	15.863,14	26,35	26,53	26,91	46.510,00
09-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBDC4	14,87	1.300,00	19.335,32	14,83	14,95	15,20	38.164,00
09-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	33,85	400,00	13.540,06	33,75	33,93	34,26	18.752,00
09-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	32,27	500,00	16.135,74	32,06	32,31	32,58	19.714,00
09-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPL6	9,11	1.500,00	13.661,95	9,06	9,10	9,14	10.832,00
09-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPL6	10,07	1.600,00	16.115,01	10,05	10,10	10,20	20.619,00
09-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	38,18	1.300,00	49.634,94	38,00	38,18	38,46	23.779,00
09-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	13,87	1.400,00	19.421,28	13,83	13,92	14,03	19.552,00
09-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	43,40	2.300,00	99.823,42	43,17	43,44	43,83	16.388,00
09-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQT3	32,30	1.200,00	38.759,52	32,17	32,37	32,60	31.595,00
09-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	14,87	1.600,00	23.792,31	14,85	14,93	15,06	10.414,00
09-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	GGPS3	18,10	700,00	12.666,66	18,07	18,12	18,38	7.193,00
09-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	3,90	4.100,00	16.009,40	3,86	3,91	3,96	65.790,00
09-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	21,03	1.600,00	33.647,69	20,96	21,12	21,49	11.676,00
09-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,46	1.800,00	18.831,62	10,44	10,51	10,62	31.605,00
09-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	15,43	1.000,00	15.431,24	15,24	15,43	15,69	17.825,00
09-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	43,99	500,00	21.995,96	43,55	43,90	44,32	25.477,00
09-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	19,30	14.900,00	287.519,19	19,18	19,29	19,55	23.357,00
09-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	19,25	3.400,00	65.450,00	19,18	19,29	19,55	23.357,00
09-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	41,46	1.100,00	45.608,59	41,10	41,51	42,60	24.309,00
09-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	22,21	1.100,00	24.430,45	21,90	22,17	22,34	8.916,00
09-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	54,61	900,00	49.146,17	54,33	54,92	55,70	26.100,00
09-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	10,05	1.200,00	12.055,14	9,94	10,19	10,59	10.909,00
09-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	BPML11	80,58	1.862,00	150.038,80	80,00	80,59	82,26	660,00
09-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	GZTI11	46,65	3.215,00	149.995,20	46,29	46,88	47,80	3.095,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – OUTUBRO 2024

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

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



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBVBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
09-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	TRXF11	104,07	3.676,00	382.571,98	103,50	104,02	104,41	6.084,00
10-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	22,12	2.600,00	57.522,91	21,84	22,13	22,27	12.694,00
10-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	6,84	7.200,00	49.250,66	6,70	6,85	7,00	8.033,00
10-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	6,64	1.800,00	11.951,00	6,47	6,61	6,71	19.409,00
10-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	AZZA3	40,94	800,00	32.752,29	40,55	41,01	41,48	4.806,00
10-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	26,25	900,00	23.624,26	26,19	26,29	26,64	40.672,00
10-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBDC4	14,91	1.800,00	26.842,34	14,82	14,91	15,02	36.392,00
10-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	33,83	500,00	16.915,88	33,75	33,89	34,07	11.024,00
10-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	31,98	1.200,00	38.379,18	31,87	32,05	32,36	11.846,00
10-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPLE3	9,12	3.900,00	35.586,15	9,07	9,14	9,20	6.006,00
10-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPLE6	10,10	4.300,00	43.420,36	10,05	10,10	10,16	14.871,00
10-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	38,07	1.000,00	38.072,26	37,83	38,09	38,25	13.808,00
10-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	13,92	2.000,00	27.840,28	13,80	13,92	13,98	16.081,00
10-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	43,48	1.300,00	56.520,63	43,20	43,51	43,70	9.775,00
10-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	32,14	2.500,00	80.353,75	31,87	32,09	32,41	15.889,00
10-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	14,77	2.400,00	35.440,11	14,71	14,79	14,91	10.637,00
10-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	GGPS3	17,83	900,00	16.045,52	17,72	17,85	18,12	6.577,00
10-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,85	37.700,00	145.263,35	3,80	3,84	3,91	47.174,00
10-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	21,39	800,00	17.111,89	20,97	21,41	21,60	10.225,00
10-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	21,23	500,00	10.615,00	20,97	21,41	21,60	10.225,00
10-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,54	4.200,00	44.252,32	10,45	10,52	10,59	19.337,00
10-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	15,10	2.700,00	40.757,92	15,03	15,20	15,51	13.421,00
10-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	44,71	1.300,00	58.119,05	44,00	44,61	45,07	28.697,00
10-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	19,30	1.400,00	27.020,00	19,16	19,31	19,53	17.776,00
10-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	19,33	7.100,00	137.275,94	19,16	19,31	19,53	17.776,00
10-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	19,28	3.900,00	75.207,33	19,16	19,31	19,53	17.776,00
10-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	18,05	1.100,00	19.852,63	17,77	18,11	18,36	8.335,00
10-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	41,13	2.600,00	106.929,39	40,86	41,29	41,69	22.948,00
10-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	22,00	2.800,00	61.612,38	21,85	21,99	22,28	5.902,00
10-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	53,98	2.300,00	124.147,10	53,71	54,00	54,44	15.689,00
10-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	10,01	1.800,00	18.016,50	9,79	10,01	10,20	8.132,00
11-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	22,09	1.100,00	24.300,09	22,02	22,11	22,22	11.015,00
11-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	6,89	3.700,00	25.481,64	6,83	6,88	6,97	5.773,00
11-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	AZZA3	41,56	400,00	16.625,68	40,61	41,17	41,87	6.412,00
11-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	32,22	500,00	16.108,57	31,67	32,02	32,36	11.592,00
11-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLE3	9,06	2.600,00	23.560,53	8,94	9,00	9,15	11.300,00
11-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLE6	10,01	3.600,00	36.042,21	9,93	10,00	10,08	13.562,00
11-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLE6	10,00	9.600,00	96.029,59	9,93	10,00	10,08	13.562,00
11-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	38,04	800,00	30.429,71	37,68	37,94	38,19	14.056,00
11-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	13,87	800,00	11.092,16	13,73	13,84	13,95	17.007,00
11-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	42,96	2.000,00	85.924,14	42,65	43,02	43,51	14.893,00
11-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	31,57	2.600,00	82.094,64	31,36	31,59	32,01	26.334,00
11-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	31,59	2.100,00	66.344,85	31,36	31,59	32,01	26.334,00
11-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	14,75	900,00	13.274,14	14,56	14,72	14,82	7.076,00
11-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	3,86	3.700,00	14.274,58	3,75	3,82	3,90	32.745,00
11-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	21,30	500,00	10.650,00	21,00	21,21	21,48	10.332,00
11-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	21,20	1.500,00	31.795,78	21,00	21,21	21,48	10.332,00
11-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,47	1.700,00	17.802,11	10,44	10,48	10,54	17.764,00
11-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	14,99	1.200,00	17.985,36	14,78	14,99	15,19	14.408,00
11-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	44,40	500,00	22.199,18	44,10	44,35	44,75	21.912,00
11-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	19,08	4.500,00	85.845,59	18,97	19,08	19,36	19.941,00
11-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	41,61	1.100,00	45.774,57	40,49	41,45	41,88	19.437,00
11-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	41,60	900,00	37.440,00	40,49	41,45	41,88	19.437,00
11-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	41,60	3.500,00	145.598,35	40,49	41,45	41,88	19.437,00
11-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	21,94	1.200,00	26.333,04	21,47	21,85	22,02	4.670,00
11-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	54,36	900,00	48.923,82	53,86	54,54	55,25	24.652,00
11-10-24	FIA RVA EMB IV	Compra	GMAT3	7,19	5.598,00	40.242,17	7,06	7,23	7,31	11.687,00
14-10-24	FIA RVA EMB II	Compra	BBDC4	15,05	33.800,00	508.610,76	14,78	14,98	15,08	37.734,00
14-10-24	FIA RVA EMB II	Venda	INTB3	20,54	14.300,00	293.725,00	20,11	20,46	20,71	3.411,00
14-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,87	49.300,00	190.567,49	3,82	3,86	3,92	37.037,00
14-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	21,24	2.100,00	44.594,65	21,03	21,26	21,44	7.103,00
14-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	15,39	3.700,00	56.954,68	14,90	15,34	15,59	13.037,00
14-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	19,07	3.200,00	61.036,79	18,93	19,07	19,18	19.778,00
14-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	42,48	4.400,00	186.901,01	40,93	42,08	42,86	21.814,00
14-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	42,75	2.200,00	94.050,00	40,93	42,08	42,86	21.814,00
15-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBDC4	15,17	10.000,00	151.663,71	15,01	15,14	15,24	50.829,00
15-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLE3	9,04	4.200,00	37.974,23	8,98	9,06	9,17	19.347,00
15-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLE6	10,10	7.500,00	75.719,24	10,05	10,11	10,19	16.906,00
15-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	38,73	2.000,00	77.467,27	38,47	38,67	39,25	17.746,00
15-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	14,33	2.500,00	35.831,77	14,05	14,31	14,48	27.832,00
15-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	14,35	4.500,00	64.578,63	14,05	14,31	14,48	27.832,00
15-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	44,07	800,00	35.254,50	43,79	44,04	44,37	7.709,00
15-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	32,79	1.200,00	39.349,40	32,60	32,73	33,10	17.839,00
15-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	21,40	1.800,00	38.527,37	21,13	21,39	21,56	7.341,00
15-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	19,11	11.900,00	227.443,84	18,98	19,10	19,30	16.315,00
15-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	42,38	5.200,00	220.365,87	42,15	42,48	43,12	16.536,00
15-10-24	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	10,12	10.100,00	102.229,00	10,08	10,13	10,21	7.926,00
15-10-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLE6	10,08	10.100,00	101.806,00	10,05	10,11	10,19	16.906,00
15-10-24	FIA RVA EMB IV	Venda	ENGI11	43,99	2.100,00	92.370,00	43,79	44,04	44,37	7.709,00
15-10-24	FIA RVA EMB IV	Venda	ENGI11	43,98	200,00	8.795,00	43,79	44,04	44,37	7.709,00
15-10-24	FIA RVA EMB IV	Venda	EQLT3	32,69	3.100,00	101.331,00	32,60	32,73	33,10	17.839,00
16-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	7,04	1.100,00	7.744,44	6,89	7,00	7,06	6.849,00
16-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBDC4	15,10	12.900,00	194.825,18	14,97	15,11	15,26	57.384,00
16-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBDC4	15,12	24.600,00	372.028,55	14,97	15,11	15,26	57.384,00
16-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	38,06	2.000,00	76.116,11	37,95	38,17	38,57	30.429,00
16-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	44,18	1.600,00	70.684,82	43,55	44,27	44,66	11.320,00
16-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	18,88	800,00	15.103,81	18,78	19,15	19,38	25.230,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – OUTUBRO 2024

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE OUTUBRO DE 2024 à 31 DE OUTUBRO DE 2024



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBVBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
16-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	19,15	16.300,00	312.066,92	18,78	19,15	19,38	25.230,00
16-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	42,78	7.700,00	329.435,99	42,15	42,87	43,21	23.395,00
16-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	BPML11	79,75	2.387,00	190.363,25	79,75	80,50	82,30	699,00
16-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	EVBI11	9,25	16.194,00	149.783,16	9,16	9,24	9,97	56,00
16-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	HSRE11	95,93	120,00	11.512,00	95,40	95,92	96,00	9,00
16-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	MAXR11	66,48	6,00	398,88	66,48	66,70	66,98	49,00
16-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	NEWL11	108,83	1,00	108,83	108,70	109,10	109,65	98,00
16-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	PATC11	33,29	308,00	10.253,32	33,29	33,35	33,73	38,00
16-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	QAGR11	45,10	50,00	2.255,00	45,08	45,13	45,25	200,00
16-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	TRXF11	102,73	3.894,00	400.032,18	102,50	102,76	103,06	7.419,00
16-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	XPPR11	15,79	676,00	10.674,04	15,60	15,64	15,79	439,00
17-10-24	FIA RVA EMB II	Compra	ELET3	38,00	2.100,00	79.805,00	37,35	37,91	38,13	20.619,00
17-10-24	FIA RVA EMB II	Compra	ITSA4	10,61	44.200,00	469.007,66	10,42	10,56	10,66	16.950,00
17-10-24	FIA RVA EMB II	Compra	RENT3	42,33	3.600,00	152.376,00	42,02	42,40	42,80	26.224,00
17-10-24	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	60,79	11.800,00	717.332,38	60,64	60,90	61,32	45.150,00
17-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	6,93	2.300,00	15.944,12	6,88	6,93	6,97	5.216,00
17-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	40,73	1.300,00	52.945,47	40,18	40,81	41,22	5.560,00
17-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ3	8,89	3.900,00	34.663,71	8,85	8,88	8,98	5.963,00
17-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ6	9,94	5.700,00	56.674,19	9,90	9,93	10,07	14.141,00
17-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	37,89	6.000,00	227.365,85	37,35	37,91	38,13	20.619,00
17-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	14,15	5.300,00	74.970,84	14,06	14,14	14,26	23.715,00
17-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,75	25.200,00	94.614,26	3,72	3,75	3,84	110.274,00
17-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	21,02	2.600,00	54.661,63	20,87	21,07	21,23	12.162,00
17-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	TRXF11	102,77	37.886,00	3.893.719,50	102,04	102,73	103,00	6.735,00
18-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	22,43	1.300,00	29.154,24	22,35	22,44	22,87	11.636,00
18-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	6,91	2.300,00	15.893,17	6,86	6,91	7,00	7.177,00
18-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	6,92	2.300,00	15.910,72	6,86	6,91	7,00	7.177,00
18-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	7,17	4.200,00	30.114,00	6,97	7,10	7,23	27.986,00
18-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	7,10	16.000,00	113.657,72	6,97	7,10	7,23	27.986,00
18-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	7,04	19.600,00	137.984,85	6,97	7,10	7,23	27.986,00
18-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	40,54	1.700,00	68.914,90	40,30	40,60	41,49	7.057,00
18-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	26,69	500,00	13.346,68	26,63	26,70	26,97	32.111,00
18-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ3	8,88	300,00	2.664,00	8,79	8,85	8,91	5.415,00
18-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ3	8,84	1.100,00	9.729,00	8,79	8,85	8,91	5.415,00
18-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ6	9,88	800,00	7.904,00	9,77	9,85	9,96	22.439,00
18-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ6	9,83	6.300,00	61.924,47	9,77	9,85	9,96	22.439,00
18-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	38,03	2.600,00	98.878,27	37,77	37,83	38,55	23.344,00
18-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	14,34	10.500,00	150.598,16	14,23	14,34	14,43	21.514,00
18-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	43,29	2.700,00	116.883,16	42,94	43,26	43,99	12.404,00
18-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	32,58	700,00	22.805,00	32,18	32,48	32,99	15.648,00
18-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	GGPS3	18,34	600,00	11.002,00	18,23	18,39	18,75	3.282,00
18-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	9,44	1.400,00	13.212,30	9,36	9,54	9,72	16.105,00
18-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	19,17	200,00	3.834,19	18,99	19,16	19,50	33.730,00
18-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	19,23	2.400,00	46.148,79	18,99	19,16	19,50	33.730,00
18-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	22,55	500,00	11.274,82	22,39	22,89	23,57	6.477,00
18-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	55,57	400,00	22.226,00	54,84	55,50	55,94	20.878,00
21-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	26,77	7.700,00	206.093,72	26,54	26,74	26,96	32.467,00
21-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ3	8,95	1.800,00	16.107,73	8,86	8,95	8,99	3.420,00
21-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ6	9,96	4.000,00	39.833,12	9,86	9,95	10,00	14.725,00
21-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	38,05	1.500,00	57.074,39	37,73	38,08	38,31	18.630,00
21-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	14,40	3.400,00	48.960,00	14,25	14,32	14,47	16.123,00
21-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	14,32	4.300,00	61.591,67	14,25	14,32	14,47	16.123,00
21-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,65	37.800,00	137.970,00	3,64	3,68	3,81	38.619,00
21-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	41,82	1.300,00	54.365,30	41,54	41,99	42,89	19.622,00
21-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	19,36	800,00	15.488,00	19,03	19,12	19,38	25.117,00
21-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	17,17	2.600,00	44.647,47	17,08	17,18	17,34	8.417,00
21-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	21,61	1.100,00	23.773,37	21,38	21,64	22,51	9.955,00
21-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	21,58	4.900,00	105.757,24	21,38	21,64	22,51	9.955,00
21-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	56,70	2.300,00	130.407,25	55,55	56,58	56,96	28.112,00
21-10-24	FIA RVA EMB IV	Compra	PRI03	41,79	12.200,00	509.845,00	41,54	41,99	42,89	19.622,00
21-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	TRXF11	102,82	9.242,00	950.267,25	102,21	102,65	103,20	9.979,00
22-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	21,94	600,00	13.161,25	21,82	22,00	22,42	15.761,00
22-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	7,25	6.400,00	46.414,16	7,13	7,26	7,40	23.425,00
22-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	40,10	1.100,00	44.104,63	39,90	40,23	41,17	5.465,00
22-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	40,17	800,00	32.137,81	39,90	40,23	41,17	5.465,00
22-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBDC4	15,17	1.000,00	15.173,00	15,03	15,19	15,39	49.940,00
22-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	34,24	400,00	13.696,00	33,80	34,25	34,36	15.038,00
22-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	32,37	500,00	16.187,22	32,20	32,37	32,73	11.129,00
22-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ3	8,85	1.400,00	12.383,56	8,78	8,84	8,92	7.340,00
22-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ6	9,87	2.100,00	20.724,28	9,80	9,87	9,93	22.300,00
22-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ6	9,87	2.200,00	21.720,54	9,80	9,87	9,93	22.300,00
22-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	38,15	1.000,00	38.145,59	37,87	38,27	38,60	13.269,00
22-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	38,25	700,00	26.772,06	37,87	38,27	38,60	13.269,00
22-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	14,02	4.300,00	60.275,20	13,92	14,02	14,22	19.581,00
22-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	14,02	3.100,00	43.448,35	13,92	14,02	14,22	19.581,00
22-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	32,25	100,00	3.224,90	32,02	32,31	32,67	24.093,00
22-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	15,08	1.000,00	15.081,31	14,79	15,04	15,18	9.372,00
22-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	21,11	300,00	6.331,52	21,04	21,15	21,44	8.932,00
22-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	9,23	6.100,00	56.277,87	9,15	9,37	9,81	24.338,00
22-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	14,36	2.400,00	34.464,00	14,11	14,28	14,60	21.001,00
22-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	14,25	7.000,00	99.775,16	14,11	14,28	14,60	21.001,00
22-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	41,77	500,00	20.886,76	41,51	41,77	42,10	19.351,00
22-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	18,85	4.800,00	90.484,45	18,73	18,85	19,03	23.580,00
22-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	18,86	800,00	15.088,60	18,73	18,85	19,03	23.580,00
22-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	42,37	700,00	29.662,30	41,87	42,34	42,56	19.475,00
22-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	21,39	800,00	17.110,77	21,15	21,38	21,63	8.736,00
22-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	57,60	6.400,00	368.634,61	55,86	57,17	58,19	33.828,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – OUTUBRO 2024

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

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



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
22-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	57,70	600,00	34.619,57	55,86	57,17	58,19	33.828,00
22-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	10,35	1.400,00	14.491,00	10,25	10,43	10,79	8.194,00
22-10-24	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	3,60	49.628,00	178.593,30	3,51	3,59	3,69	59.229,00
22-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	EVBI11	9,54	92.510,00	882.478,10	9,25	9,53	9,55	61,00
22-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	FMOF11	40,02	16,00	640,32	40,02	40,02	40,02	1,00
22-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	GZIT11	47,07	264,00	12.426,48	46,70	47,04	47,97	3.129,00
22-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	HOFC11	25,33	3.404,00	86.223,40	25,10	25,39	26,00	205,00
22-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	SARE11	3,96	39.050,00	154.638,00	3,94	3,98	4,01	1.440,00
22-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	TRXF11	102,36	6.492,00	664.519,08	101,65	102,22	102,60	5.423,00
22-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	VSHO11	69,67	364,00	25.359,88	69,67	69,75	70,10	524,00
23-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	7,26	5.100,00	37.008,31	7,15	7,28	7,47	18.955,00
23-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	40,04	1.200,00	48.052,73	39,70	40,11	40,43	3.551,00
23-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLE3	8,75	2.100,00	18.384,73	8,71	8,78	8,86	7.904,00
23-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLF6	9,80	5.700,00	55.874,08	9,71	9,81	9,88	19.043,00
23-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	37,84	2.500,00	94.592,20	37,54	37,88	38,33	33.210,00
23-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	13,76	5.500,00	75.656,42	13,67	13,79	13,95	26.941,00
23-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	42,68	800,00	34.144,66	42,22	42,65	43,22	14.260,00
23-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	42,46	600,00	25.478,90	42,22	42,65	43,22	14.260,00
23-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	31,90	900,00	28.710,00	31,69	31,91	32,39	25.792,00
23-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	31,86	5.000,00	159.306,09	31,69	31,91	32,39	25.792,00
23-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	3,80	58.500,00	222.236,42	3,64	3,75	3,83	23.914,00
23-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	20,97	2.200,00	46.143,86	20,81	20,98	21,14	11.931,00
23-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	9,15	4.100,00	37.508,36	9,06	9,16	9,32	18.346,00
23-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	13,98	9.300,00	130.006,09	13,92	14,00	14,22	20.897,00
23-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	18,96	10.800,00	204.730,88	18,82	18,96	19,07	23.090,00
23-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	42,33	4.800,00	203.206,24	41,91	42,33	42,85	22.761,00
23-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	57,50	4.100,00	235.731,46	57,25	57,55	58,21	18.317,00
23-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	10,79	8.300,00	89.593,99	10,29	10,69	10,97	15.525,00
23-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	BPML11	80,80	266,00	21.492,00	79,80	80,20	81,11	1.119,00
23-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	CBOP11	24,25	352,00	8.536,00	24,25	24,33	24,99	16,00
23-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	EVBI11	9,43	931,00	8.779,54	9,40	9,42	9,60	35,00
23-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	HOFC11	25,10	2.586,00	64.908,60	25,10	25,11	25,83	479,00
23-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	HSRE11	96,75	348,00	33.667,62	96,01	96,74	97,69	41,00
23-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	MALL11	98,94	35,00	3.462,90	98,81	99,28	100,49	2.829,00
23-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	MAXR11	66,48	98,00	6.515,04	66,48	66,52	66,98	35,00
23-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	OULG11	31,07	3.893,00	120.959,86	31,01	31,07	31,38	638,00
23-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	PATC11	33,91	543,00	18.410,68	33,13	33,68	34,04	83,00
23-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	QAGR11	45,02	1.720,00	77.434,00	44,90	45,03	45,19	134,00
23-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	SARE11	3,92	37.708,00	147.815,36	3,92	3,94	4,00	1.101,00
23-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	XPPR11	15,09	7.985,00	120.493,65	15,09	15,15	15,66	947,00
24-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	7,36	10.000,00	73.602,29	7,15	7,35	7,49	16.152,00
24-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	40,75	1.400,00	57.045,61	40,04	40,81	41,71	6.365,00
24-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLE3	8,67	2.200,00	19.070,94	8,61	8,69	8,79	8.854,00
24-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLE3	8,68	4.500,00	39.060,00	8,61	8,69	8,79	8.854,00
24-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLF6	9,73	4.400,00	42.821,20	9,66	9,74	9,84	18.062,00
24-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	37,70	1.600,00	60.321,03	37,41	37,88	38,35	16.206,00
24-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	13,83	2.500,00	34.575,00	13,49	13,63	13,86	28.667,00
24-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	31,80	2.900,00	92.229,38	31,66	31,99	32,28	16.766,00
24-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	3,74	20.000,00	74.732,15	3,69	3,74	3,82	30.061,00
24-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	9,30	7.800,00	72.512,08	9,08	9,27	9,51	21.424,00
24-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	14,02	7.800,00	109.377,29	13,86	14,06	14,26	21.501,00
24-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	42,61	1.400,00	59.647,36	42,28	42,94	43,65	18.039,00
24-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	11,05	2.400,00	26.517,95	10,49	10,95	11,32	12.573,00
24-10-24	FIA RVA EMB IV	Compra	PRIO3	41,96	1.839,00	77.164,44	41,07	41,62	42,06	18.225,00
24-10-24	FIA RVA EMB IV	Compra	PRIO3	41,53	11.548,00	479.583,49	41,07	41,62	42,06	18.225,00
24-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	HSRE11	95,50	47.120,00	4.499.985,46	95,42	95,50	97,65	11,00
24-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	TRXF11	100,06	5.698,00	570.114,25	99,54	100,04	100,86	7.682,00
25-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	40,62	1.800,00	73.120,18	40,29	40,62	41,74	6.381,00
25-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLE6	9,74	2.500,00	24.352,61	9,70	9,74	9,80	15.979,00
25-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLF6	9,74	800,00	7.792,00	9,70	9,74	9,80	15.979,00
25-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLF6	9,74	8.500,00	82.760,08	9,70	9,74	9,80	15.979,00
25-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLF6	9,74	3.400,00	33.103,49	9,70	9,74	9,80	15.979,00
25-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	38,06	3.900,00	148.435,08	37,78	37,97	38,39	12.164,00
25-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	13,48	6.900,00	93.030,12	13,38	13,46	13,71	18.340,00
25-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	3,73	14.800,00	55.164,61	3,62	3,70	3,81	23.556,00
25-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	14,15	3.900,00	55.172,44	14,02	14,11	14,38	21.094,00
25-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	19,14	3.000,00	57.421,57	18,82	19,06	19,22	24.443,00
25-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	19,13	6.800,00	130.084,00	18,82	19,06	19,22	24.443,00
25-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	58,33	700,00	40.831,00	58,18	59,09	59,92	33.617,00
25-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	59,18	4.100,00	242.626,69	58,18	59,09	59,92	33.617,00
25-10-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	25,15	4.120,00	103.608,22	24,96	25,16	25,76	19.336,00
25-10-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	25,10	222,00	5.571,73	24,96	25,16	25,76	19.336,00
25-10-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	25,12	2.209,00	55.487,71	24,96	25,16	25,76	19.336,00
25-10-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	25,10	1.657,00	41.587,60	24,96	25,16	25,76	19.336,00
25-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	AIEC11	45,49	6.330,00	287.972,86	45,24	45,49	46,14	1.757,00
25-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	BMLC11	96,09	560,00	53.812,26	93,90	94,61	99,79	83,00
25-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	BRCR11	43,80	600,00	26.279,98	43,02	44,30	44,96	4.735,00
25-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	CBOP11	24,25	45,00	1.091,25	24,25	24,25	24,54	8,00
25-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	EVBI11	9,40	793,00	7.451,95	9,31	9,38	9,40	27,00
25-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	HOFC11	25,10	637,00	15.988,70	25,00	25,08	25,24	35,00
25-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	HSRE11	96,00	18,00	1.727,98	95,99	95,99	96,00	6,00
25-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	MAXR11	66,48	71,00	4.720,08	66,48	66,64	67,23	25,00
25-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	NEWU11	77,15	276,00	21.294,12	73,51	77,06	77,43	19,00
25-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	OULG11	31,33	6.755,00	211.611,81	31,01	31,34	32,00	124,00
25-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	PATC11	33,99	419,00	14.240,24	33,58	33,90	34,02	71,00
25-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	QAGR11	45,00	758,00	34.110,00	44,29	44,78	45,00	249,00
25-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	SARE11	3,88	1.575,00	6.111,00	3,85	3,91	3,97	4.668,00

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – OUTUBRO 2024

RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE OUTUBRO DE 2024 À 31 DE OUTUBRO 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
25-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	TRXF11	100,22	9.478,00	949.927,03	99,96	100,22	100,94	5.654,00
25-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	XPPR11	15,08	9.102,00	137.277,64	15,01	15,08	15,22	1.338,00
28-10-24	FIA RVA EMB II	Venda	DIRR3	30,65	16.700,00	511.857,52	30,33	30,64	31,05	6.562,00
28-10-24	FIA RVA EMB II	Compra	ITSA4	10,77	41.200,00	443.569,00	10,71	10,76	10,81	10.844,00
28-10-24	FIA RVA EMB II	Compra	RDR3	30,09	4.000,00	120.347,88	29,35	29,97	30,26	12.559,00
28-10-24	FIA RVA EMB II	Venda	SBFG3	14,14	12.900,00	182.427,00	14,02	14,14	14,27	4.155,00
28-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	22,20	900,00	19.976,32	21,90	22,18	22,31	11.296,00
28-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	7,52	14.300,00	107.556,67	7,31	7,49	7,61	12.959,00
28-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	26,24	500,00	13.118,64	26,19	26,31	26,55	23.688,00
28-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	33,29	400,00	13.315,52	32,70	33,23	33,42	11.449,00
28-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ3	8,73	300,00	2.619,32	8,68	8,72	8,79	7.149,00
28-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ3	8,71	6.900,00	60.099,00	8,68	8,72	8,79	7.149,00
28-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ6	9,79	3.400,00	33.286,00	9,75	9,79	9,86	12.987,00
28-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ6	9,80	6.000,00	58.828,92	9,75	9,79	9,86	12.987,00
28-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	38,34	800,00	30.670,23	38,06	38,30	38,46	9.056,00
28-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	13,49	1.200,00	16.186,93	13,29	13,43	13,63	10.771,00
28-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	42,96	500,00	21.482,08	42,66	43,00	43,53	8.033,00
28-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	31,72	1.300,00	41.234,09	31,62	31,81	32,13	15.489,00
28-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	15,22	800,00	12.179,40	15,11	15,20	15,27	5.165,00
28-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	3,71	9.900,00	36.755,65	3,64	3,69	3,73	29.482,00
28-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,77	2.400,00	25.847,31	10,71	10,76	10,81	10.844,00
28-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	9,50	11.500,00	109.262,30	9,27	9,46	9,60	17.719,00
28-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	14,17	800,00	11.335,42	14,06	14,17	14,35	11.635,00
28-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	40,73	600,00	24.435,77	40,25	40,72	41,12	29.084,00
28-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	19,79	1.700,00	33.643,88	19,43	19,72	19,86	38.527,00
28-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	16,80	800,00	13.440,24	16,65	16,81	16,94	5.250,00
28-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	16,83	1.700,00	28.609,36	16,65	16,81	16,94	5.250,00
28-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	42,66	900,00	38.391,39	42,32	42,63	42,89	18.232,00
28-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	21,61	900,00	19.449,61	21,44	21,64	21,80	5.490,00
28-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	59,65	3.700,00	220.703,20	59,03	59,65	60,67	23.816,00
28-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	59,31	600,00	35.585,48	59,03	59,65	60,67	23.816,00
28-10-24	FIA RVA EMB IV	Compra	PRI03	40,95	496,00	20.311,20	40,25	40,72	41,12	29.084,00
28-10-24	FIA RVA EMB IV	Compra	PRI03	40,83	1.816,00	74.151,76	40,25	40,72	41,12	29.084,00
28-10-24	FIA RVA EMB IV	Compra	PRI03	41,05	156,00	6.404,04	40,25	40,72	41,12	29.084,00
29-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	40,14	1.900,00	76.267,65	39,81	40,18	41,26	7.508,00
29-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	34,42	2.000,00	68.836,39	34,27	34,42	34,56	5.542,00
29-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	14,68	3.100,00	45.510,80	14,63	14,77	15,27	8.892,00
29-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	3,61	15.400,00	55.667,92	3,56	3,62	3,76	33.013,00
29-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	14,00	5.400,00	75.602,57	13,92	14,05	14,18	9.106,00
29-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	59,48	4.100,00	243.887,14	59,07	59,51	59,89	18.848,00
29-10-24	FIA RVA EMB IV	Compra	PRI03	40,25	1.529,00	61.548,99	39,91	40,33	41,39	28.965,00
29-10-24	FIA RVA EMB IV	Compra	PRI03	40,25	979,00	39.404,75	39,91	40,33	41,39	28.965,00
29-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	EVBI11	9,30	13.071,00	121.560,30	9,26	9,30	9,40	45,00
29-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	GZTI11	48,83	29.001,00	1.416.216,44	48,20	48,83	49,43	23.135,00
30-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	AZZA3	40,47	700,00	28.326,07	40,15	40,52	40,78	4.670,00
30-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	34,50	1.600,00	55.200,00	34,42	34,53	34,67	10.821,00
30-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	34,52	1.600,00	55.237,78	34,42	34,53	34,67	10.821,00
30-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	38,18	3.900,00	148.908,24	37,91	38,18	38,37	16.948,00
30-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	32,40	500,00	16.201,34	31,99	32,25	32,52	14.444,00
30-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	21,25	1.200,00	25.505,44	21,00	21,22	21,35	5.846,00
30-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	41,21	400,00	16.483,85	40,90	41,23	41,56	20.799,00
30-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	19,91	800,00	15.931,46	19,78	19,91	20,14	25.265,00
30-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	42,58	300,00	12.775,24	41,90	42,50	42,86	17.551,00
30-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	60,13	3.100,00	186.408,36	59,32	60,14	60,39	19.328,00
30-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	60,14	300,00	18.043,35	59,32	60,14	60,39	19.328,00
30-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	BMLC11	96,00	30,00	2.880,00	95,00	95,35	97,24	10,00
30-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	CBOP11	24,25	242,00	5.868,50	24,25	24,25	24,26	3,00
30-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	CEOC11	41,74	621,00	25.920,54	40,22	41,46	41,75	62,00
30-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	HSRE11	98,90	102,00	10.087,47	96,00	97,61	102,00	17,00
30-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	SARE11	3,88	1.001,00	3.883,88	3,88	3,92	3,96	1.122,00
30-10-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	XPIN11	73,05	215,00	15.705,00	72,52	73,19	74,05	589,00
31-10-24	FIA RVA EMB II	Venda	BBDC4	14,42	31.500,00	454.252,75	14,25	14,45	14,72	67.151,00
31-10-24	FIA RVA EMB II	Compra	VBBR3	22,40	22.400,00	501.780,68	22,20	22,45	22,67	13.040,00
31-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	41,12	900,00	37.005,51	40,34	41,10	41,55	5.177,00
31-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	BBDC4	14,47	15.000,00	217.083,13	14,25	14,45	14,72	67.151,00
31-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ3	8,75	10.600,00	92.750,00	8,69	8,72	8,81	9.042,00
31-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPLÉ6	9,86	9.400,00	92.684,00	9,79	9,82	9,91	10.801,00
31-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	17,15	5.400,00	92.611,85	17,01	17,11	17,28	8.297,00
31-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,60	6.900,00	73.112,64	10,55	10,60	10,72	21.829,00
31-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	13,77	4.600,00	63.326,64	13,65	13,75	14,02	12.402,00
31-10-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	13,76	8.800,00	121.060,58	13,65	13,75	14,02	12.402,00
31-10-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	60,27	1.800,00	108.488,24	59,58	60,01	60,88	20.457,00

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.