



# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO

Setembro/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 – SETEMBRO 2024



Data: 30/09/2024

## Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: **EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS**  
 CNPJ: **1067245000140**

Dados Gerais		Limite Fundo:		ENQUADRADO		0,00%		Dutacion DC:		2.237,18	
PL:	4.930.508.038,50	VAR / PL:	2,0294%	Status:		Dutacion DU:				1.539,06	
VAR:	100.058.764,80	ETL / PL:	2,5449%	Benchmark:							
ETL:	125.477.727,79	VAR / CDI:	0,0223%								

Cenários de STRESS											
Cenário Alta - 09999 (+):	137.796.022,96	Cenário Baixa - 10000 (+):	171.773.646,06	CENARIO BRADESCO 1 (+):	266.746.046,35	CENARIO BRADESCO 2 (+):	1.330.649.858,51				
Cenário Alta - 09999 (-):	-224.089.063,18	Cenário Baixa - 10000 (-):	-141.348.672,39	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-5.311.998,65	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-1.623.893.721,99				
Cenário Alta - 09999:	-86.293.040,22	Cenário Baixa - 10000:	30.424.973,68	CENARIO BRADESCO 1:	261.434.047,71	CENARIO BRADESCO 2:	-293.243.863,48				

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

Produto	MIM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
IDIF25P421800	-2.285,42	3.792,53	-2.951,92	0,00%	-5,51	6,87	-28,68	171.885.100,53
IDIF25P421900	3.163,66	5.377,32	4.185,44	0,00%	6,16	-7,88	28,85	-173.192.284,33
IDIF25P422300	16.734,75	26.571,42	20.681,87	0,02%	8,75	-11,58	36,37	-218.699.836,14
IDIF25P422400	-74.141,70	93.979,07	-73.148,62	-0,07%	-14,83	20,53	-53,64	323.083.783,21
IDIF25P422500	95.964,45	73.397,08	57.128,63	0,06%	5,58	-8,24	17,10	-103.167.412,68
IDU25P432500	2.314,39	3.971,82	2.075,47	0,00%	-4,53	7,43	-11,34	68.529.620,94
IDU25P432600	-6.409,08	10.692,11	-5.587,17	-0,01%	4,73	-9,47	9,13	-55.265.450,05
IDU25P432700	4.216,50	6.900,42	3.605,82	0,00%	1,71	-5,86	2,30	-13.945.280,17
IDIV24P410000	21,23	0,75	0,54	0,00%	951,86	-971,46	8.159,94	-4.918.195,72
IDIV24P410100	-21,23	0,80	-0,57	0,00%	-267.872,90	-36.525,32	97.223,64	-124.220,00
IDIV24P410200	-42,40	1,71	-1,22	0,00%	1.945.186,51	-1.945.186,51	1.425.821,71	-1.437.492,83
IDIV24P410300	20,73	0,90	0,64	0,00%	574.089,87	-573.701,83	461.974,74	-465.194,01
IDIV24P410400	12,25	0,57	0,41	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
IDIV24P410500	9,42	0,48	0,34	0,00%	143.715,00	-100.600,50	42.137,24	-42.482,15
IDIV24P410700	28,68	1,78	1,27	0,00%	-424.792,36	-52.855,98	155.640,94	-198.574,76
IDIV24P410800	-28,85	2,01	-1,44	0,00%	-472.675,27	-25.323,65	145.865,69	-194.727,73
IDIV24P410900	-36,37	2,91	-2,08	0,00%	110.789,95	-93.745,73	24.987,40	-25.191,93
IDIV24P411000	53,64	5,03	3,61	0,00%	-540.958,18	-24.509,42	250.200,09	-303.162,10
IDIV24P411100	-17,10	1,95	-1,40	0,00%	-912.947,84	-70.831,87	378.838,95	-475.210,88
IDIV24P411200	11,34	1,66	1,19	0,00%	1.707.008,83	-1.707.008,83	1.317.092,08	-1.327.873,19
IDIV24P411300	-9,13	1,91	-1,37	0,00%	4.224.205,58	-4.012.995,30	3.086.342,69	-3.121.687,92
IDIV24P411400	-2,30	0,68	-0,53	0,00%	-438.133,98	-45.201,35	176.051,13	-221.946,05
IDIV24P411600	-8.159,94	278,60	-199,63	0,00%	1.381.310,57	-1.381.310,57	578.571,80	-583.307,72
IGTI11	9.725.932,56	1.197.504,52	1.122.504,81	1,12%	-358.344,35	-59.732,01	122.902,45	-158.595,01
INDV24	-18.192,00	232.091,84	189.883,22	0,19%	25.337,20	-25.337,20	14.286,28	-14.403,22
INSSSN1	263.347,21	83.949,68	65.101,70	0,07%	217.266,45	-173.813,16	127.405,04	-128.447,92
INTB3	287.430,00	25.194,77	10.831,72	0,01%	-2.306,77	1.856,75	3.385,22	-4.872,64
IPIL11	4.480.119,21	83.024,02	77.537,99	0,08%	-2.011.530,23	-334.088,13	693.132,12	-893.923,57
IRBR12	11.589.117,68	91.162,31	-18.905,71	-0,02%	-447.872,74	-102.709,45	128.594,37	-169.093,63
IRBR3	170.446,08	71.729,99	23.081,70	0,02%	0,00	0,00	0,00	0,00
IRJS14	3.284.354,12	146.729,23	143.270,86	0,14%	0,00	0,00	0,00	0,00
ITPO14	7.093.562,07	226.525,01	217.165,45	0,22%	0,00	0,00	0,00	0,00
ITSA4	8.984.257,02	526.111,56	227.438,23	0,23%	0,00	0,00	0,00	0,00
ITUB4	21.121.027,88	1.581.525,64	1.140.401,15	1,14%	0,00	0,00	0,00	0,00
JALI15	3.290.110,15	112.848,23	107.701,43	0,11%	0,00	0,00	0,00	0,00
JBS3	3.946.801,62	779.180,45	680.107,72	0,68%	0,00	0,00	0,00	0,00
JSMILB5	3.239.330,39	68.351,89	65.715,96	0,07%	0,00	0,00	0,00	0,00
JSRE11	97.450,75	3.458,77	1.660,68	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
KLBN11	869.065,78	62.599,07	37.074,67	0,04%	0,00	0,00	0,00	0,00
LCAMC3	3.075.209,54	426,50	352,36	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LCAMD1	17.806.468,66	390.091,38	376.078,59	0,38%	-329.797,85	267.186,35	462.820,79	-647.367,37
LF001800FAU	4.739.835,43	77.659,55	36.916,15	0,04%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002100HDP	1.669.873,23	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002100HDQ	3.042.073,74	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002200U5M	10.958.564,46	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002200U5N	11.489.390,18	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306J15	11.393.418,44	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306U55	6.846.145,30	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306Z9P	5.839.097,58	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306ZK1	5.656.979,59	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024000XE	10.958.318,49	0,00	0,00	0,00%	321,65	-321,01	-855,19	1.303,06
LF0024000XG	10.938.650,28	0,00	0,00	0,00%	487,16	-486,19	-1.295,23	1.973,56
LF0024000XN	10.914.635,49	0,00	0,00	0,00%	371,23	-372,42	-948,44	1.445,31
LF0024002C7	6.649.346,70	79.196,01	70.830,78	0,07%	-5.717,27	4.564,40	8.177,49	-11.706,50
LF0024002SX	4.693.632,27	0,00	0,00	0,00%	-138.533,00	14.515,74	28.966,01	-39.224,12
LF0024002TZ	10.900.964,66	0,00	0,00	0,00%	-99.138,53	22.277,46	32.906,80	-44.322,46
LF00240033U	6.981.669,44	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024003QF	11.486.120,09	0,00	0,00	0,00%	-2.040,74	2.330,54	-0,24	0,36
LF0024006I2	11.531.553,79	0,00	0,00	0,00%	-84.743,14	109.042,59	-77,25	117,60
LF0024007F1	7.034.064,05	0,00	0,00	0,00%	-52.149,81	75.944,16	628,46	-956,75
LF0024008LF	6.922.210,11	0,00	0,00	0,00%	-54.131,15	82.048,97	553,60	-842,78
LF002400D4A	3.482.131,71	0,00	0,00	0,00%	-39.410,13	81.659,58	2.659,14	-4.046,56
LFSC190054B	989.200,48	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFSC190059S	1.484.576,09	0,00	0,00	0,00%	-863,08	1.078,81	77,42	-117,78
LFSC19005L1	982.127,99	0,00	0,00	0,00%	-35.757,74	107.863,88	6.895,67	-10.477,76
LFSC200202X	4.491.902,32	1.094,64	906,23	0,00%	-597,21	1.406,22	94,47	-143,46
LFSC210029N	4.792.990,35	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFSC2301ERT	4.657.100,45	0,00	0,00	0,00%	-1.252,17	1.019,99	1.779,76	-2.483,52
LFT20250301 - 210100	2.187.074,66	585,38	482,62	0,00%	-964,56	781,90	1.524,43	-2.244,67
LFT20250901 - 210100	32.929.623,23	11.942,48	10.250,85	0,01%	-705.033,57	-92.126,32	257.135,98	-331.432,44
LFT20260301 - 210100	13.335.613,33	2.731,24	1.642,89	0,00%	398.439,53	-398.450,56	292.064,26	-294.454,96
LFT20260901 - 210100	10.147.706,83	3.593,72	2.274,29	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20270301 - 210100	7.166.901,38	1.959,06	297,92	0,00%	-956.780,31	735.005,85	1.340.638,00	-1.911.134,58
LFT20270901 - 210100	138.314,57	55,08	-30,84	0,00%	175.263,61	-175.284,57	64.237,95	-64.763,78
LFT20290301 - 210100	4.408.747,05	2.255,02	-1.862,67	0,00%	1.454.903,45	-1.454.903,45	820.341,72	-827.056,65
LFT20300301 - 210100	45.835,50	35,33	-23,66	0,00%	-7.580,91	6.328,07	10.962,46	-14.862,79
LIGHB4	4.255.906,26	0,00	0,00	0,00%	198.739,73	-198.754,89	97.117,48	-97.912,44
LIGHD3	1.024.535,67	288,57	258,96	0,00%	1.201.148,70	-1.201.148,70	352.176,80	-355.059,56
LIMPT7	2.697.581,08	138,25	97,87	0,00%	346.159,63	-299.561,22	97.590,39	-98.389,22
LORTA7	6.362.455,07	143.948,16	139.242,86	0,14%	-3.380,00	2.784,68	4.860,23	-6.719,87
LRN3	1.992.252,78	286.555,11	119.714,40	0,12%	-954.182,89	-158.925,68	327.595,01	-422.680,73
LRN81	677.858,75	0,00	0,00	0,00%	763.905,47	-572.929,10	279.971,36	-282.263,07
LTN20260701 - 100000	25.037.101,83	198.959,82	167.859,19	0,17%	24.660,89	-24.662,02	12.050,95	-12.149,60
LWSA3	438.185,23	71.721,23	66.102,77	0,07%	-875.956,21	-156.469,42	280.601,58	-364.746,75
MALL11	5.995.782,50	317.254,11	203.361,89	0,20%	1.583.977,28	-1.319.981,06	774.036,90	-780.372,80
MANT12	2.608.953,17	1.911,47	1.786,81	0,00%	-698.746,65	-185.939,05	185.867,01	-244.532,12
				0,00%	3.238.262,40	-3.238.262,40	949.458,54	-957.230,37



# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2024



## Relatório de Risco de Mercado



Data: 30/09/2024

FUNDO: EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS  
CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais		Limite Fundo:		ENQUADRADO		0,00%		Dutacion DC:		2.237,18	
PL:	4.930.508.038,50	VAR / PL:	2,0294%	Status:		Dutacion DU:					1.539,06
VAR:	100.058.764,80	ETL / PL:	2,5449%	Benchmark:							
ETL:	125.477.727,79	VAR / CDI:	0,0223%								

Cenários de STRESS											
Cenário Alta - 09999 (+):	137.796.022,96	Cenário Baixa - 10000 (+):	171.773.646,06	CENARIO BRADESCO 1 (+):	266.746.046,35	CENARIO BRADESCO 2 (+):	1.330.649.858,51				
Cenário Alta - 09999 (-):	-224.089.063,18	Cenário Baixa - 10000 (-):	-141.348.672,39	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-5.311.998,65	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-1.623.893.721,99				
Cenário Alta - 09999:	-86.293.040,22	Cenário Baixa - 10000:	30.424.973,68	CENARIO BRADESCO 1:	261.434.047,71	CENARIO BRADESCO 2:	-293.243.863,48				

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
VECS11	3.522.305,93	14,02	9,89	0,00%	-91,89	85,65	191,38	-287,60
VERDECS2	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
VERO12	5.787.348,35	68.066,02	50.044,26	0,05%	-499.651,15	-106.557,26	147.250,72	-193.030,61
VIMT13	8.182.458,63	228.721,71	218.676,84	0,22%	-958.345,60	-84.016,22	387.850,31	-488.156,24
VIVA3	154.335,83	12.892,06	9.592,20	0,01%	46.300,75	-46.300,75	22.625,63	-22.810,84
VIVT3	2.853.295,12	94.742,32	5.924,51	0,01%	427.994,27	-427.999,38	418.293,07	-421.717,02
VIXL18	2.359.585,64	1.661,87	1.549,87	0,00%	-6.579,21	5.475,57	9.497,46	-12.935,56
VRDN12	4.755.491,70	107.993,03	101.758,29	0,10%	-518.704,05	-70.077,31	190.687,70	-243.033,95
VVMR11	3.885.006,45	187.775,51	137.321,38	0,14%	0,00	0,00	569.541,95	-574.203,95
VVRT11	2.565.829,24	205,47	174,04	0,00%	-1.111,99	902,71	1.660,40	-2.386,38
WDOX24	-6.197,16	123.776,74	-34.379,71	-0,03%	-249.242,73	253.309,16	-323.512,14	325.266,93
WEGE3	5.632.845,96	644.189,94	581.197,34	0,58%	1.415.978,79	-1.403.551,11	825.775,22	-832.534,63
WINV24	5.002,80	63.825,26	-52.217,89	-0,05%	-157.874,72	157.768,00	-127.043,05	127.928,35
XPIN11	2.751.233,82	152.413,32	125.509,71	0,13%	1.375.616,91	-1.375.616,91	403.330,88	-406.632,36
XPPR11	2.165.682,74	179.546,45	107.545,84	0,11%	1.082.841,37	-1.082.841,37	317.489,09	-320.087,91
YDUQ3	1.465.805,00	173.600,99	-50.926,07	-0,05%	571.663,95	-366.451,25	214.887,01	-216.645,98
<b>Total Var:</b>	<b>3.297.883.963,38</b>	<b>129.000.077,11</b>	<b>100.058.764,80</b>	<b>100,01%</b>	<b>-86.293.040,22</b>	<b>30.424.973,68</b>	<b>261.434.047,71</b>	<b>-293.243.863,48</b>

## Relatório de Risco de Mercado



Data: 30/09/2024

FUNDO: EMBRAERPREV RENDA FIXA  
CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais		Limite Fundo:		ENQUADRADO		0,00%		Dutacion DC:		1.696,42	
PL:	4.237.099.656,28	VAR / PL:	1,7678%	Status:		Dutacion DU:					1.167,11
VAR:	74.902.541,25	ETL / PL:	2,2169%	Benchmark:							
ETL:	93.930.808,57	VAR / CDI:	0,0194%								

Cenários de STRESS											
Cenário Alta - 09999 (+):	0,00	Cenário Baixa - 10000 (+):	161.144.926,23	CENARIO BRADESCO 1 (+):	196.979.961,09	CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00				
Cenário Alta - 09999 (-):	-216.866.988,57	Cenário Baixa - 10000 (-):	-3.483.583,84	CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-222.260.358,65				
Cenário Alta - 09999:	-216.866.988,57	Cenário Baixa - 10000:	157.661.342,39	CENARIO BRADESCO 1:	196.979.961,09	CENARIO BRADESCO 2:	-222.260.358,65				

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	3.356.737.745,65	66.983.612,90	66.906.922,39	89,33%	-172.306.434,37	154.162.193,99	175.674.544,63	-196.556.041,80
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	117.889.493,55	618.490,92	443.767,51	0,59%	-4.715.690,03	-408.564,30	1.496.474,68	-1.973.394,66
FIM EMB II A	242.248.389,03	350.258,23	239.524,50	0,32%	-1.511.434,07	1.623.100,93	1.036.447,11	-1.333.260,23
FIM EMB VI A CRED PRIV	246.941.614,80	2.478.730,41	2.244.739,96	3,00%	-11.976.770,24	5.359.631,31	8.780.914,00	-9.755.891,31
FIM EMB VII A CRED PRIV	317.734.891,71	5.444.184,32	5.067.586,89	6,77%	-26.356.659,86	-3.075.019,55	9.991.580,68	-12.641.770,65
<b>Total Var:</b>	<b>4.281.552.134,73</b>	<b>75.875.276,78</b>	<b>74.902.541,25</b>	<b>100,01%</b>	<b>-216.866.988,57</b>	<b>157.661.342,39</b>	<b>196.979.961,09</b>	<b>-222.260.358,64</b>

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2024

## Relatório de Risco de Mercado



Data: 30/09/2024

EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL									
CNPJ: 10679245000140									
Dados Gerais									
PL:	522.927.047,19	VAR / PL:	7,3742%	Limite Fundo:	0,00%	Duration DC:	1,58		
VAR:	38.561.826,76	ETL / PL:	9,2476%	Status:	ENQUADRADO	Duration DU:	1,40		
ETL:	48.358.086,48	VAR / CDI:	0,0809%	Benchmark:					
Cenários de STRESS									
Cenário Alta - 09999 (+):	118.587.551,76	Cenário Baixa - 10000 (+):	0,00	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	65.773.191,12	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	0,00		
Cenário Alta - 09999 (-):	0,00	Cenário Baixa - 10000 (-):	-113.055.980,54	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	-66.316.369,35		
Cenário Alta - 09999:	118.587.551,76	Cenário Baixa - 10000:	-113.055.980,54	CENÁRIO BRADESCO 1:	65.773.191,12	CENÁRIO BRADESCO 2:	-66.316.369,35		
Parâmetros do Cálculo									
Modelo:	Modelo paramétrico	Modelo Volatilidade:	EWMA						
Int. Confiança:	95	Lambda:	0,94						
Horizonte:	21								
Produto	MtM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2	
CAIXA	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
FIA RVA EMB II	96.820.877,12	6.647.331,53	6.576.937,43	17,06%	24.574.176,66	-24.423.722,46	13.920.277,97	-14.034.257,39	
FIA RVA EMB III	110.400.623,44	8.643.504,53	8.347.496,35	21,65%	27.727.244,05	-25.312.426,29	13.598.029,07	-13.714.035,91	
FIA RVA EMB IV	103.957.226,73	8.979.428,82	8.819.961,29	22,87%	27.573.451,86	-24.359.266,43	14.087.100,82	-14.202.818,66	
FIC FIA EMB VIII ETF	90.626.968,24	6.607.350,68	6.525.974,09	16,92%	8.132.102,69	-8.132.136,22	6.623.185,22	-6.677.404,59	
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	121.120.829,92	8.422.969,92	8.291.457,61	21,50%	30.580.576,50	-30.828.429,14	17.544.598,05	-17.687.852,81	
Total Var:	522.926.525,45	39.300.585,47	38.561.826,76	100,00%	118.587.551,76	-113.055.980,54	65.773.191,12	-66.316.369,35	

## Relatório de Risco de Mercado



Data: 30/09/2024

FI RF EMB II									
CNPJ: 11005764000196									
Dados Gerais									
PL:	3.339.420.096,60	VAR / PL:	2,9058%	Limite Fundo:	0,00%	Duration DC:	1,885	88	
VAR:	66.983.682,74	ETL / PL:	2,5154%	Status:	ENQUADRADO	Duration DU:	1,297	38	
ETL:	84.000.240,52	VAR / CDI:	0,022%	Benchmark:					
Cenários de STRESS									
Cenário Alta - 09999 (+):	0,00	Cenário Baixa - 10000 (+):	154.973.788,14	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	175.674.727,79	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	0,00		
Cenário Alta - 09999 (-):	-172.306.614,01	Cenário Baixa - 10000 (-):	-811.433,42	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	-196.556.246,73		
Cenário Alta - 09999:	-172.306.614,01	Cenário Baixa - 10000:	154.162.354,71	CENÁRIO BRADESCO 1:	175.674.727,79	CENÁRIO BRADESCO 2:	-196.556.246,73		
Parâmetros do Cálculo									
Modelo:	Modelo paramétrico	Modelo Volatilidade:	EWMA						
Int. Confiança:	95	Lambda:	0,94						
Horizonte:	21								
Produto	MtM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2	
CSMGC3	5.568.131,63	11.396,03	-2.127,24	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
ELET42	14.890.066,52	175.147,54	103.214,86	0,15%	0,00	0,00	0,00	0,00	
ENTV12	14.110.605,17	186.289,21	150.299,85	0,22%	0,00	0,00	0,00	0,00	
GASP17	51.252.903,55	809.964,12	784.044,28	1,17%	-41.399,11	42.223,90	148.812,77	-226.504,23	
IGSN15	2.589.986,64	54.200,37	49.037,29	0,07%	0,00	0,00	0,00	0,00	
NEOF16	7.516.112,06	94.901,01	60.182,92	0,09%	-83.545,85	1.425,50	18.419,20	-24.980,83	
NTNB20260815 - 760199_VENCIMENTO	42.964.031,57	173.456,61	28.092,44	0,04%	0,00	0,00	0,00	0,00	
NTNB20300815 - 760199_VENCIMENTO	26.197.986,01	526.140,18	518.746,71	0,77%	-1.311.786,31	-342.324,30	349.844,47	-460.606,23	
NTNB20350515 - 760199_VENCIMENTO	235.876.009,43	7.697.494,78	7.682.182,09	11,47%	-1.256.625,61	-239.124,79	394.865,10	-514.850,79	
NTNB20400815 - 760199_VENCIMENTO	28.777.281,69	1.077.620,40	1.076.811,25	1,61%	-1.149.859,57	1.312.504,54	1.012.452,25	-1.337.712,79	
NTNB20450515 - 760199_VENCIMENTO	222.182.503,48	8.865.970,01	8.846.217,87	13,21%	-267.872,90	-36.525,32	97.223,64	-124.220,00	
NTNB20500815 - 760199_VENCIMENTO	688.860.715,45	30.541.212,57	30.528.501,12	45,58%	-698.746,65	-185.939,05	185.867,01	-244.532,12	
NTNB20550515 - 760199_VENCIMENTO	219.773.099,56	10.191.858,95	10.187.203,25	15,21%	-902.399,50	903.538,67	767.657,30	-1.019.539,57	
SBSPC2	5.075.360,35	11.779,15	-2.159,10	0,00%	-1.412.368,64	1.204.192,38	1.266.890,76	-1.617.113,38	
BBTOPIMA	81.768.867,03	490.427,76	428.448,61	0,64%	-18.346.557,93	16.884.473,17	18.096.230,14	-22.117.394,50	
BBTOPIND	261.246.282,88	6.563.934,26	6.537.595,57	9,76%	-2.988.946,80	2.644.749,48	2.944.180,89	-3.455.227,92	
CAIXA	5.000,00	0,00	0,00	0,00%	-25.890.899,21	26.229.250,50	-29.766.365,25		
COMPROMISSADA PRE	1.448.186.390,34	12.111,53	7.390,97	0,01%	-88.263.148,36	81.914.640,25	92.830.808,46	-102.013.120,16	
CONTAS_A PAGAR_RECEBER	-100.088,07	0,00	0,00	0,00%	-29.627.352,64	26.920.270,27	31.322.213,25	-33.620.643,50	
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%	-65.104,92	-7.519,96	10.012,05	-13.555,46	
Total Var:	3.356.741.245,30	67.483.904,48	66.983.682,74	100,00%	-172.306.614,01	154.162.354,72	175.674.727,79	-196.556.246,73	



# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2024



bradesco

Data: 30/09/2024

## Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FI RF EMB V CREDITO PRIVADO  
CNPJ: 20726178000121

Dados Gerais							
PL:	115.706.775,64	VAR / PL:	0,5345%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	623,73
VAR:	618.490,92	ETL / PL:	0,6703%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	429,28
ETL:	775.612,56	VAR / CDI:	0,0059%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	0,00	Cenário Baixa - 10000 (+):	326.117,58	CENARIO BRADESCO 1 (+):	1.496.474,68	CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00
Cenário Alta - 09999 (-):	-4.715.690,03	Cenário Baixa - 10000 (-):	-734.681,87	CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-1.973.394,66
Cenário Alta - 09999:	-4.715.690,03	Cenário Baixa - 10000:	-408.564,30	CENARIO BRADESCO 1:	1.496.474,68	CENARIO BRADESCO 2:	-1.973.394,66

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

Produto	MtM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
17H0164854	6.409.633,56	37.095,65	20.827,02	3,37%	-249.758,49	-24.758,90	73.590,90	-98.069,84
AEGP23	7.494.941,71	17.473,22	8.070,89	1,30%	-156.237,32	10.233,65	40.836,12	-55.063,01
CCRDD1	3.295.781,69	8.250,57	-3.567,72	-0,58%	0,00	0,00	0,00	0,00
CMDT33	732.963,98	1.701,10	334,21	0,05%	-17.150,19	-4.028,31	2.122,34	-2.877,97
ENJG21	1.431.633,54	7.896,60	3.570,01	0,58%	-9.402,20	-1.086,00	1.445,90	-1.957,63
ENM21	933.527,56	5.286,76	2.424,06	0,39%	-24,74	25,24	88,94	-135,38
ENTV12	18.549.566,37	244.892,69	235.897,50	38,14%	0,00	0,00	0,00	0,00
ERDV17_VENCIMENTO	6.559.789,40	14.223,90	6.841,21	1,11%	0,00	0,00	0,00	0,00
ERDV36	2.260.574,64	5.659,06	-2.447,10	-0,40%	-52.164,13	-5.673,63	14.826,58	-19.778,95
GASP17	10.604.049,01	167.578,78	119.612,50	19,34%	-34.815,98	-3.771,69	9.933,03	-13.249,74
GRRB24_VENCIMENTO	16.299.139,60	212.109,15	200.057,24	32,35%	-1.651.939,09	-314.349,46	519.083,08	-676.814,26
LFSN16000GM	15.851.596,77	36.473,33	511,90	0,08%	-129.901,60	2.775,20	29.860,71	-40.306,31
LFSN1800DC5	5.154.260,12	14.692,64	6.292,18	1,02%	-11.763,30	-2.763,02	1.455,71	-1.974,00
OMGE31	13.092.356,39	76.113,35	20.586,71	3,33%	-237.901,98	271.552,66	209.472,88	-276.768,16
SBSPC2	3.889.556,15	9.027,08	1.773,50	0,29%	-1.479.481,33	-369.264,31	405.246,49	-533.180,76
TAE33	4.485.164,69	5.921,25	-2.297,51	-0,37%	-138.533,00	14.515,74	28.966,01	-39.224,12
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	-99.138,53	22.277,46	32.906,80	-44.322,46
COMPROMISSADA_PRE	865.561,21	7,24	4,32	0,00%	-388.498,99	4.737,63	118.627,42	-158.823,78
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-21.602,86	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-49.893,84	-5.763,00	7.672,84	-10.388,37
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-9.085,33	-3.223,54	338,93	-459,92
<b>Total Var:</b>	<b>117.889.493,53</b>	<b>864.402,37</b>	<b>618.490,92</b>	<b>100,00%</b>	<b>-4.715.690,03</b>	<b>-408.564,29</b>	<b>1.496.474,68</b>	<b>-1.973.394,66</b>

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2024



Data: 30/09/2024

## Relatório de Risco de Mercado

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

Dados Gerais		Limite Fundo:		ENQUADRADO		0,00% Duração DC:		975,73	
PL:	250.887.005,89	VAR / PL:	1,0648%	Status:		Duração DU:			671,56
VAR:	2.671.433,40	ETL / PL:	1,3353%	Benchmark:					
ETL:	3.350.085,26	VAR / CDI:	0,0117%						

Cenários de STRESS										
Cenário Alta - 09999 (+):	586.259,60	Cenário Baixa - 10000 (+):	7.436.190,49	CENARIO BRADESCO 1 (+):	10.100.349,97	CENARIO BRADESCO 2 (+):	199.670.559,83			
Cenário Alta - 09999 (-):	-13.494.135,31	Cenário Baixa - 10000 (-):	-1.659.887,41	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-636.784,73	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-210.184.899,67			
Cenário Alta - 09999:	-12.907.875,71	Cenário Baixa - 10000:	5.776.303,08	CENARIO BRADESCO 1:	9.463.565,23	CENARIO BRADESCO 2:	-10.514.339,83			

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	644.400,06	58.306,91	3.484,80	0,13%	0,00	0,00	0,00	0,00
AEPA1	1.849.870,84	1.093,44	1.011,74	0,04%	-4.622,55	3.806,94	6.654,82	-9.208,88
APRB28	1.033.325,18	36,91	34,35	0,00%	-205,54	166,50	310,11	-448,28
ARTR1	2.536.128,20	120,09	111,05	0,00%	-716,95	578,44	1.074,04	-1.558,67
BARU11	1.564.194,71	77.039,72	70.349,02	2,63%	-277.641,50	-14.263,31	127.781,79	-155.117,29
BCBF15	2.053.635,64	17,25	13,25	0,00%	-130,40	111,62	234,88	-351,01
BKBR18	2.632.932,85	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
BRKPA0	2.931.205,21	519,59	480,31	0,02%	-2.810,24	2.262,01	4.124,08	-5.936,15
CAEC11	1.868.046,35	25,29	20,97	0,00%	-194,53	160,90	315,93	-468,66
CAIXA	10.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CART13	976.525,14	22.588,87	20.995,26	0,79%	-106.983,97	-13.486,63	39.937,29	-50.828,28
CBAN22	5.801.645,50	41.248,47	36.306,02	1,36%	-127.411,24	107.098,38	172.151,69	-226.115,01
CEAB13	1.520.967,51	276,38	256,36	0,01%	-1.401,53	1.132,35	2.055,44	-2.942,30
CELG12	1.557.714,45	8,01	6,70	0,00%	-60,26	50,69	103,09	-153,26
CGBP13	2.598.995,85	852,51	790,49	0,03%	-3.675,49	3.025,34	5.304,87	-7.358,88
CL112	2.574.016,23	3.470,57	3.181,63	0,12%	-13.122,73	11.065,63	19.041,39	-25.385,24
COMPROMISSADA_PRE	45.033.544,16	376,63	259,22	0,01%	-1.287,37	1.313,02	4.627,56	-7.043,49
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-80.773,34	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CRTR12	2.912.951,49	117.277,75	107.152,21	4,01%	-437.359,58	-21.510,12	197.337,67	-241.534,33
CSAN23	1.105.043,84	1.211,64	1.107,86	0,04%	-4.484,42	3.790,03	6.507,35	-8.643,44
CSMG88	2.773.680,51	33.032,27	29.206,14	1,09%	-239.963,67	-49.117,77	72.164,45	-94.492,40
DAPK25	-7.216,77	69.081,84	-33.429,68	-1,25%	-218.313,77	195.265,90	128.455,53	-128.510,69
DAPK27	-90.087,82	329.584,13	300.335,25	11,24%	-1.472.168,19	1.283.455,41	1.389.251,09	-1.358.528,06
DAPK29	-25.478,84	179.355,29	174.895,13	6,55%	-510.072,12	442.232,72	522.486,04	-499.665,72
DAPK35	5.847,71	48.355,34	-43.140,84	-1,61%	103.979,26	-94.038,72	-117.799,29	105.561,81
DAPQ26	-62.067,75	227.184,20	122.915,22	4,60%	-1.082.427,41	967.264,50	990.431,56	-976.274,49
DAPQ28	-87.926,21	670.158,88	665.046,35	24,89%	-2.181.196,56	1.927.110,43	2.198.267,10	-2.119.511,64
DAPQ30	3.349,84	80.969,11	-76.430,50	-2,86%	202.400,35	-176.173,08	-212.347,05	200.489,32
DAPQ32	7.286,04	121.929,42	-111.487,82	-4,17%	276.411,46	-243.816,84	-300.301,52	277.245,62
DASAA2	1.338.866,80	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DASAC5	2.017.791,50	3.052,42	2.773,02	0,10%	-10.808,03	9.257,14	15.816,32	-20.543,72
DESK13	2.742.109,88	623,88	580,96	0,02%	-2.910,84	2.378,31	4.251,58	-5.993,43
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DIFP27	-12.136,06	105.917,46	96.563,15	3,61%	-454.688,79	345.928,99	618.160,09	-865.033,08
DIFP28	-4.525,32	42.355,91	38.417,57	1,44%	-156.360,33	125.139,77	216.031,52	-291.162,00
DIH29	-1.910,57	17.314,31	15.588,78	0,58%	-58.185,20	47.813,64	82.361,51	-106.939,82
DHN26	-8.128,37	75.815,73	69.100,01	2,59%	-367.332,68	277.440,70	510.363,97	-727.610,69
ELT24	2.639.904,74	741,74	687,73	0,03%	-3.359,41	2.740,47	4.832,70	-6.784,87
GUAR15	1.025.840,30	88,39	82,11	0,00%	-505,68	408,90	764,32	-1.106,78
HAPV22	588.942,88	244,99	226,37	0,01%	-1.032,27	849,44	1.484,31	-2.055,80
HZTC14	2.467.820,34	55.274,42	51.233,75	1,92%	-259.361,55	-29.340,94	98.575,71	-125.275,37
IDIF25P421800	-2.285,42	3.792,53	-2.905,52	-0,11%	2.285,42	-456.172,47	2.285,42	-55.993.241,77
IDIF25P421900	3.163,66	5.377,32	4.119,65	0,15%	-3.163,66	541.751,91	-3.163,66	56.088.558,79
IDIV24P410000	2,73	0,10	0,07	0,00%	-0,31	0,36	-2,73	16.170.454,46
IDIV24P410100	-2,73	0,10	-0,07	0,00%	0,33	-0,38	2,73	-16.197.739,23
IDIV24P410200	-21,29	0,86	-0,59	0,00%	2,75	-3,20	21,29	-126.531.414,28
IDIV24P410300	13,36	0,58	0,40	0,00%	-1,84	2,17	-13,36	79.535.108,13
IDIV24P410400	7,93	0,37	0,26	0,00%	-1,18	1,40	-7,93	47.288.343,15
INSSSN1	263.347,21	83.949,68	62.662,43	2,35%	0,00	0,00	0,00	0,00
IRJ514	3.284.354,12	146.729,23	134.218,35	5,02%	-540.958,18	-24.509,42	250.200,09	-303.162,10
JSM185	3.239.330,39	68.351,89	64.690,45	2,42%	-358.344,35	-59.732,01	122.902,45	-158.595,01
LCAMD1	7.431.185,62	162.797,10	153.797,14	5,76%	-839.473,27	-139.425,23	289.265,30	-373.061,73
LF001000FAU	4.759.835,43	77.659,55	52.964,51	1,08%	-447.872,74	-102.709,45	128.594,37	-169.093,63
LF002306ZBP	5.639.097,58	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306ZK1	5.656.979,95	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFSC190054B	980.200,48	0,00	0,00	0,00%	321,65	-321,01	-855,19	1.303,06
LFSC190059S	1.484.576,09	0,00	0,00	0,00%	487,16	-486,19	-1.295,23	1.973,56
LFSC19005L1	982.127,99	0,00	0,00	0,00%	371,23	-372,42	-948,44	1.445,31
LFSC22002IX	4.491.902,32	1.094,64	1.004,28	0,04%	-5.717,27	4.564,40	8.177,49	-11.706,50
LFSN210029N	4.792.990,35	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFSN2301ERT	4.657.100,45	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20250901 - 210100	21.455.081,93	7.781,04	5.334,22	0,20%	-55.213,84	71.045,99	-50,33	76,62
LIGHB4	4.255.906,26	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LIGHD3	1.024.535,67	288,57	265,95	0,01%	-1.252,17	1.019,99	1.779,76	-2.483,52
LMTP17	2.697.581,08	138,25	123,36	0,00%	-964,56	781,90	1.524,43	-2.244,67
LRENB1	677.858,75	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
MANT12	2.608.953,17	1.911,47	1.761,52	0,07%	-7.580,91	6.328,07	10.962,46	-14.862,79
MOV127	1.136.711,31	800,87	740,92	0,03%	-3.380,00	2.784,68	4.860,23	-6.719,87
MTRJ19	2.722.225,90	35.517,26	33.456,70	1,25%	-232.224,65	-41.481,59	74.390,25	-96.897,97
NTEN11	3.169.572,06	27.936,97	23.843,17	0,89%	-219.620,82	-42.831,76	64.754,14	-85.010,47
NTNB20250515 - 760199 NEGOCIACAO	620.736,15	1.693,79	-793,15	-0,03%	-5.709,27	5.342,82	3.022,89	-4.078,37
NTNB20260815 - 760199 NEGOCIACAO	21.280.084,84	85.913,06	39.647,88	1,48%	-446.958,47	447.522,71	380.220,66	-504.977,95
NTNB20270515 - 760199 NEGOCIACAO	5.067.537,41	30.226,98	27.585,42	1,03%	-137.264,74	133.411,52	119.954,49	-158.091,33
NTNB20280815 - 760199 NEGOCIACAO	8.107.521,56	90.365,38	89.675,93	3,36%	-295.132,71	303.137,01	280.622,47	-364.849,03
NTNB202500815 - 760199 NEGOCIACAO	868.238,86	38.494,09	33.798,64	1,27%	-111.246,72	103.245,07	117.003,79	-128.577,16
NTSD36	2.837.708,51	4.946,61	4.464,23	0,17%	-16.935,16	14.725,31	25.121,97	-31.701,95
OMGE13	3.084.508,53	1.124,69	1.042,68	0,04%	-4.895,64	4.017,50	7.048,73	-9.807,10
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
OVSAT10	1.807.784,31	57,47	52,41	0,00%	-391,17	322,22	637,19	-938,94
OVSAA8	687.447,44	487,00	449,68	0,02%	-2.024,63	1.669,44	2.916,02	-4.029,38
RAHD11	3.497.853,49	106.241,44	97.719,94	3,66%	-428.294,68	-26.714,28	184.544,99	-228.251,24
RBCAPMZ	494.085,59	6.065,73	285,55	0,01%	0,00	0,00	0,00	0,00
RDCO10	3.786.520,89	190,29	175,94	0,01%	-1.173,15	953,76	1.821,17	-2.657,81

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2024



Data: 30/09/2024

## Relatório de Risco de Mercado

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

Dados Gerais								
PL:	250.887.005,89	VAR / PL:	1,0648%	Limite Fundo:		0,00%	Dutacion DC:	975,73
VAR:	2.671.433,40	ETL / PL:	1,3353%	Status:	ENQUADRADO		Dutacion DU:	671,56
ETL:	3.350.085,26	VAR / CDI:	0,0117%	Benchmark:				

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	586.259,60	Cenário Baixa - 10000 (+):	7.436.190,49	CENARIO BRADESCO 1 (+):	10.100.349,97	CENARIO BRADESCO 2 (+):	199.670.559,83
Cenário Alta - 09999 (-):	-13.494.135,31	Cenário Baixa - 10000 (-):	-1.659.887,41	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-636.784,73	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-210.184.899,67
Cenário Alta - 09999:	-12.907.875,71	Cenário Baixa - 10000:	5.776.303,08	CENARIO BRADESCO 1:	9.463.565,23	CENARIO BRADESCO 2:	-10.514.339,83

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
RDORB9	1.095.999,13	1.152,14	1.053,42	0,04%	-4.262,71	3.603,18	6.185,42	-8.213,57
RDORC9	1.567.278,75	1.647,57	1.506,39	0,06%	-6.095,67	5.152,55	8.845,15	-11.745,40
RIS412	2.754.767,92	70.703,46	65.630,30	2,46%	-328.959,83	-49.208,24	119.224,00	-152.212,36
RODB11	2.890.456,53	4.182,85	3.844,52	0,14%	-16.191,44	13.539,98	23.403,07	-31.635,81
RSAN24	1.815.955,01	27,06	22,69	0,00%	-203,59	167,97	332,07	-492,26
SNGO18	977.580,45	10,14	8,41	0,00%	-76,82	65,75	136,60	-203,64
TBSP11	2.498.437,83	418,09	389,95	0,01%	-2.062,15	1.678,56	3.027,61	-4.304,11
UNEG11	4.566.428,70	180.747,30	163.737,03	6,13%	-647.847,23	-16.717,45	298.154,31	-367.035,42
VAMO33	2.836.116,60	57.070,22	54.310,17	2,03%	-312.802,88	-57.454,91	103.991,70	-134.402,45
VCCS11	720.065,95	315,12	290,15	0,01%	-1.256,01	1.042,21	1.806,24	-2.469,56
VECS11	3.522.305,93	14,02	11,03	0,00%	-91,89	85,65	191,38	-287,60
VERDECS2	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
VIXL18	2.359.585,64	1.661,87	1.530,00	0,06%	-6.579,21	5.475,57	9.497,46	-12.935,56
VVRT11	2.565.829,24	205,47	192,01	0,01%	-1.111,99	902,71	1.660,40	-2.386,38
<b>Total Var:</b>	<b>266.139.502,34</b>	<b>3.693.639,76</b>	<b>2.671.433,40</b>	<b>100,00%</b>	<b>-12.907.875,71</b>	<b>5.776.303,08</b>	<b>9.463.565,23</b>	<b>-10.514.339,83</b>

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2024

## Relatório de Risco de Mercado



Data: 30/09/2024

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

Dados Gerais		Limite Fundo:		ENQUADRADO		0,00% Dutation DC:		1.445,84	
PL:	303.058.757,44	VAR / PL:	1,9105%	Status:		Dutation DC:			994,62
VAR:	5.789.966,77	ETL / PL:	2,3959%	Benchmark:		Dutation DU:			
ETL:	7.260.851,92	VAR / CDI:	0,021%						

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	1.496,49	Cenário Baixa - 10000 (+):	18.783,80	CENARIO BRADESCO 1 (+):	10.626.186,90	CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00
Cenário Alta - 09999 (-):	-28.032.175,79	Cenário Baixa - 10000 (-):	-3.289.110,44	CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-13.444.701,29
Cenário Alta - 09999:	-28.030.679,30	Cenário Baixa - 10000:	-3.270.326,64	CENARIO BRADESCO 1:	10.626.186,90	CENARIO BRADESCO 2:	-13.444.701,29

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
ANEM11	9.468.670,44	5.550,54	-1.508,32	-0,03%	1.496,49	-2.619,40	570,69	-774,36
APPSA2	2.603.692,61	50.005,58	49.544,40	0,86%	-280.881,71	-50.271,49	93.507,01	-120.998,24
ASAB11	2.998.537,91	52.826,14	52.564,51	0,91%	-295.234,19	-55.847,96	96.690,91	-124.521,75
ASER12	2.790.864,77	128.117,61	126.483,02	2,18%	-465.985,54	-18.592,48	218.286,60	-263.574,24
BARU11	2.440.143,76	120.181,96	118.563,73	2,05%	-433.120,74	-22.250,77	199.339,59	-241.982,98
BRKP28	6.348.675,71	216.429,27	214.423,09	3,70%	-879.678,33	-121.467,83	334.782,51	-423.656,52
CAEC21	9.032.442,56	95.313,06	58.525,50	1,01%	-702.972,56	-155.381,53	197.533,92	-260.675,09
CAIXA	999,99	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CART13	6.391.800,89	147.854,42	147.803,85	2,55%	-700.258,71	-88.276,13	261.407,71	-332.694,17
CBAN32	14.702.854,40	354.015,72	353.700,08	6,11%	-1.699.674,06	-249.269,01	614.832,71	-785.310,57
CBANT2	3.517.425,89	90.515,25	90.414,54	1,56%	-419.063,42	-58.650,13	154.271,96	-196.647,45
CGOS16	3.100.570,72	122.711,32	121.138,55	2,09%	-417.895,34	-2.062,12	195.251,90	-242.557,33
CJEN13	4.202.297,35	95.849,68	95.790,59	1,65%	-446.899,28	-49.647,11	170.690,84	-216.682,44
CLCD27	2.584.374,89	87.675,90	86.842,87	1,50%	-346.564,80	-39.461,07	136.846,57	-172.716,87
CNRD11	7.116.422,18	197.909,15	197.311,07	3,41%	-837.690,78	-76.506,47	336.149,83	-424.201,15
COMPROMISSADA PRE	62.222.342,35	520,38	374,73	0,01%	-1.778,74	1.814,18	6.393,85	-9.731,91
CONTAS_A PAGAR_RECEBER	-152.020,70	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CRMG15	7.503.877,59	85.345,49	81.816,65	1,41%	-585.910,77	-89.596,11	192.411,17	-250.614,22
CSMGB9	3.341.155,10	74.525,18	74.426,22	1,29%	-371.824,87	-57.966,78	131.565,25	-168.460,50
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ELET14	3.157.829,14	69.549,32	69.194,90	1,20%	-357.799,18	-59.395,18	123.371,50	-159.098,03
ENEVA0	2.113.152,03	71.607,95	70.906,54	1,22%	-279.956,98	-30.039,25	111.739,07	-140.965,60
ERDV17	4.763.864,83	10.329,71	1.388,30	0,02%	-94.337,43	2.015,41	21.685,51	-29.271,34
ERDV38	5.963.347,62	28.358,64	-361,30	-0,01%	-156.558,78	693,02	44.828,23	-60.090,61
GASC16	2.541.906,63	100.393,12	98.893,80	1,71%	-336.533,50	-2.514,98	156.030,71	-194.584,49
GBSP11	3.644.532,50	156.222,38	154.340,49	2,67%	-588.349,95	-30.867,96	271.354,54	-327.008,90
GRRB24	8.600.848,91	111.927,31	84.062,72	1,45%	-780.703,50	-194.856,09	213.843,42	-281.352,71
HARG11	5.923.569,15	166.934,81	166.200,84	2,87%	-666.573,92	-36.078,70	284.309,78	-355.839,76
HVRD15	4.216.848,33	111.998,68	111.932,82	1,93%	-513.350,21	-61.745,25	196.058,86	-248.699,67
IPIL11	4.480.119,21	83.024,02	82.912,11	1,43%	-424.792,36	-52.855,98	155.640,94	-198.574,76
IRBR12	11.589.117,68	91.162,31	-1.768,75	-0,03%	-472.675,27	-25.323,65	145.865,69	-194.727,73
ITPO14	7.093.562,07	226.525,01	225.556,89	3,90%	-912.947,84	-70.831,87	378.838,95	-475.210,88
JALL15	3.290.110,15	112.848,23	111.706,35	1,93%	-438.133,98	-45.201,36	176.061,13	-221.946,05
LCAMD1	10.375.283,03	227.294,28	226.156,50	3,91%	-1.172.056,95	-194.662,91	403.866,83	-520.861,84
LORTA7	6.362.455,07	143.948,16	143.061,97	2,47%	-705.033,57	-92.126,32	257.135,98	-331.432,44
MOVIS7	8.586.320,86	182.666,89	181.831,28	3,14%	-954.182,89	-158.925,68	327.595,01	-422.680,73
MTRJ19	7.546.066,62	98.454,59	95.691,90	1,65%	-643.731,55	-114.987,83	206.211,32	-268.048,78
OUTRAS DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PASN12	3.242.270,56	28.216,32	23.849,24	0,41%	-221.867,54	-40.511,07	66.303,13	-87.035,72
PEJA11	4.648.510,82	85.519,91	84.550,85	1,46%	-492.232,94	-96.218,53	159.047,69	-205.707,17
QUAT12	3.439.914,44	19.260,50	456,45	0,01%	-90.271,59	11.641,80	29.884,92	-40.126,24
RAHD11	9.101.237,51	276.434,83	275.240,44	4,75%	-1.114.401,06	-69.509,20	480.176,71	-593.898,16
RDVE11	4.885.629,67	110.436,66	110.290,00	1,90%	-486.431,12	-40.009,89	196.524,35	-246.904,36
RMSA12	8.072.915,43	351.539,73	347.537,62	6,00%	-1.290.563,04	-57.245,32	593.801,41	-721.855,95
RSAN44	7.416.215,79	76.043,25	70.540,45	1,22%	-545.483,20	-93.740,69	170.594,06	-222.784,03
TCI11	9.456.038,24	313.024,28	311.329,43	5,38%	-1.256.135,70	-78.054,67	548.183,69	-673.390,24
TEPA12	2.681.001,61	39.937,56	38.224,22	0,66%	-253.662,59	-48.362,82	80.258,99	-104.434,71
UNEG11	4.968.487,44	196.661,49	194.680,67	3,36%	-704.888,00	-18.189,37	324.405,79	-399.351,65
UTPS21	2.201.728,24	69.546,50	69.114,51	1,19%	-276.106,18	-21.762,98	114.455,57	-143.691,00
VAMO33	1.289.262,78	25.943,40	25.786,23	0,45%	-142.196,24	-26.118,28	47.273,32	-61.097,66
VAMO34	7.322.862,86	154.299,29	153.610,58	2,65%	-796.084,09	-133.056,85	274.518,08	-354.007,50
VERO12	5.787.348,35	68.066,02	58.941,91	1,02%	-499.651,15	-106.557,26	147.250,72	-193.030,61
VIMT13	8.182.458,63	228.721,71	227.956,29	3,94%	-958.345,60	-84.016,22	387.850,31	-488.156,24
VRDN12	4.755.491,70	107.993,03	107.935,42	1,86%	-518.704,05	-70.077,31	190.687,70	-243.033,95
<b>Total Var:</b>	<b>337.915.536,27</b>	<b>6.070.236,54</b>	<b>5.789.966,77</b>	<b>99,98%</b>	<b>-28.030.679,29</b>	<b>-3.270.326,64</b>	<b>10.626.186,90</b>	<b>-13.444.701,29</b>

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2024



Data: 30/09/2024

## Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIRF EMB II A CRED PRIV  
 CNPJ: 20725957000102

Dados Gerais			
PL:	228.027.020,71	VAR / PL:	0,1451%
VAR:	330.775,88	ETL / PL:	0,1819%
ETL:	414.806,30	VAR / CDI:	0,0016%
Limite Fundo:		Status:	ENQUADRADO
Benchmark:		Dutacion DC:	0,00%
		Dutacion DU:	451,36

Cenários de STRESS			
Cenário Alta - 09999 (+):	902.406,58	Cenário Baixa - 10000 (+):	2.257.363,04
Cenário Alta - 09999 (-):	-2.329.770,42	Cenário Baixa - 10000 (-):	-724.543,57
Cenário Alta - 09999:	-1.427.363,85	Cenário Baixa - 10000:	1.532.819,48
CENARIO BRADESCO 1 (+):	2.251.904,53	CENARIO BRADESCO 2 (+):	15.957.325,48
CENARIO BRADESCO 1 (-):	-1.273.107,53	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-17.216.426,01
CENARIO BRADESCO 1:	978.797,00	CENARIO BRADESCO 2:	-1.259.100,53

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
CAIXA	9.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CDB323R5TI	6.859.900,77	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	4.678.702,68	39,13	15,52	0,00%	-133,75	136,41	480,77	-731,78
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-38.497,83	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
DIF27	12.763,78	111.395,95	-71.295,81	-21,55%	478.207,18	-363.821,87	-650.133,88	909.776,17
DIF29	8.024,38	72.720,11	-42.971,74	-12,99%	244.390,42	-200.817,29	-345.918,36	449.147,23
DIF33	5.426,31	58.271,64	-32.189,79	-9,73%	179.808,67	-159.904,05	-277.052,82	310.658,00
IDIV24P410200	-2,40	0,10	-0,04	0,00%	0,31	-0,36	2,40	-14.263.757,36
IDIV24P410300	2,40	0,10	0,04	0,00%	-0,33	0,39	-2,40	14.287.743,98
LF002200USM	10.958.564,46	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002200USN	11.489.390,18	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306J15	11.393.418,44	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306U55	6.846.145,30	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024000XE	10.958.318,49	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024000XG	10.938.650,28	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024000XN	10.914.635,49	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024002C7	6.649.346,70	79.196,01	50.689,93	15,32%	-329.797,85	267.186,35	462.820,79	-647.367,37
LF0024002SX	4.633.632,27	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024002TZ	10.900.964,66	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF00240033U	6.981.669,44	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024003DF	11.486.120,09	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024006I2	11.531.553,79	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024007F1	7.034.064,05	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024009LF	6.922.210,11	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002400D4A	3.482.131,71	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20250301 - 210100	646.881,24	173,14	42,35	0,01%	-603,60	689,32	-0,07	0,11
LFT20260301 - 210100	277.183,65	56,77	6,67	0,00%	-1.083,95	1.578,52	13,06	-19,89
LFT20260901 - 210100	954.715,97	338,10	61,28	0,02%	-5.092,76	7.719,33	52,08	-79,29
LFT20270301 - 210100	415.249,65	113,51	-8,29	0,00%	-2.283,42	4.731,29	154,07	-234,46
LFT20270901 - 210100	138.314,57	55,08	-19,37	-0,01%	-863,06	1.973,81	77,42	-117,78
LFT20300301 - 210100	45.835,50	35,33	-5,84	0,00%	-597,21	1.406,22	94,47	-143,46
NTNB20250515 - 760199 NEGOCIACAO	12.574.381,41	34.311,27	-19,63	-0,01%	-115.653,50	108.230,31	61.235,10	-82.616,03
NTNB20260815 - 760199 NEGOCIACAO	18.259.713,42	73.719,06	60.196,73	18,20%	-383.519,79	384.003,94	326.254,35	-433.304,32
NTNB20270515 - 760199 NEGOCIACAO	14.584.407,51	86.993,45	85.483,32	25,84%	-395.048,85	383.959,27	345.229,84	-454.987,94
NTNB20280815 - 760199 NEGOCIACAO	23.177.723,06	258.335,87	221.377,88	66,93%	-843.723,21	866.605,86	802.241,46	-1.043.027,72
NTNB20290515 - 760199 NEGOCIACAO	1.557.016,50	22.963,82	18.078,76	5,47%	-68.606,68	59.525,13	61.028,19	-78.804,71
NTNB20500815 - 760199 NEGOCIACAO	1.426.392,42	63.240,29	41.333,90	12,50%	-182.762,47	169.616,90	192.220,52	-211.233,91
OUTRAS DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
Total Var:	228.773.850,47	861.958,75	330.775,88	100,00%	-1.427.363,85	1.532.819,48	978.797,00	-1.259.100,54

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2024

## Relatório de Risco de Mercado



Data: 30/09/2024

FUNDO: FIM EMB I A  
CNPJ: 20725946000122

Dados Gerais		Limite Fundo:		ENQUADRADO		0,00% Dutation DC:		401,80	
PL:	192.419.758,40	VAR / PL:	0,1052%	Status:		Dutation DC:			
VAR:	202.453,34	ETL / PL:	0,1319%	Benchmark:		Dutation DU:			276,82
ETL:	253.884,66	VAR / CDI:	0,0012%						

Cenários de STRESS										
Cenário Alta - 09999 (+):	1.619.853,88	Cenário Baixa - 10000 (+):	6.097.375,24	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	3.068.316,31	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	1.114.982.204,88			
Cenário Alta - 09999 (-):	-2.780.438,00	Cenário Baixa - 10000 (-):	-4.916.654,46	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	-2.879.043,99	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	-1.121.044.827,63			
Cenário Alta - 09999:	-1.160.584,12	Cenário Baixa - 10000:	1.180.720,78	CENÁRIO BRADESCO 1:	189.272,32	CENÁRIO BRADESCO 2:	-6.062.622,75			

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
ANB10	473.139,91	7,56	4,54	0,00%	-51,67	41,35	80,53	-118,14
BCBF14	85.632,89	1,08	0,45	0,00%	-7,88	6,84	13,91	-20,82
CAIXA	9.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CBAN22	3.871.619,86	27.526,40	19.857,20	9,81%	-85.025,51	71.470,10	114.882,22	-150.893,64
CEBEA3	1.936.080,43	105,95	64,27	0,03%	-657,40	528,38	988,38	-1.440,01
CGBP13	2.048.423,97	671,91	471,45	0,23%	-2.896,88	2.384,45	4.181,08	-5.799,98
COMPROMISSADA PRE	95.287.806,21	796,91	147,42	0,07%	-2.723,98	2.778,25	9.791,59	-14.903,53
CONTAS_A PAGAR_RECEBER	-17.787,80	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPMX24C100500	126,57	51,98	-21,30	-0,01%	-0,12	0,11	0,36	-0,55
CPMX24C100750	33,62	14,64	0,33	0,00%	-0,03	0,03	0,10	-0,15
CPTE12	1.803.043,38	942,74	670,04	0,33%	-3.669,16	3.076,29	5.331,90	-7.189,34
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DHF25	1.558,88	40.811,75	-20.836,00	-10,29%	343.659,05	-257.041,76	-707.577,62	1.067.946,75
DHF26	-6.840,73	61.396,42	36.677,21	18,12%	-371.257,92	269.640,74	518.676,50	-753.355,76
DHF27	-209,24	1.826,16	1.258,92	0,62%	-7.839,46	5.964,29	10.657,93	-14.914,36
DHF31	3.289,61	33.764,62	-24.050,87	-11,88%	107.117,27	-91.864,07	-158.180,38	190.742,65
DHJ25	-2.016,83	38.644,19	15.709,40	7,76%	-299.593,30	229.787,77	488.015,33	-730.016,07
DHJ25	1.569,56	15.532,60	-7.172,39	-3,54%	122.655,55	-93.090,50	-188.133,34	278.804,79
DHJ26	21.328,30	198.935,29	-129.327,17	-63,88%	963.855,84	-727.985,43	-1.339.160,15	1.909.200,89
DHJ24	-1,16	294,27	-54,43	-0,03%	1.005,85	-1.025,89	-3.615,63	5.503,26
ELET13	2.095.716,25	64,56	35,15	0,02%	-479,35	387,86	747,94	-1.103,68
GRRB14	1.064.410,95	13,28	7,77	0,00%	-88,87	73,18	143,28	-210,82
IDIF25P419600	26,12	31,91	14,58	0,01%	-26,11	7.646,53	-26,12	141.014.457,08
IDIF25P419700	-26,12	32,91	-15,04	-0,01%	26,11	-8.797,18	26,12	-141.266.231,11
IDIF25P422300	16.734,75	26.571,42	12.144,03	6,00%	-16.734,75	721.988,04	-16.734,75	44.972.061,89
IDIF25P422400	-74.141,70	93.979,07	-42.951,59	-21,22%	74.141,67	-1.558.518,74	74.141,70	-90.056.707,34
IDIF25P422500	95.964,45	73.397,08	33.544,93	16,57%	-95.930,40	798.096,57	-95.964,45	45.046.087,82
IDJ25P432500	2.314,39	3.971,82	1.650,42	0,82%	-2.314,39	1.007.817,63	-2.314,39	47.633.011,35
IDJ25P432600	-6.409,08	10.692,11	-4.442,91	-2,19%	6.409,08	-2.177.311,00	6.409,08	-95.437.700,77
IDJ25P432700	4.216,50	6.900,42	2.867,34	1,42%	-4.216,50	1.170.515,55	-4.216,50	47.804.568,01
IDIV24P410000	18,50	0,66	0,12	0,00%	-2,12	2,43	-18,50	109.580.002,76
IDIV24P410100	-18,50	0,70	-0,13	0,00%	2,24	-2,59	18,50	-109.764.899,55
IDIV24P410200	-18,71	0,75	-0,14	0,00%	2,42	-2,81	18,71	-111.197.875,12
IDIV24P410300	4,97	0,21	0,04	0,00%	-0,69	0,81	-4,97	29.587.536,48
IDIV24P410400	4,32	0,20	0,04	0,00%	-0,64	0,76	-4,32	25.761.115,06
IDIV24P410500	9,42	0,48	0,09	0,00%	-1,51	1,82	-9,42	56.267.690,00
IDIV24P410700	28,68	1,78	0,33	0,00%	-5,51	6,87	-28,68	171.885.100,53
IDIV24P410800	-28,85	2,01	-0,37	0,00%	6,16	-7,88	28,85	-173.192.284,33
IDIV24P410900	-36,37	2,91	-0,54	0,00%	8,75	-11,58	36,37	-218.699.836,14
IDIV24P411000	53,64	5,03	0,93	0,00%	-14,83	20,53	-53,64	323.083.783,21
IDIV24P411100	-17,10	1,95	-0,36	0,00%	5,58	-8,24	17,10	-103.167.412,68
IDIV24P411200	11,34	1,66	0,31	0,00%	-4,53	7,43	-11,34	68.529.620,94
IDIV24P411300	-9,13	1,91	-0,35	0,00%	4,73	-9,47	9,13	-55.265.450,05
IDIV24P411400	-2,30	0,88	-0,16	0,00%	1,71	-5,86	2,30	-13.945.280,17
IDIV24P411600	-8.159,94	278,60	-51,54	-0,03%	951,86	-971,46	8.159,94	-4.919.195,72
LCAMC3	3.075.209,54	426,50	275,98	0,14%	-2.306,77	1.856,75	3.385,22	-4.872,64
LF002100HDP	1.669.873,23	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002100HDQ	3.042.073,74	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20250301 - 210100	1.540.193,42	412,24	149,75	0,07%	-1.437,14	1.641,23	-0,17	0,26
LFT20250901 - 210100	10.565.819,24	3.831,87	1.552,11	0,77%	-27.190,74	34.987,47	-24,79	37,73
LFT20260301 - 210100	13.058.429,68	2.674,47	217,39	0,11%	-51.065,86	74.365,64	615,40	-936,87
LFT20260901 - 210100	9.192.990,87	3.255,61	184,21	0,09%	-49.038,39	74.329,64	501,51	-763,49
LFT20270301 - 210100	6.751.651,73	1.845,56	-374,78	-0,19%	-37.126,71	76.927,28	2.505,07	-3.812,10
LFT20290301 - 210100	4.408.747,05	2.255,02	-812,50	-0,40%	-35.757,74	107.863,88	6.895,87	-10.477,76
LFT20260701 - 100000	25.037.101,83	198.959,82	128.844,87	63,64%	-956.780,31	725.005,85	1.340.638,00	-1.911.134,58
NTNB20500815 - 760199_NEGOCIACAO	3.452.283,11	153.059,84	110.930,18	54,79%	-442.338,15	410.522,07	465.229,36	-511.247,29
OMGE13	904.157,18	329,68	230,65	0,11%	-1.435,05	1.177,64	2.066,18	-2.874,74
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
SBSPC7	2.398.162,60	518,06	346,47	0,17%	-2.606,69	2.111,00	3.829,40	-5.469,64
VAMO22	707.127,67	26,05	15,41	0,01%	-172,76	141,09	271,67	-398,75
WDOX24	-6.952,91	138.871,46	64.691,60	31,95%	-279.638,18	284.200,52	-362.964,84	364.933,63
Total Var:	194.503.311,89	1.143.745,05	202.453,34	99,99%	-1.160.584,12	1.180.720,78	189.272,32	-6.062.622,75

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2024

## Relatório de Risco de Mercado



Data: 30/09/2024

FUNDO: EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA  
CNPJ: 55899189000198

Dados Gerais							
PL:	50.561.590,00	VAR / PL:	0,1021%	Limite Fundo:	0,00%	Duration DC:	561,29
VAR:	51.605,16	ETL / PL:	0,1280%	Status:	ENQUADRADO	Duration DU:	387,12
ETL:	64.714,96	VAR / CDI:	0,0011%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	894.668,77	Cenário Baixa - 10000 (+):	908.274,13	CENARIO BRADESCO 1 (+):	168.694,55	CENARIO BRADESCO 2 (+):	756.855,77
Cenário Alta - 09999 (-):	-323.222,08	Cenário Baixa - 10000 (-):	-304.707,92	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-581.352,82	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-211.166,52
Cenário Alta - 09999:	571.446,69	Cenário Baixa - 10000:	603.566,21	CENARIO BRADESCO 1:	-412.658,27	CENARIO BRADESCO 2:	545.689,24

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
CADA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	5.177.958,70	43,30	-28,71	-0,06%	-148,02	150,97	532,08	-809,86
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-10.070,46	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DAPQ28	2.127,25	16.213,52	14.646,94	28,38%	52.770,89	-46.623,64	-53.183,88	51.278,51
DAPQ32	455,38	7.620,59	6.613,22	12,82%	17.275,72	-15.238,55	-18.768,85	17.327,85
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DIF25	4,38	114,75	101,55	0,20%	968,24	-722,70	-1.989,44	3.002,66
DIF26	2.424,56	21.760,76	16.674,50	32,31%	131.585,09	-95.568,87	-183.834,71	267.012,17
DIF27	2.408,29	21.000,68	16.346,45	31,88%	90.153,81	-68.589,37	-122.566,22	174.516,18
DIF28	1.459,78	13.663,20	10.837,50	21,00%	58.438,82	-40.367,67	-69.687,59	93.923,23
DIF29	573,17	5.494,29	4.177,53	8,10%	17.456,46	-14.344,09	-24.708,45	32.081,95
DIF30	601,45	5.916,90	4.777,16	9,26%	19.096,17	-16.030,20	-27.583,83	34.507,03
DIF31	-2.467,21	25.323,46	-20.470,81	-39,67%	-80.337,95	68.898,05	118.635,28	-143.056,89
DIF25	115,65	1.144,51	852,10	1,65%	9.037,78	-8.859,30	-13.862,46	20.543,51
DOLV24	-650,50	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
EUPZ24	209,41	7.934,46	3.206,25	6,21%	505.522,99	390.348,95	562,76	-521,39
ITAGRADA	5.051.971,22	541,69	98,36	0,19%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20270901 - 210100	25.403.775,74	10.116,49	5.967,25	11,56%	-158.516,08	362.523,56	14.219,19	-21.632,99
NTNB20250515 - 760199_NEGOCIACAO	252.729,10	689,61	324,65	0,63%	-2.324,49	2.175,29	1.230,75	-1.660,48
NTNB20260815 - 760199_NEGOCIACAO	60.149,64	242,84	-75,35	-0,15%	-1.263,36	1.264,95	1.074,72	-1.427,36
NTNB20270515 - 760199_NEGOCIACAO	26.121,33	155,81	-118,99	-0,23%	-707,55	687,69	618,32	-814,90
NTNB20280815 - 760199_NEGOCIACAO	906.510,28	10.103,85	-9.014,42	-17,47%	-32.999,09	33.894,06	31.376,69	-40.794,14
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
SWIZZ4	-3.561,50	13.664,83	-6.036,38	-11,70%	-46.035,06	47.443,26	-64.081,73	64.569,14
T10Z24	-7.405,60	25.612,38	-14.100,11	-27,32%	-890,48	887,35	-1.085,66	1.094,55
UNI_PREV	13.677.909,20	9.504,94	-2.575,57	-4,99%	0,00	0,00	0,00	0,00
WDOV24	-910,70	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
WSPZ24	3.033,91	34.290,26	19.402,53	37,60%	384,81	-363,53	444,77	-448,41
<b>Total Var:</b>	<b>50.546.470,48</b>	<b>230.853,29</b>	<b>51.605,16</b>	<b>100,00%</b>	<b>571.446,69</b>	<b>603.566,21</b>	<b>-412.658,27</b>	<b>545.689,24</b>

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2024

## Relatório de Risco de Mercado



Data: 30/09/2024

FUNDO: FIM EMB III A IMOBILIÁRIO  
CNPJ: 32711990000162

Dados Gerais									
PL:	68.688.547,55	VAR / PL:	5,0093%	Limite Fundo:	0,00%	Duration DC:	1,00		
VAR:	3.440.788,72	ETL / PL:	6,2818%	Status:	ENQUADRADO	Duration DU:	1,00		
ETL:	4.314.867,86	VAR / CDI:	0,055%	Benchmark:					

Cenários de STRESS									
Cenário Alta - 09999 (+):	33.081.144,86	Cenário Baixa - 10000 (-):	10,40	CENARIO BRADESCO 1 (+):	9.298.334,30	CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00		
Cenário Alta - 09999 (-):	-10,19	Cenário Baixa - 10000 (-):	-33.081.144,86	CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-9.374.465,00		
Cenário Alta - 09999:	33.081.134,67	Cenário Baixa - 10000:	-33.081.134,46	CENARIO BRADESCO 1:	9.298.334,30	CENARIO BRADESCO 2:	-9.374.465,00		

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

Produto	MmM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
AIEC11	1.909.282,56	79.817,05	-16.574,58	-0,48%	954.641,28	-954.641,28	279.900,82	-282.191,96
BMLC11	3.521.502,84	137.673,94	34.358,02	1,00%	3.521.502,84	-3.521.502,84	516.252,32	-520.478,12
BPML11	4.930.340,30	431.416,01	232.021,60	6,74%	4.930.340,30	-4.930.340,30	722.787,89	-728.704,30
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CBOP11	1.654,25	121,18	-22,82	0,00%	827,13	-827,13	242,51	-244,50
CEOC11	610.756,00	40.884,37	4.290,64	0,12%	305.378,00	-305.378,00	89.536,83	-90.269,74
CNES11	240.281,10	17.412,08	2.268,02	0,07%	120.140,55	-120.140,55	35.225,21	-35.513,55
COMPROMISSADA_PRE	356.587,56	2,98	-0,44	0,00%	-10,19	10,40	36,64	-55,77
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-448.334,81	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	3.325.698,78	3.272.549,39	2.987.903,26	86,84%	3.325.698,78	-3.325.698,78	487.547,44	-491.538,28
FIGS11	693.057,60	17.570,35	-9.679,41	-0,28%	346.528,80	-346.528,80	101.602,24	-102.433,91
FVPQ11	660.544,50	51.504,84	3.880,84	0,11%	330.272,25	-330.272,25	96.835,82	-97.628,48
GZIT11	1.102.430,91	62.842,65	45.304,04	1,32%	551.215,46	-551.215,46	161.616,37	-162.939,29
HOFIC11	288.647,40	39.767,37	-1.924,43	-0,06%	0,00	0,00	42.315,71	-42.662,09
JSRE11	97.450,75	3.458,77	-38,25	0,00%	25.337,20	-25.337,20	14.286,28	-14.403,22
MALL11	5.595.782,50	317.254,11	-51.925,10	-1,51%	1.454.903,45	-1.454.903,45	820.341,72	-827.059,65
MAXR11	2.402.297,40	126.570,71	-39.034,95	-1,13%	1.201.148,70	-1.201.148,70	352.176,80	-355.059,56
NEWL11	6.476.524,80	274.923,80	36.152,76	1,05%	3.238.262,40	-3.238.262,40	949.458,54	-957.230,37
NEWU11	1.827.433,65	158.864,23	15.852,59	0,46%	1.827.433,65	-1.827.433,65	267.901,77	-270.094,69
OULG11	635.802,30	18.004,81	-2.707,15	-0,08%	317.901,15	-317.901,15	93.208,62	-93.971,58
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PATC11	4.098.010,00	176.084,55	78.815,01	2,29%	2.049.005,00	-2.049.005,00	600.768,27	-605.685,88
QAQR11	5.229.757,44	96.435,35	41.578,98	1,21%	2.614.878,72	-2.614.878,72	766.682,44	-772.958,15
RBRP11	1.925.411,50	162.171,40	-14.327,69	-0,42%	962.705,75	-962.705,75	282.265,33	-284.575,82
RCRB11	5.352.980,11	200.545,57	121.288,52	3,53%	0,00	0,00	0,00	0,00
SARE11	796.320,00	39.528,46	24.992,41	0,73%	398.160,00	-398.160,00	116.740,51	-117.696,10
TRXF11	8.255.404,56	128.211,13	66.234,06	1,92%	2.146.405,19	-2.146.405,19	1.210.242,31	-1.220.148,79
VVMR11	3.885.006,45	187.775,51	-81.229,10	-2,36%	0,00	0,00	569.541,95	-574.203,95
XPIN11	2.751.233,82	152.413,32	-23.665,86	-0,69%	1.375.616,91	-1.375.616,91	403.330,88	-406.632,36
XPPR11	2.165.682,74	179.546,45	-13.022,25	-0,38%	1.082.841,37	-1.082.841,37	317.489,09	-320.087,91
<b>Total Var:</b>	<b>68.688.547,00</b>	<b>6.373.350,35</b>	<b>3.440.788,72</b>	<b>100,00%</b>	<b>33.081.134,67</b>	<b>-33.081.134,46</b>	<b>9.298.334,30</b>	<b>-9.374.465,00</b>



# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2024

## Relatório de Risco de Mercado



Data: 30/09/2024

<b>FUNDO:</b>	<b>FIA RVA EMB II</b>		
<b>CNPJ:</b>	<b>13294268000125</b>		

Dados Gerais			
PL:	96.820.877,83	VAR / PL:	6,8656%
VAR:	6.647.331,53	ETL / PL:	8,6097%
ETL:	8.336.021,92	VAR / CDI:	0,0753%
Limite Fundo:		Status:	ENQUADRADO
Benchmark:		Dutacion DC:	0,00%
		Dutacion DU:	1,00

Cenários de STRESS			
Cenário Alta - 09999 (+):	24.574.195,31	Cenário Baixa - 10000 (+):	19,02 CENÁRIO BRADESCO 1 (+): 13.920.277,97 CENÁRIO BRADESCO 2 (+): 0,00
Cenário Alta - 09999 (-):	-18,65	Cenário Baixa - 10000 (-):	-24.423.741,48 CENÁRIO BRADESCO 1 (-): 0,00 CENÁRIO BRADESCO 2 (-): -14.034.257,39
Cenário Alta - 09999:	24.574.176,66	Cenário Baixa - 10000:	-24.423.722,46 CENÁRIO BRADESCO 1: 13.920.277,97 CENÁRIO BRADESCO 2: -14.034.257,39

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
ABEV3	2.109.869,40	154.281,53	127.331,97	1,92%	295.381,72	-632.976,95	309.306,85	-311.838,70
B3SA3	2.034.139,59	400.379,48	385.615,72	5,80%	508.534,90	-508.534,90	298.204,86	-300.645,83
BBAS3	2.957.184,00	233.727,58	176.668,30	2,66%	739.296,00	-739.306,88	433.523,17	-437.071,80
BBDC4	2.814.756,00	486.297,17	429.894,47	6,47%	703.689,00	-703.689,00	412.643,23	-416.020,94
BBSE3	582.200,00	52.739,17	50.299,25	0,76%	116.440,00	-116.440,00	85.350,52	-86.049,16
BPAC11	2.854.566,00	376.849,78	353.805,09	5,32%	856.369,80	-999.098,10	418.479,38	-421.904,86
BRFS3	669.295,00	120.692,54	109.917,56	1,65%	167.323,75	-167.323,75	98.118,65	-98.921,80
BRIT3	400.959,00	56.461,92	29.531,64	0,44%	188.450,73	-188.450,73	58.780,59	-59.261,74
CAIX4	10.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CMG4	1.169.982,00	98.874,47	82.523,96	1,24%	292.495,50	-350.994,60	171.519,36	-172.923,34
COMPROMISSADA_PRE	652.262,06	5,46	4,49	0,00%	-18,65	19,02	67,03	-102,02
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	1.204.925,15	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPLE6	1.533.595,00	107.153,35	92.356,40	1,39%	337.375,85	-337.390,90	224.825,03	-226.665,34
CURY3	626.080,00	66.600,58	54.715,13	0,82%	187.824,00	-187.824,00	91.783,33	-92.534,62
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DIRR3	1.542.750,00	102.749,14	-25.451,38	-0,38%	462.825,00	-462.830,10	226.167,15	-228.018,45
ELET3	4.711.060,70	488.093,92	464.621,40	6,99%	1.413.318,21	-1.413.318,21	690.641,50	-696.294,77
ENGI11	622.581,00	61.572,34	57.769,12	0,87%	105.838,77	-136.967,82	91.270,38	-92.017,47
EQTL3	2.574.000,00	323.460,19	295.398,67	4,44%	514.800,00	-514.800,00	377.348,40	-380.437,20
GGBR4	1.522.652,00	101.176,57	3.384,23	0,05%	380.663,00	-380.663,00	223.220,78	-225.047,97
GMAT3	821.769,00	121.771,49	107.589,12	1,62%	153.152,90	-127.756,80	120.471,34	-121.457,46
HAPV3	752.352,00	81.303,30	62.642,30	0,94%	255.799,68	-255.818,49	110.294,80	-111.197,63
IGTI11	330.956,00	40.748,93	36.523,97	0,55%	66.191,20	-66.191,20	48.518,15	-48.915,30
INTB3	287.430,00	25.194,77	19.750,75	0,30%	143.715,00	-100.600,50	42.137,24	-42.482,15
ITSA4	2.041.795,08	119.566,04	93.520,80	1,41%	387.941,07	-387.941,07	299.327,16	-301.777,31
ITUB4	9.155.221,07	685.535,61	638.588,90	9,61%	1.831.044,21	-1.739.492,00	1.342.155,41	-1.353.141,67
JBSS3	1.983.201,00	391.544,83	358.491,09	5,39%	694.120,35	-694.120,35	290.737,27	-293.117,11
LREN3	1.059.219,00	152.352,46	101.474,62	1,53%	211.837,94	-211.843,80	155.281,51	-156.552,57
LWSA3	423.852,00	69.375,20	61.517,82	0,93%	169.530,66	-169.550,94	62.136,70	-62.645,33
MRFG3	1.685.904,00	341.184,91	290.149,05	4,36%	674.361,60	-505.771,20	247.153,53	-249.176,61
MULT3	466.830,00	34.956,87	27.790,25	0,42%	140.049,00	-116.707,50	68.437,28	-68.997,47
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PETR3	1.908.522,00	200.398,68	157.494,61	2,37%	477.130,50	-572.556,60	279.789,33	-282.079,55
PETR4	7.942.329,59	800.748,07	675.942,27	10,17%	1.985.560,34	-2.382.720,93	1.164.345,52	-1.173.876,31
PRIO3	1.403.892,00	204.205,30	119.665,29	1,80%	744.062,76	-463.287,60	205.810,57	-207.495,24
RADL3	1.205.575,04	150.081,75	77.785,60	1,17%	241.115,01	-241.115,01	176.737,30	-178.183,99
RAIL3	1.178.000,00	219.788,91	157.069,96	2,36%	530.100,00	-388.740,00	172.694,80	-174.108,40
RDR3	2.010.450,00	259.289,45	217.943,09	3,28%	614.120,00	-597.220,00	294.731,97	-297.144,51
RENT3	2.976.600,00	329.274,49	-65.480,15	-0,99%	982.278,00	-773.916,00	436.369,56	-439.941,48
SBF3	1.118.700,00	212.757,38	190.264,41	2,86%	425.106,00	-447.480,00	164.001,42	-165.343,86
SBSP3	2.585.440,00	381.885,24	303.645,62	4,57%	646.360,00	-646.360,00	379.025,50	-382.128,03
SRNA3	647.088,00	36.100,41	6.122,43	0,09%	0,00	0,00	94.863,10	-95.639,61
STBP3	557.928,00	76.304,22	-24.351,15	-0,37%	195.274,80	-195.274,80	81.792,25	-82.461,76
SUZB3	3.130.300,00	318.177,67	263.613,56	3,97%	782.575,00	-626.060,00	458.901,98	-462.658,34
TIMS3	797.898,00	36.025,01	9.903,45	0,15%	255.327,36	-183.516,54	116.971,85	-117.929,32
TOTS3	1.036.728,00	121.387,68	105.379,00	1,59%	207.345,60	-207.345,60	151.984,33	-153.228,40
VALE3	12.587.364,45	896.917,89	-442.553,04	-6,66%	3.146.841,11	-3.146.841,11	1.845.307,63	-1.860.412,47
VBBR3	676.260,00	94.377,59	86.865,79	1,31%	169.065,00	-169.065,00	99.139,72	-99.951,23
VIVT3	1.953.700,00	64.871,69	15.932,36	0,24%	293.055,00	-293.058,50	286.412,42	-288.756,86
WEGE3	3.502.716,00	400.581,59	305.672,72	4,60%	880.509,00	-872.781,00	513.498,17	-517.701,43
<b>Total Var:</b>	<b>96.820.877,13</b>	<b>10.106.822,60</b>	<b>6.647.331,53</b>	<b>100,01%</b>	<b>24.574.176,66</b>	<b>-24.423.722,46</b>	<b>13.920.277,97</b>	<b>-14.034.257,39</b>

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2024



bradesco

Data: 30/09/2024

## Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIA RVA EMB III  
CNPJ: 38452593000108

Dados Gerais							
PL:	110.400.671,81	VAR / PL:	7,8292%	Limite Fundo:		0,00% Dotation DC:	1,00
VAR:	8.643.504,53	ETL / PL:	9,8181%	Status:	ENQUADRADO	Dotation DU:	1,00
ETL:	10.839.303,39	VAR / CDI:	0,0659%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	29.003.979,27	Cenário Baixa - 10000 (+):	1.297.565,79	CENARIO BRADESCO 1 (+):	15.255.042,48	CENARIO BRADESCO 2 (+):	1.666.001,36
Cenário Alta - 09999 (-):	-1.276.735,22	Cenário Baixa - 10000 (-):	-26.609.992,08	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-1.657.013,40	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-15.380.037,27
Cenário Alta - 09999:	27.727.244,05	Cenário Baixa - 10000:	-25.312.426,29	CENARIO BRADESCO 1:	13.598.029,07	CENARIO BRADESCO 2:	-13.714.035,91

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
ALOS3	4.550.349,90	431.806,22	416.410,40	4,82%	0,00	0,00	667.081,30	-672.541,72
ALPA4	36.140,00	2.768,06	2.341,33	0,03%	9.035,00	-9.035,00	5.298,12	-5.341,49
AZZA3	2.439.407,99	468.594,63	431.715,61	4,99%	0,00	0,00	0,00	0,00
BZAS3	2.047.904,28	161.860,64	76.501,54	0,28%	511.976,07	-511.993,61	300.222,77	-302.680,25
BBDG4	2.431.136,10	420.019,25	320.137,10	3,70%	607.782,53	-607.782,53	356.403,67	-359.321,03
BSE3	1.650.750,00	149.534,83	132.852,33	1,54%	330.150,00	-330.150,00	241.999,95	-243.980,85
BRAC11	3.409.210,17	450.071,96	407.619,70	4,72%	1.022.763,05	-1.193.223,56	499.790,21	-503.881,26
CAXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	4.412.257,51	36,90	29,61	0,00%	-126,13	128,65	453,40	-690,10
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-207.798,28	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPLE3	2.943.658,09	216.517,27	195.245,41	2,26%	647.572,75	-647.604,78	431.540,28	-435.072,67
CPLE6	3.485.662,73	243.545,67	203.489,34	2,35%	766.811,59	-766.845,80	510.998,16	-515.180,95
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DOLX24	-31.741,55	633.978,41	-195.664,44	-2,26%	-1.276.609,08	1.297.437,15	-1.657.013,40	1.666.001,36
ELET3	6.073.947,95	629.297,14	546.994,71	6,33%	1.822.184,39	-1.822.184,39	890.440,77	-897.729,51
ENEV3	2.369.521,55	114.851,33	17.222,84	0,20%	876.722,97	-1.208.455,99	347.371,86	-350.215,29
ENGH1	2.127.525,00	210.409,06	165.079,85	1,91%	361.679,25	-468.055,50	311.895,17	-314.448,20
EQTL3	8.686.177,50	1.091.543,36	1.046.460,13	12,11%	1.737.235,50	-1.737.235,50	1.273.393,62	-1.283.817,03
EQTL9	618.540,00	77.728,46	74.518,10	0,86%	0,00	0,00	90.677,96	-91.420,21
FLRY3	3.189.381,00	223.519,53	139.907,67	1,62%	637.855,53	-637.876,20	467.563,26	-471.390,51
GGPS3	1.504.248,00	111.593,01	-58.842,68	-0,68%	676.911,60	-676.911,60	220.522,76	-222.327,85
HAPV3	3.405.336,00	367.999,36	291.805,68	3,38%	1.157.814,24	-1.157.899,37	499.222,26	-503.308,66
IGTH1	9.155.191,56	1.127.232,09	1.108.043,04	12,82%	1.831.038,31	-1.831.038,31	1.342.151,08	-1.353.137,31
ITS44	3.632.067,00	212.691,20	110.902,75	1,28%	690.092,73	-690.092,73	532.461,02	-536.819,50
MGLU3	621.617,80	176.554,91	171.616,98	1,98%	323.189,26	-279.683,01	91.114,51	-91.860,33
NTCO3	4.017.864,45	420.262,85	-61.048,94	-0,71%	1.004.466,11	-1.004.466,11	589.019,93	-593.840,37
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PRI03	4.428.715,97	644.185,78	495.202,78	5,73%	2.347.219,46	-1.461.486,49	649.249,76	-654.564,22
RAIL3	6.075.880,00	1.133.625,66	989.387,10	11,45%	2.734.146,00	-2.005.040,40	890.724,01	-898.015,06
RECV3	959.006,40	179.977,87	166.640,93	1,93%	575.403,84	-575.403,84	140.590,34	-141.741,15
RENT3	8.565.392,00	947.512,28	90.293,01	1,04%	2.826.579,36	-2.227.001,92	1.255.686,47	-1.265.964,94
SCAR3	137.100,00	9.902,48	7.290,90	0,08%	82.260,00	-82.260,00	20.098,86	-20.263,38
SMTF3	5.229.216,00	454.709,13	385.354,31	4,46%	2.091.686,40	-2.091.686,40	766.603,07	-772.878,13
SUZB3	11.062.589,08	1.124.450,95	973.852,96	11,27%	2.765.647,27	-2.212.517,82	1.621.775,56	-1.635.050,67
WDOX24	755,75	15.094,72	4.658,68	0,05%	30.395,45	-30.891,36	39.452,70	-39.666,70
YDIQ3	1.372.719,49	162.576,52	-12.414,22	-0,14%	535.360,60	-343.179,87	201.240,68	-202.887,94
<b>Total Var:</b>	<b>110.400.623,45</b>	<b>12.614.451,57</b>	<b>8.643.504,53</b>	<b>100,01%</b>	<b>27.727.244,05</b>	<b>-25.312.426,29</b>	<b>13.598.029,07</b>	<b>-13.714.035,91</b>

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2024

## Relatório de Risco de Mercado



Data: 30/09/2024

FUNDO: FIA RVA EMB IV  
CNPJ: 38452613000132

Dados Gerais									
PL:	103.957.235,02	VAR / PL:	8,6376%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	1,00		
VAR:	8.979.428,82	ETL / PL:	10,8319%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1,00		
ETL:	11.260.566,00	VAR / CDI:	0,0948%	Benchmark:					

Cenários de STRESS									
Cenário Alta - 09999 (+):	27.573.672,37	Cenário Baixa - 10000 (+):	224,90	CENARIO BRADESCO 1 (+):	14.087.100,82	CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00		
Cenário Alta - 09999 (-):	-220,51	Cenário Baixa - 10000 (-):	-24.359.491,33	CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-14.202.818,66		
Cenário Alta - 09999:	27.573.451,86	Cenário Baixa - 10000:	-24.359.266,43	CENARIO BRADESCO 1:	14.087.100,82	CENARIO BRADESCO 2:	-14.202.818,66		

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
AURE3	1.831.190,36	128.634,85	98.200,94	1,09%	457.797,59	-567.669,01	268.452,51	-270.649,94
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	7.713.577,23	64,51	53,04	0,00%	-220,51	224,90	792,63	-1.206,45
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	155.963,34	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPLE3	2.627.577,23	193.268,32	179.335,99	2,00%	578.038,40	-578.066,99	385.202,82	-388.355,92
CPLE6	3.871.262,52	270.487,80	233.432,66	2,60%	851.639,76	-851.677,75	567.527,09	-572.172,60
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ENGH1	12.223.146,21	1.208.851,00	1.005.477,11	11,20%	2.077.934,86	-2.689.092,17	1.791.913,23	-1.806.581,01
ENGH4	15,70	1,56	1,25	0,00%	12,56	-12,56	2,30	-2,32
EQTL3	14.466.855,00	1.817.968,78	1.771.349,92	19,73%	2.893.371,00	-2.893.371,00	2.120.840,94	-2.138.201,17
EQTL9	938.957,50	117.993,54	114.967,79	1,28%	0,00	0,00	137.651,17	-138.777,92
GGPS3	5.728.854,88	424.996,52	-245.474,30	-2,73%	2.577.984,70	-2.577.984,70	839.850,13	-846.724,75
GMAT3	5.207.303,40	771.629,39	628.273,53	7,00%	970.483,94	-809.556,48	763.390,68	-769.639,44
HAPV3	6.046.888,00	653.460,02	522.044,87	5,81%	2.055.941,92	-2.056.093,09	886.473,78	-893.730,05
ITUB4	4.796.419,08	359.152,02	309.316,71	3,44%	959.283,82	-911.319,63	703.155,04	-708.910,74
MATD3	662.465,78	64.154,59	1.237,32	0,01%	198.739,73	-198.754,89	97.117,46	-97.912,44
MULT3	4.746.429,90	355.419,18	319.628,84	3,56%	1.423.928,97	-1.186.607,48	695.826,62	-701.522,34
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PRI03	10.378.574,92	1.509.631,78	1.159.850,37	12,92%	5.500.644,71	-3.424.953,68	1.521.499,08	-1.533.953,37
RAIL3	6.938.420,00	1.294.556,67	1.128.374,83	12,57%	3.122.289,00	-2.289.678,60	1.017.172,37	-1.025.498,48
UGPA3	11.618.562,27	1.291.240,89	1.219.758,69	13,58%	2.904.640,57	-2.323.712,45	1.703.281,23	-1.717.223,50
VBBR3	4.003.763,40	558.757,81	533.599,28	5,94%	1.000.940,85	-1.000.940,85	586.951,71	-591.756,23
<b>Total Var:</b>	<b>103.957.226,72</b>	<b>11.020.269,22</b>	<b>8.979.428,82</b>	<b>100,00%</b>	<b>27.573.451,86</b>	<b>-24.359.266,42</b>	<b>14.087.100,82</b>	<b>-14.202.818,66</b>

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2024



**bradesco**  
Data: 30/09/2024

## Relatório de Risco de Mercado

**FUNDO:** FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI  
**CNPJ:** 41901874000163

Dados Gerais		Limites	
PL:	121.121.291,61	VAR / PL:	6,9542%
VAR:	8.422.969,95	ETL / PL:	8,7208%
ETL:	10.562.744,13	VAR / CDI:	0,0763%
Limite Fundo:		ENQUADRADO	
Status:		0,00% Dutation DC:	
Benchmark:		Dutation DU:	
		3,51	
		2,72	

Cenários de STRESS					
Cenário Alta - 09999 (+):	30.740.817,78	Cenário Baixa - 10000 (+):	160.805,57	CENARIO BRADESCO 1 (+):	17.671.643,30
Cenário Alta - 09999 (-):	-160.241,16	Cenário Baixa - 10000 (-):	-30.989.234,83	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-127.045,18
Cenário Alta - 09999:	30.580.576,62	Cenário Baixa - 10000:	-30.828.429,27	CENARIO BRADESCO 1:	17.544.598,12
				CENARIO BRADESCO 2 (+):	127.931,60
				CENARIO BRADESCO 2 (-):	-17.815.784,48
				CENARIO BRADESCO 2:	-17.687.852,88

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
ABEV3	3.122.836,92	228.353,50	189.541,78	2,25%	437.197,17	-936.874,95	457.807,89	-461.555,30
ALOS3	596.526,85	56.607,52	52.083,28	0,62%	0,00	0,00	87.450,84	-88.166,67
ALPA4	62.841,90	4.813,23	3.230,09	0,04%	15.710,48	-15.710,48	9.212,62	-9.288,03
ASA3	547.745,22	75.703,70	69.760,92	0,83%	153.368,66	-142.413,76	80.299,45	-80.956,74
AURE3	165.811,92	11.647,72	8.332,13	0,10%	41.452,98	-51.401,70	24.308,03	-24.507,00
AZUL4	111.309,12	43.705,11	2.279,10	0,03%	66.785,47	-38.958,19	16.317,92	-16.451,49
AZZA3	291.858,57	56.064,16	44.194,43	0,52%	0,00	0,00	0,00	0,00
B3SA3	3.206.681,10	631.170,71	608.127,64	7,22%	801.670,28	-801.670,28	470.099,45	-473.947,47
BBAS3	4.197.353,04	331.747,08	256.816,73	3,05%	1.049.338,26	-1.049.353,70	615.331,96	-620.368,78
BBDC3	1.055.551,42	187.963,96	173.622,96	2,06%	263.887,86	-263.895,92	154.743,84	-156.010,50
BBDC4	4.096.684,20	707.772,17	630.137,75	7,48%	1.024.171,05	-1.024.171,05	600.573,90	-605.489,93
BBSE3	1.229.152,00	111.343,96	106.260,62	1,26%	245.830,40	-245.830,40	180.193,68	-181.668,67
BEEF3	90.015,32	22.297,05	20.625,93	0,24%	22.503,83	-22.503,83	13.196,25	-13.304,26
BPAJ1	2.328.504,56	307.136,97	287.146,64	3,42%	697.951,37	-814.276,60	341.065,57	-343.857,37
BRAP4	276.699,70	18.137,96	3.394,13	0,04%	68.924,83	-68.924,93	40.417,59	-40.748,42
BRAV3	444.417,04	82.289,45	67.689,27	0,80%	0,00	0,00	0,00	0,00
BRFS3	1.046.488,85	188.711,11	171.871,33	2,04%	261.622,21	-261.622,21	153.415,27	-154.671,05
BRKM5	287.330,81	45.228,18	-22.560,65	-0,27%	158.031,95	-86.193,24	42.122,70	-42.467,49
CAIXA	9.096,10	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CCRO3	651.984,30	81.086,83	75.478,96	0,90%	162.996,08	-162.996,08	95.580,90	-96.363,23
CMG4	1.151.012,40	97.271,36	82.462,25	0,98%	287.753,10	-345.303,72	168.738,42	-170.119,63
CMN3	416.256,30	90.437,64	-39.374,48	-0,47%	145.689,71	-145.689,71	61.023,17	-61.522,68
COGN3	130.199,04	17.517,31	-3.923,38	-0,05%	32.549,76	-45.569,66	19.087,18	-19.243,42
COMPROMISSA_PRE	975.261,83	8,16	6,68	0,00%	-27,88	28,44	100,22	-152,54
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	1.113.338,31	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPFE3	346.187,79	13.306,48	3.314,95	0,04%	69.237,56	-69.237,56	50.751,13	-51.166,56
CPLE6	929.562,37	64.949,17	55.748,59	0,66%	204.494,60	-204.503,72	136.273,84	-137.389,32
CRFB3	267.278,75	22.412,21	3.791,73	0,05%	66.819,69	-66.819,69	39.183,07	-39.503,80
CSAN3	828.042,48	79.413,89	62.579,24	0,74%	207.010,62	-207.010,62	121.391,03	-122.384,68
CSNA3	515.625,78	58.462,71	-8.296,98	-0,10%	206.250,31	-154.687,73	75.590,74	-76.209,49
CVCB3	53.132,76	8.519,07	6.888,77	0,08%	26.566,38	-26.566,38	7.789,25	-7.853,02
CYSE3	408.087,80	49.824,68	37.432,87	0,44%	81.817,56	-81.817,56	59.972,27	-60.463,18
CYRE3	295.118,64	38.175,28	35.675,09	0,42%	94.437,97	-85.584,41	43.264,39	-43.618,54
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
EGIE3	588.526,80	39.165,55	36.427,20	0,43%	105.934,82	-105.934,82	86.278,03	-86.984,26
ELET3	3.804.987,60	394.219,35	374.891,08	4,45%	1.141.496,28	-1.141.496,28	557.811,18	-562.377,17
ELET6	638.209,71	62.446,82	59.713,22	0,71%	191.462,91	-191.462,91	93.561,54	-94.327,40
EMBR3	1.914.242,85	175.955,33	63.395,84	0,75%	478.560,71	-478.560,71	280.628,00	-282.925,09
ENEV3	1.198.919,37	58.111,93	20.492,19	0,24%	443.600,17	-611.448,88	175.761,58	-177.200,28
ENGH1	793.857,96	78.511,37	74.117,55	0,88%	134.955,85	-174.648,75	116.379,58	-117.332,21
EQTL3	2.197.260,00	276.117,38	248.755,83	2,95%	439.452,00	-439.452,00	322.118,32	-324.755,03
EQTL9	109.785,00	13.796,07	12.428,96	0,15%	0,00	0,00	16.094,48	-16.226,22
EZTC3	70.545,42	8.005,17	6.645,13	0,08%	14.109,08	-21.163,63	10.341,96	-10.426,61
FLRY3	389.237,18	27.278,68	21.293,52	0,25%	77.844,91	-77.847,44	57.062,17	-57.529,26
GGBR4	1.289.421,90	86.678,99	3.968,00	0,05%	322.355,48	-322.355,48	189.029,25	-190.576,56
GOAU4	392.497,56	25.750,15	-3.116,49	-0,04%	117.749,27	-98.124,39	57.540,14	-58.011,14
HAVV3	1.038.576,00	112.534,24	85.296,07	1,01%	353.415,84	-353.415,80	152.255,24	-153.501,53
HYPE3	583.145,36	80.795,96	66.147,77	0,79%	134.123,43	-122.460,53	85.489,11	-86.188,88
IGTI1	242.103,80	29.809,01	26.364,05	0,31%	48.420,76	-48.420,76	35.492,42	-35.782,94
INDV24	18.192,00	232.091,84	231.953,41	2,75%	574.089,87	-573.701,83	461.974,74	-465.194,01
IRBR3	198.868,68	83.691,27	80.811,93	0,72%	129.264,64	-109.378,22	29.154,15	-29.392,79
ITSA4	3.310.394,94	193.854,32	155.219,34	1,84%	628.975,04	-628.975,04	485.303,90	-489.276,37
ITUB4	8.739.378,31	654.397,64	613.896,43	7,29%	1.747.875,66	-1.660.481,88	1.281.192,86	-1.291.680,11
JBS3	1.963.400,62	387.635,62	351.729,78	4,18%	687.190,22	-687.190,22	287.834,53	-290.190,61
KLBN11	869.065,78	62.599,07	49.404,72	0,59%	217.266,45	-173.813,16	127.405,04	-128.447,92
LFT20250901 - 210100	909.722,06	329,56	301,30	0,00%	-2.338,56	3.009,13	-2,13	3,25
LEN3	934.550,82	134.420,85	141.439,90	1,09%	186.904,99	-186.910,16	137.005,15	-138.126,61
LWSA3	95.521,36	15.634,73	13.678,44	0,16%	38.206,26	-38.210,83	14.003,43	-14.118,06
MGLU3	186.220,60	52.899,79	50.288,11	0,60%	96.834,71	-83.799,27	27.299,94	-27.523,41
MRF3	223.859,68	45.303,61	38.825,29	0,46%	89.543,87	-67.157,90	32.817,83	-33.086,46
MRVE3	147.616,36	16.573,88	10.947,74	0,13%	44.284,91	-44.286,95	21.640,56	-21.817,70
MULT3	443.206,35	33.167,90	25.870,38	0,31%	132.961,91	-110.801,59	64.974,05	-65.505,90
NTCO3	648.281,05	67.809,27	-32.480,43	-0,39%	162.070,26	-162.070,26	95.038,00	-95.815,94
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PCAR3	58.151,22	9.889,66	8.978,91	0,11%	21.049,92	-21.051,98	8.524,97	-8.594,75
PETR3	5.223.106,35	548.436,75	437.945,28	5,20%	1.305.776,59	-1.566.931,91	765.707,39	-771.975,12
PETRA	8.668.507,25	873.961,52	748.643,55	8,89%	2.167.102,74	-2.600.576,25	1.270.803,16	-1.281.205,37
PETZ3	78.899,52	23.143,49	18.498,04	0,22%	29.980,15	-40.240,43	11.566,67	-11.661,35
PRIQ3	1.880.392,01	273.515,35	154.677,38	1,84%	996.607,77	-620.533,70	275.665,47	-277.921,94
RADL3	1.772.268,72	233.859,86	109.774,27	1,30%	354.453,74	-354.453,74	259.814,59	-261.941,32
RAIL3	1.321.200,00	246.506,88	171.106,58	2,03%	594.540,00	-435.996,00	193.687,92	-195.273,36
RAIZ4	200.907,90	26.078,84	19.390,93	0,23%	70.317,77	-70.317,77	29.453,10	-29.694,19
RDOR3	1.924.526,46	248.207,82	210.856,96	2,50%	587.873,46	-571.695,74	282.135,58	-284.445,01
RECV3	265.410,16	49.809,84	40.679,85	0,48%	159.246,10	-159.246,10	38.909,13	-39.227,62
RENT3	2.177.510,00	240.878,35	-53.885,76	-0,64%	718.578,30	-566.152,60	319.222,97	-321.835,98
SANB11	549.971,08	70.600,99	65.711,19	0,78%	109.994,22	-109.994,22	80.625,76	-81.285,73
Sbsp3	3.356.823,20	495.823,23	387.216,72	4,60%	839.205,80	-839.205,80	492.110,28	-496.138,47
SLECE3	192.064,60	13.225,73	2.662,37	0,03%	57.619,38	-57.620,44	28.156,67	-28.387,01
SMFO3	202.760,56	25.883,60	12.255,14	0,15%	60.828,17	-60.828,94	29.724,70	-29.968,01
STBP3	686.103,84	93.834,01	-31.090,40	-0,37%	240.136,34	-240.136,34	100.582,82	-101.406,15
SUBZ3	1.865.767,68	189.644,96	154.304,99	1,83%	466.441,92	-373.153,54	273.521,54	-275.766,46
TAEF11	406.634,24	25.451,80	24.274,85	0,29%	101.658,56	-101.658,56	59.612,58	-60.100,54
TIMS3	821.610,18	37.095,61	9.930,15	0,12%	262.915,26	-188.970,34	120.448,05	-121.433,99
TOTS3	838.064,64	98.126,72	85.514,26	1,02%	167.612,93	-167.612,93	122.860,28	-123.865,95
TRPL4	522.547,20	27.351,40	10.565,45	0,13%	104.509,44	-130.636,80	76.605,42	-77.232,48

## Relatório de Risco de Mercado



Data: 30/09/2024

**FUNDO:** FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI  
**CNPJ:** 41901874000163

Dados Gerais							
PL:	121.121.291,61	VAR / PL:	6,9542%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	3,51
VAR:	8.422.969,95	ETL / PL:	8,7208%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	2,72
ETL:	10.562.744,13	VAR / CDI:	0,0763%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	30.740.817,78	Cenário Baixa - 10000 (+):	160.805,57	CENARIO BRADESCO 1 (+):	17.671.643,30	CENARIO BRADESCO 2 (+):	127.931,60
Cenário Alta - 09999 (-):	-160.241,16	Cenário Baixa - 10000 (-):	-30.989.234,83	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-127.045,18	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-17.815.784,48
Cenário Alta - 09999:	30.580.576,62	Cenário Baixa - 10000:	-30.828.429,27	CENARIO BRADESCO 1:	17.544.598,12	CENARIO BRADESCO 2:	-17.687.852,88

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
UGPA3	1.256.034,99	139.590,74	129.850,08	1,54%	314.008,75	-251.207,00	184.134,73	-185.641,97
USIM5	174.645,12	30.653,77	1.391,90	0,02%	68.111,60	-38.421,93	25.602,98	-25.812,55
VALE3	14.735.082,12	1.049.954,41	-507.901,41	-6,03%	3.683.770,53	-3.683.770,53	2.160.163,04	-2.177.845,14
VAM03	174.246,21	38.767,90	24.855,03	0,30%	60.986,17	-69.698,48	25.544,49	-25.753,59
VBBR3	1.300.923,00	181.554,41	166.304,61	1,97%	325.230,75	-325.230,75	190.715,31	-192.276,42
VIV3	184.201,20	15.386,79	12.185,54	0,14%	55.260,36	-55.260,36	27.003,90	-27.224,94
VIVT3	1.234.738,40	40.998,91	10.260,81	0,12%	185.210,76	-185.212,97	181.012,65	-182.494,34
WEGE3	3.749.755,38	428.833,79	320.324,85	3,80%	942.609,50	-934.336,46	549.714,14	-554.213,85
WINV24	5.002,80	63.825,26	-63.787,19	-0,76%	-157.874,72	157.768,00	-127.043,05	127.928,35
YDUQ3	144.770,07	17.145,68	-2.069,68	-0,02%	56.460,33	-36.192,52	21.223,29	-21.397,02
<b>Total Var:</b>	<b>121.120.830,41</b>	<b>13.038.241,73</b>	<b>8.422.969,95</b>	<b>99,98%</b>	<b>30.580.576,62</b>	<b>-30.828.429,27</b>	<b>17.544.598,11</b>	<b>-17.687.852,89</b>

## Relatório de Risco de Mercado



Data: 30/09/2024

**FUNDO:** FIA EMB VIII ETF  
**CNPJ:** 45622039000189

Dados Gerais							
PL:	90.626.970,92	VAR / PL:	7,2907%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	1,00
VAR:	6.607.350,68	ETL / PL:	9,1428%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1,00
ETL:	8.285.884,31	VAR / CDI:	0,08%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	8.132.105,41	Cenário Baixa - 10000 (+):	2,78	CENARIO BRADESCO 1 (+):	6.623.185,22	CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00
Cenário Alta - 09999 (-):	-2,72	Cenário Baixa - 10000 (-):	-8.132.139,00	CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-6.677.404,59
Cenário Alta - 09999:	8.132.102,69	Cenário Baixa - 10000:	-8.132.136,22	CENARIO BRADESCO 1:	6.623.185,22	CENARIO BRADESCO 2:	-6.677.404,59

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
BOVA11	45.335.787,41	3.316.863,83	3.316.507,07	50,19%	0,00	0,00	0,00	0,00
BOVV11	45.178.550,00	3.291.202,49	3.290.842,95	49,81%	8.132.105,41	-8.132.139,00	6.623.175,43	-6.677.389,69
CAIXA	9.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA PRE	95.244,79	0,80	0,66	0,00%	-2,72	2,78	9,79	-14,90
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	8.386,04	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
<b>Total Var:</b>	<b>90.626.968,24</b>	<b>6.608.067,12</b>	<b>6.607.350,68</b>	<b>100,00%</b>	<b>8.132.102,69</b>	<b>-8.132.136,22</b>	<b>6.623.185,22</b>	<b>-6.677.404,59</b>

## 3. RISCO DE CRÉDITO

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

### 3.1. Relatório de Risco de Crédito

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2024



## RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/09/2024

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	18/05/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	698.602,91	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	258.716,75	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	03/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	155.230,05	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	20/06/16	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	517.413,46	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	18/12/17	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	2.706.803,21	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	21/12/17	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	790.131,36	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/01/18	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	2.802.692,52	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB II	19/02/18	19/02/18	15/02/25	SABESP	5.038.913,06	brAAA	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/02/18	19/02/18	15/02/25	SABESP	3.127.196,01	brAAA	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	13/03/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	13.575.133,01	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB II	23/05/18	23/05/18	15/05/28	COMGAS	27.074.026,73	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	668.679,93	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	668.679,93	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	668.679,93	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	667.561,75	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	668.679,93	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	04/07/18	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	6.394.871,38	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	26/07/18	26/07/18	15/07/25	AEGEA SA	7.375.642,29	brAA	Aa1.br	AA(bra)
FI RF EMB II	26/07/18	26/07/18	15/07/25	CSMG	5.511.773,90	-	Aa3.br	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/02/13	15/02/25	CEMG	721.329,21	brA+	A1.br	AA-(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	577.990,77	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	3.659.681,99	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	2.084.101,36	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	6.300.933,11	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	738.830,93	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	5.977.813,92	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	8.865.971,21	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	913.463,70	-	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	632.177,41	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	30/09/20	28/09/20	22/09/25	HAPVIDA	84.899,28	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	6.571.849,55	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	6.583.076,30	brAA	-	AA(bra)
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	4.557.772,09	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/07/19	15/06/29	NEOENERG	648.268,78	brAAA+	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/07/19	15/06/29	NEOENERG	6.444.115,20	brAAA+	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	1.887.353,68	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	3.617.354,88	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	3.870.208,51	brAAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	31/07/20	15/07/34	IGUA SAN	2.618.736,17	brAA	-	-
FI RF EMB II	12/02/21	23/05/18	15/05/28	COMGAS	23.578.762,97	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	258.893,04	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	455.651,75	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	517.786,08	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	258.893,04	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	316.885,08	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	267.639,51	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	15/10/12	15/10/24	TRANS AL	776.516,95	brAA-	Aaa.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	26/10/16	27/01/25	BRADESCO	15.684.172,82	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	12/12/17	15/11/24	CCR	3.283.333,12	brAAA	-	AA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	14/12/17	15/11/24	ECORODOV	2.251.436,44	brAA	A2.br	-
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	19/02/18	15/02/25	SABESP	734.423,44	brAAA	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	23/05/18	15/05/28	COMGAS	10.479.339,82	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	28/06/18	15/06/27	JAGUARA	1.401.623,46	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	28/06/18	15/06/27	ENERGMIR	913.609,04	-	-	AAA(bra)
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	31/07/18	01/08/25	BRADESCO	5.044.604,75	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	22/12/20	15/12/26	IRB	2.801.403,13	brAAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	390.567,79	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	07/04/21	15/03/31	LOCALIZA	5.410.375,51	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/06/21	06/01/21	15/11/25	QUATA	599.596,15	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	219.884,16	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	342.462,97	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	342.462,97	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	193.799,70	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	393.901,84	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	387.993,31	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	893.051,97	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	26/12/19	25/11/24	DASA	223.003,08	-	-	AA
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	1.026.684,25	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	14/06/21	19/06/19	16/12/24	BNBM	620.681,63	brAAA	AAbr	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	14/06/21	12/06/19	09/12/24	BNBM	940.519,64	brAAA	AAbr	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	16/06/21	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	373.730,11	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	17/06/21	18/03/21	15/02/26	CORSAN	509.549,98	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	25/06/21	25/06/21	20/06/26	OURO VER	1.470.293,23	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	1.795.572,96	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	01/07/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	3.031.906,99	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/07/21	01/03/21	18/02/25	RENNER	558.025,59	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/07/21	01/03/21	18/02/25	RENNER	118.014,53	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/07/21	07/04/21	15/03/29	CAGECE	1.272.493,49	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	08/07/21	08/07/21	15/06/31	VAMOS	269.211,71	brAAA+	-	AAA(bra)

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2024



## RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/09/2024

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/07/21	07/04/21	15/03/29	CAGECE	2.900.074,36	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	12/07/21	12/07/21	12/07/26	BRADESCO	4.756.083,23	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	2.200.383,97	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	1.068.757,93	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	555.754,12	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	22.141,22	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	4.400.767,93	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	807.318,24	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/07/21	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	12.647,92	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.030.062,78	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	880.748,59	-	-	AA-(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	20/09/19	20/08/26	VAMOS	693.874,40	brAA+	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	23/07/21	18/06/21	15/12/30	MG050	600.197,52	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	29/07/21	07/11/19	15/10/24	BKBR	1.070.875,97	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/07/21	23/12/20	15/12/26	RD COLIN	2.142.074,96	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	04/08/21	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	369.281,66	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	06/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	654.852,00	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	11/08/21	11/08/21	15/08/31	CSAN	1.051.292,74	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	11/08/21	19/11/19	15/06/27	AUTOPIST	1.022.758,03	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	17/08/21	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	2.898.961,15	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	18/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	1.214.665,84	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	18/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	942.570,27	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	27/08/21	27/08/21	20/08/31	S LUZ A	1.043.377,64	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	686.531,39	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	61.480,42	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	307.402,11	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	12/05/21	15/04/26	ELETROB	2.083.699,64	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/09/21	22/10/19	21/10/26	AUTOBAN	471.070,08	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/09/21	20/09/21	15/09/29	MOV_PART	1.036.563,64	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.017.283,93	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	18/06/21	15/12/30	MG050	1.017.283,93	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	20/09/21	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	1.107.446,07	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	840.217,79	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	867.170,38	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	288.275,56	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	18/03/21	15/02/31	CORSAN	288.275,56	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	823.435,07	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	823.435,07	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	1.058.120,85	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	411.039,25	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	411.039,25	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	23/09/21	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	3.552.948,89	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	23/09/21	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	4.306.604,72	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	30/09/21	30/09/21	15/09/31	SIMPAP	856.219,78	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	04/10/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	643.134,97	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/10/21	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	2.323.439,82	-	-	AA-(bra)
FIM EMB I A	20/10/21	20/10/21	20/10/25	DAYCOVAL	3.029.451,25	brAA+	AA.br	AA(bra)
FIM EMB I A	20/10/21	20/10/21	20/10/24	DAYCOVAL	1.669.663,75	brAA+	AA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	22/10/21	22/10/21	15/12/35	CART	903.310,50	brAA+	-	-
FIM EMB I A	27/10/21	27/10/21	15/10/29	CONT GLO	1.984.531,17	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	04/11/21	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	3.341.119,77	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/11/21	10/11/21	15/10/28	LIGHT	369.375,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	12/11/21	12/11/21	15/10/31	VAMOS	2.183.487,77	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/11/21	27/07/21	01/10/24	ANEMUS	13.158,78	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/11/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	2.344.144,65	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/11/21	27/07/21	01/10/24	ANEMUS	2.560.697,84	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	03/12/21	11/06/19	09/12/24	BNBBM	621.283,96	brAAA	AAbr	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/12/21	06/12/21	15/12/35	TESC	289.471,73	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/12/21	06/01/21	15/11/25	QUATA	2.685.772,75	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/12/21	20/12/21	15/11/35	ORIZON	2.246.286,91	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/01/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	1.128.858,60	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/02/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	102.562,53	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	715.609,61	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	774.266,14	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/03/22	27/07/21	01/10/24	ANEMUS	1.175.078,71	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	19/04/22	19/04/22	16/04/29	VERT-10	144.827,32	-	-	AAAsf(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/04/22	26/04/22	15/04/50	LIGHT	988.000,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	632.221,23	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	12/05/22	12/05/22	15/04/27	BRKA	1.566.607,63	-	A+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	12/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.367.249,23	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/05/22	26/05/22	10/05/27	GUAR	1.003.735,65	-	-	A
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	528.672,83	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	1.051.543,37	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	03/03/22	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	3.230.029,79	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/03/22	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	1.090.345,80	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/03/22	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	540.197,40	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/03/22	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	2.865.623,50	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/03/22	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	2.698.453,53	-	-	AA(bra)



# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2024



## RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/09/2024

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/06/22	06/12/21	15/12/35	TESC	862.483,41	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	422.938,27	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	06/12/21	15/12/35	TESC	540.979,96	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	27/07/21	01/10/24	ANEMUS	300.020,10	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	30/09/21	15/09/31	SIMPAP	1.843.125,73	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	08/07/21	15/06/31	VAMOS	916.601,78	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	08/07/21	15/06/31	VAMOS	74.781,03	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	732.650,41	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	828.478,64	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/06/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	1.030.229,47	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	3.419.543,13	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	12/11/21	15/10/31	VAMOS	2.111.432,67	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	12/11/21	15/10/31	VAMOS	1.583.028,63	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	28/07/22	28/07/22	18/07/25	1V11	1.681.496,33	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	29/07/22	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	1.781.667,46	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/08/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	1.306,31	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	07/04/21	15/03/29	CAGECE	1.572.862,49	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	07/04/21	15/03/29	CAGECE	2.620.661,33	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/09/22	02/09/22	02/09/29	AEGEA SA	1.726.653,68	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	27/09/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	56.171,32	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/09/22	28/09/22	28/09/27	B.BRASIL	4.381.276,00	-	AAA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/10/22	06/01/21	15/11/25	QUATA	39.189,29	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/11/22	08/11/22	15/06/42	BRK AMBI	2.780.583,25	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	11/11/22	11/11/22	15/10/40	RAHOLD	2.832.653,24	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	11/11/22	11/11/22	15/10/40	RAHOLD	7.370.420,17	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	3.646.484,56	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	1.752.665,16	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	1.435.068,12	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.203.765,66	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	01/12/22	27/07/21	01/10/24	ANEMUS	1.860.650,95	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	2.146.793,13	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	2.277.409,25	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	1.661.169,10	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/12/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	2.919.331,38	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	02/05/22	15/04/38	RDVE	405.570,19	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/12/22	27/07/21	01/10/24	ANEMUS	3.496.286,82	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	26/01/23	26/01/23	20/01/26	CELG	1.555.701,73	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/03/23	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	319.913,97	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	1.188.990,33	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	15/12/21	15/11/36	ITAPOA T	3.406.773,13	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	27/07/22	15/04/36	BRV_VDR	3.405.867,13	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	17/04/23	17/04/23	17/03/30	VERO	964.167,32	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/04/23	12/05/22	15/04/27	BRKA	1.189.520,19	-	Aa.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/04/23	12/05/22	15/04/27	BRKA	32.836,27	-	Aa.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/04/23	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	1.919.140,26	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	23/09/20	15/10/36	PAMPASUL	2.016.640,05	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	2.252.354,27	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	18/06/21	15/12/30	MG050	3.085.422,16	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	08/11/22	15/06/42	BRK AMBI	1.456.376,11	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	08/07/21	15/06/31	VAMOS	1.053.344,24	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	802.808,67	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	22/10/21	15/12/35	CART	1.548.532,28	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	2.468.992,95	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	02/10/20	15/09/34	BRKA	297.585,19	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	02/10/20	15/09/34	BRKA	2.840.484,22	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	18/03/21	15/02/31	CORSAN	1.653.482,98	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	22/10/21	15/12/35	CART	668.684,39	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	10/02/21	15/12/31	METRORIO	5.137.268,37	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/05/23	28/10/21	15/10/36	HOLDARAG	228.016,67	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/05/23	08/11/22	15/06/42	BRK AMBI	2.547.714,12	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/05/23	22/10/21	15/12/35	CART	2.205.485,37	brAA+	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.069.801,23	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	16/05/23	23/12/20	15/12/27	SABESP	2.345.702,99	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	21/07/21	15/07/31	CACHOEIR	1.750.925,88	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	29/10/21	15/10/26	COELBA	1.921.100,70	brAAA	-	-
FIM EMB I A	16/05/23	04/05/22	15/04/27	LOCALIZA	2.977.883,49	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/05/23	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	59.348,84	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/06/23	25/06/21	20/06/26	OURO VER	294.889,32	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/06/23	26/07/21	15/06/33	ASA BRAN	16.918,54	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	23/06/23	23/06/23	15/05/43	IGUA RJ	1.388.951,66	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/06/23	08/07/21	15/06/31	VAMOS	1.056.549,14	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/06/23	28/07/22	18/07/25	1V11	381.550,54	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/07/23	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	1.038.387,88	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/07/23	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	1.038.387,88	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/07/23	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	655.035,32	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/07/23	28/07/22	18/07/25	1V11	1.156.992,89	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/07/23	28/07/22	18/07/25	1V11	282.820,48	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/07/23	23/12/20	15/12/26	RD COLIN	1.596.035,23	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	752.722,43	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	752.722,43	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	15/12/21	15/11/36	ITAPOA T	2.618.590,44	-	AA.br	-

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2024



## RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/09/2024

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	26/07/21	15/06/33	ASA BRAN	2.567.165,63	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	01/08/23	31/07/23	25/07/28	TIMSA	2.465.827,33	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/23	17/04/23	17/03/30	VERO	1.315.167,56	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/23	06/12/21	15/12/35	TESC	2.025.115,78	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/23	02/05/22	15/04/38	RDVE	3.286.158,48	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/08/23	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.148.232,42	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/08/23	05/06/18	05/06/28	BRADESCO	4.344.633,15	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/08/23	08/08/23	15/01/34	SPERIO4	2.428.416,51	brA++	-	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	29/08/23	29/08/23	29/08/25	BRADESCO	11.365.145,77	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	30/08/23	30/08/23	01/09/25	VOLKSWAG	6.838.207,20	brAAA	AAA.br	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	08/09/23	08/09/23	08/09/25	B VOTORA	6.823.817,13	brAAA	AA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/09/23	06/01/21	15/11/25	QUATA	2.612,62	-	-	A(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	19/09/23	13/09/23	15/09/25	PANAMERI	5.634.365,01	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/09/23	21/09/23	15/09/28	ELETROB	2.587.499,17	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/09/23	28/09/23	15/09/30	CSMG	2.582.349,47	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/09/23	19/05/21	10/05/30	RODO BR	2.692.085,82	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/09/23	06/09/21	20/08/31	S LUZ A	1.492.815,36	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/09/23	13/09/23	15/09/25	B VOTORA	5.621.312,22	brAAA	AA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/10/23	14/11/22	10/10/31	CORREDOR	2.424.142,06	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/10/23	20/10/23	20/10/28	SANTANDE	4.563.243,88	-	AAA.br	A-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/11/23	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	3.012.470,00	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/11/23	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	1.509.709,57	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/11/23	18/03/21	15/02/31	CORSAN	3.086.657,82	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/11/23	10/12/19	15/07/34	RT BANDE	3.142.541,03	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/11/23	18/06/21	15/12/30	MG050	925.728,38	brA++	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	17/11/23	23/08/22	15/08/32	PETRJ	4.316.842,01	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	23/11/23	29/09/22	15/09/28	VERT5	2.507.790,36	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	23/11/23	10/12/21	17/11/28	DESKTOP	2.679.241,47	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/12/23	12/02/21	15/12/35	MS 306	1.081.503,41	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/12/23	02/10/20	15/09/34	BRKA	1.012.460,90	-	Aa3.br	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	26/12/23	27/12/22	02/06/26	BRADESCO	10.951.791,04	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	08/01/24	08/01/24	08/01/26	DAYCOVAL	10.880.040,12	brA++	AA.br	AA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	08/01/24	08/01/24	08/01/26	B.ALFA	10.875.458,40	-	AAA.br	AA+(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	08/01/24	08/01/24	08/01/26	ABC	10.912.426,39	brAAA	AA+.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	17/04/23	17/03/30	VERO	2.889.251,97	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	2.106.911,89	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	27/02/20	15/12/34	VIARONDO	2.106.911,89	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	25/03/22	15/03/44	GBS PART	1.156.888,17	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	25/03/22	15/03/44	GBS PART	1.962.578,14	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	959.472,88	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	1.920.044,82	brA	-	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	11/01/24	27/12/22	02/06/26	BRADESCO	11.513.546,48	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	18/01/24	18/01/24	04/01/27	TOYOTA	6.526.828,93	brAAA	-	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	24/01/24	24/01/24	26/01/26	ABC	10.855.127,73	brAAA	AA+.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	24/01/24	24/01/24	25/01/27	BTG PACT	4.646.565,32	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	25/01/24	25/01/24	26/01/26	BTG PACT	6.951.247,38	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/01/24	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	1.069.791,56	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/01/24	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.191.108,13	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	30/01/24	28/04/21	15/04/31	MANAUSEN	2.505.368,47	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	30/01/24	01/06/23	25/05/26	LMTRANS	2.637.404,14	-	AA+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	30/01/24	27/10/21	15/10/29	CONT GLO	2.517.930,04	-	-	AA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	31/01/24	31/01/24	02/02/26	B.ALFA	11.441.703,48	-	AAA.br	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/02/24	08/02/24	15/09/31	PLANALTO	2.403.390,76	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	15/02/24	15/02/24	15/12/43	AGUAS SE	2.195.121,07	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/02/24	12/11/21	30/04/29	HAPVIDA	568.957,13	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/02/24	18/03/21	15/02/26	CORSAN	1.278.970,44	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/02/24	07/11/19	15/10/24	BKBR	1.559.937,43	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/02/24	19/04/22	16/04/29	VERT-10	561.701,86	-	-	AAAsf(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/02/24	07/04/21	15/03/26	CAGECE	1.845.430,32	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/02/24	24/03/22	11/03/27	ARTERIS	2.489.341,24	brA++	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/02/24	16/02/24	15/02/34	NTRASSUD	2.672.514,56	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	283.555,56	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	18/06/21	15/12/30	MG050	289.925,92	brA++	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	02/05/22	15/04/38	RDVE	830.638,95	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	788.111,18	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	283.555,56	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	12/02/21	15/12/35	MS 306	317.749,40	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	1.000.955,99	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	500.478,00	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	10/02/21	15/12/31	METRORIO	494.719,20	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	15/12/21	15/11/36	ITAPOA T	407.770,55	-	AA.br	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	26/02/24	26/02/24	01/03/27	BTG PACT	11.409.318,17	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	05/03/24	05/03/24	24/08/26	B VOTORA	6.975.463,15	brAAA	AA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	12/03/24	23/09/21	15/09/31	LOCAMERI	2.009.031,10	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/03/24	23/06/23	15/05/43	IGUA RJ	1.231.537,14	brA++	-	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	05/04/24	05/04/24	06/04/26	PSA	6.875.198,02	-	AAA.br	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	16/05/24	16/05/24	18/05/26	BANSICRE	3.450.637,32	brAAA	AAA.br	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/05/24	10/11/21	30/10/31	DASA	1.656.418,75	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/06/24	18/06/24	10/06/29	OURO VER	634.518,35	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	02/07/24	21/09/23	15/09/31	ELETROB	2.954.563,01	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	03/07/24	26/06/24	15/06/34	FERROBAN	2.362.141,60	-	-	AAA(bra)



## RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/09/2024

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	17/07/24	17/07/24	15/07/34	CSMG	3.013.461,34	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/07/24	13/06/24	15/05/36	CELG	2.848.483,72	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/24	31/07/24	15/07/34	CELESCD	2.353.920,61	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	05/08/24	01/08/24	15/07/27	CEA MODA	1.460.042,05	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/08/24	06/08/24	15/03/43	BARUERI	1.989.909,13	brAA-	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	06/08/24	01/08/24	11/06/30	VIX LOGI	2.224.282,83	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/08/24	05/06/24	15/05/34	JALLES M	3.002.704,40	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	08/08/24	06/08/24	15/03/43	BARUERI	1.275.582,78	brAA-	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/08/24	13/08/24	15/07/31	BRASIL T	2.224.731,86	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/08/24	09/05/24	15/04/34	ENEVA	1.923.612,92	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	30/08/24	30/08/24	15/08/41	ROD TRIA	2.457.949,46	-	-	A+(bra)
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	-	VERDECARD FIDC SN6	777.777,78	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	-	FIDC VERDECARD SN8	1.375.000,00	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	-	RB CAP CREDIT AL SN3	482.998,79	brAA-(sf)	-	-
FIM EMB VII A CRED PRIV	-	-	-	INSS CONS PDL I FIDC	263.220,80	-	-	AAAsf(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO	-	-	-	DRIVER SIX FIDC SN	601.450,92	-	AAA.br	-

Observação: Em setembro 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** **5.090.851.363,12**

Tópico do Enquadramento	Limite	Aplicação Atual	Valor Limite	% Aplicado	Status
% do Segmento RF/PL PLANO	100,00%	4.479.933.667,25	5.090.851.363,12	88,00%	Enquadrado
% do PL em Títulos de Emissão do Tesouro Nacional e/ou do BACEN	100,00%	3.709.391.309,60	5.090.851.363,12	72,86%	Enquadrado
% do PL em Títulos RF1, exceto títulos do Tesouro Nacional	80,00%	770.542.357,65	4.072.681.151,18	15,14%	Enquadrado
% do PL em FIDC	20,00%	Verificar Rel. de Diversificação de FIDC's	1.018.170.287,80	0,00%	Enquadrado
% do PL em uma mesma pessoa jurídica não-financeira	10,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Não Financ.	509.085.143,90	0,00%	Enquadrado
% do PL em Instituições Financeiras	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Financ.	1.272.712.840,78	0,00%	Enquadrado
% de uma mesma Série de Debêntures	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Debêntures	1.272.712.840,78	0,00%	Enquadrado
% do PL em RV	70,00%	505.908.467,39	3.563.595.893,50	9,94%	Enquadrado
% do capital votante de uma empresa	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação RV	1.272.712.840,78	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Imobiliários	20,00%	75.941.371,41	1.018.170.287,80	1,49%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Empréstimos	15,00%	28.066.463,28	763.627.734,81	0,55%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Estruturados	20,00%	0,00	1.018.170.287,80	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos no Exterior	10,00%	0,00	509.085.143,90	0,00%	Enquadrado

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



# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2024



## RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE SETEMBRO DE 2024 À 30 DE SETEMBRO 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
24/09/2024	EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA	ITAU UNI	LIQUIDEZ	NTN-B	15/08/2028	Compra	6,6441%	6,6632%	6,6187%	6,9563%	-0,0191%	NÃO

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2024

## RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE SETEMBRO DE 2024 À 30 DE SETEMBRO 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
02-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	22,49	700,00	15.745,20	22,17	22,45	22,64	19.249,00
02-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPL6	9,44	2.800,00	26.419,45	9,24	9,39	9,49	5.747,00
02-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPL6	10,52	1.100,00	11.571,66	10,30	10,45	10,58	15.200,00
02-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	42,07	500,00	21.036,14	41,26	41,90	42,39	23.426,00
02-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	34,15	3.400,00	116.100,30	33,89	34,18	34,68	19.987,00
02-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	15,69	1.000,00	15.694,44	15,60	15,77	16,08	7.423,00
02-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	GGPS3	17,69	1.000,00	17.693,00	17,58	17,71	18,17	5.695,00
02-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,28	7.300,00	31.226,91	4,17	4,24	4,31	22.896,00
02-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,90	3.500,00	38.134,84	10,85	10,89	10,99	18.035,00
02-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	13,28	5.900,00	78.369,49	13,11	13,24	13,54	18.210,00
02-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	46,70	300,00	14.011,33	46,27	46,63	47,12	13.761,00
02-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	21,48	3.400,00	73.034,37	21,38	21,49	21,77	20.388,00
02-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	41,29	3.600,00	148.644,90	40,60	41,26	41,55	18.510,00
02-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT9	33,48	56,00	1.874,88	40,60	41,26	41,55	18.510,00
02-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	21,90	1.800,00	39.420,00	21,86	21,91	22,35	6.654,00
02-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	26,52	3.300,00	87.505,46	26,01	26,44	26,76	10.829,00
02-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	26,54	2.300,00	61.053,40	26,01	26,44	26,76	10.829,00
02-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	26,17	1.000,00	26.170,00	26,01	26,44	26,76	10.829,00
03-09-24	FIA RVA EMB II	Compra	STBP3	13,23	37.800,00	499.919,00	13,05	13,40	13,67	19.467,00
03-09-24	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	57,12	7.500,00	428.426,46	56,47	56,93	57,95	49.158,00
03-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	36,99	1.900,00	70.282,16	36,50	36,92	37,10	16.625,00
03-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	44,40	800,00	35.517,56	44,26	44,94	46,44	45.051,00
03-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	21,48	1.800,00	38.657,52	21,38	21,49	21,73	28.029,00
03-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	20,06	1.700,00	34.105,94	19,97	20,10	20,49	7.671,00
03-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	20,20	100,00	2.020,34	19,97	20,10	20,49	7.671,00
03-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	40,71	900,00	36.639,00	40,60	41,10	42,00	21.236,00
03-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	41,10	4.800,00	197.287,48	40,60	41,10	42,00	21.236,00
03-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	21,44	2.800,00	60.042,66	21,18	21,41	21,94	12.038,00
03-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	21,27	1.700,00	36.159,00	21,18	21,41	21,94	12.038,00
03-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	54,43	1.400,00	76.203,63	54,11	54,59	55,11	18.708,00
03-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	26,60	2.100,00	55.860,00	26,28	26,53	26,74	10.041,00
03-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	26,53	2.300,00	61.030,24	26,28	26,53	26,74	10.041,00
03-09-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	47,57	1.289,00	61.320,05	46,87	47,45	47,77	12.981,00
03-09-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	47,60	990,00	47.124,00	46,87	47,45	47,77	12.981,00
03-09-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQLT3	34,28	3.160,00	108.329,99	34,00	34,25	34,47	23.946,00
03-09-24	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	22,71	240,00	5.450,02	22,48	22,68	22,85	17.153,00
03-09-24	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	22,71	4.519,00	102.608,31	22,48	22,68	22,85	17.153,00
04-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	23,34	1.500,00	35.017,37	22,88	23,31	23,55	14.959,00
04-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	29,02	2.400,00	69.659,88	28,72	29,02	29,19	32.573,00
04-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	37,46	2.400,00	89.902,70	36,95	37,40	37,58	24.284,00
04-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	35,65	400,00	14.260,28	35,17	35,68	36,21	20.933,00
04-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	9,66	2.400,00	23.174,97	9,52	9,68	9,79	11.800,00
04-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	10,78	2.200,00	23.722,89	10,65	10,84	10,96	25.380,00
04-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	42,68	5.400,00	230.447,74	41,96	42,62	43,06	23.871,00
04-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	13,84	800,00	11.074,51	13,55	13,87	14,03	23.626,00
04-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	48,43	200,00	9.686,79	48,00	48,56	49,39	12.903,00
04-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	48,51	500,00	24.256,30	48,00	48,56	49,39	12.903,00
04-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	35,75	9.900,00	353.925,00	34,33	35,33	35,92	27.780,00
04-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	16,64	14.700,00	244.569,21	16,22	16,66	16,85	15.781,00
04-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	18,02	800,00	14.414,92	17,77	18,00	18,15	3.412,00
04-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,50	20.600,00	92.663,63	4,38	4,50	4,60	29.093,00
04-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	22,61	4.400,00	99.494,58	22,16	22,57	22,80	9.312,00
04-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	11,21	25.100,00	281.460,89	11,06	11,19	11,28	38.232,00
04-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	13,67	1.300,00	17.767,08	13,37	13,61	13,80	12.900,00
04-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	13,67	1.400,00	19.142,16	13,37	13,61	13,80	12.900,00
04-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	44,34	1.400,00	62.072,84	43,72	44,30	44,95	33.169,00
04-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	44,27	600,00	26.560,22	43,72	44,30	44,95	33.169,00
04-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	21,82	1.800,00	39.280,71	21,42	21,77	21,94	20.941,00
04-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	21,79	1.300,00	28.324,91	21,42	21,77	21,94	20.941,00
04-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	20,16	2.700,00	54.432,40	20,01	20,14	20,34	7.181,00
04-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	42,12	800,00	33.698,72	40,70	41,94	42,59	25.344,00
04-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	42,07	1.400,00	58.892,63	40,70	41,94	42,59	25.344,00
04-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	55,62	2.100,00	116.805,26	54,60	55,42	55,99	20.002,00
04-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	VIVA3	27,07	5.000,00	135.340,31	26,47	27,26	27,54	13.632,00
04-09-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	21,75	586,00	12.747,61	21,42	21,77	21,94	20.941,00
04-09-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	21,67	379,00	8.212,93	21,42	21,77	21,94	20.941,00
04-09-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	21,80	2.051,00	44.713,80	21,42	21,77	21,94	20.941,00
04-09-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	21,79	3.224,00	70.248,60	21,42	21,77	21,94	20.941,00
04-09-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	21,81	581,00	12.670,49	21,42	21,77	21,94	20.941,00
04-09-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	21,82	3.291,00	71.817,36	21,42	21,77	21,94	20.941,00
04-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	AURE3	11,41	3.300,00	37.653,00	11,34	11,39	11,45	8.978,00
04-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CXSE3	15,91	9.000,00	143.190,00	15,88	16,06	16,40	18.879,00
04-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	STBP3	13,95	11.000,00	153.464,00	13,86	14,03	14.718,00	
05-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	23,26	1.400,00	32.563,60	22,94	23,21	23,40	13.533,00
05-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	47,18	500,00	23.590,57	46,58	47,17	48,00	9.675,00
05-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	BBAS3	29,15	500,00	14.576,81	28,90	29,12	29,27	20.960,00
05-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBDC4	16,08	17.017,00	273.636,38	15,78	16,00	16,15	29.675,00
05-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	35,44	700,00	24.811,20	35,07	35,43	35,72	12.639,00
05-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPL6	9,68	2.262,00	21.895,16	9,58	9,73	9,81	12.873,00
05-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPL6	10,82	5.041,00	54.541,03	10,70	10,85	10,95	16.474,00
05-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPL6	10,91	3.500,00	38.189,38	10,70	10,85	10,95	16.474,00
05-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	42,24	1.931,00	81.567,44	41,96	42,25	42,76	13.325,00
05-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	13,99	1.500,00	20.985,00	13,81	13,95	14,02	15.546,00
05-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	35,09	1.293,00	45.367,19	34,71	35,02	35,56	21.254,00
05-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	16,75	1.200,00	20.100,00	16,38	16,66	16,80	8.450,00
05-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	16,73	800,00	13.384,00	16,38	16,66	16,80	8.450,00



# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2024

## RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE SETEMBRO DE 2024 À 30 DE SETEMBRO 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
05-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	18,16	700,00	12.712,70	17,92	18,13	18,24	7.532,00
05-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,54	24.497,00	111.328,89	4,46	4,54	4,60	22.500,00
05-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	22,44	2.800,00	62.825,01	22,17	22,37	22,71	9.077,00
05-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	11,18	2.600,00	29.060,06	11,06	11,14	11,23	21.357,00
05-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	13,87	2.100,00	29.137,15	13,47	13,80	14,04	11.383,00
05-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	43,97	409,00	17.981,96	43,52	43,83	44,21	28.640,00
05-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	43,79	500,00	21.893,67	43,52	43,83	44,21	28.640,00
05-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	43,91	2.600,00	114.163,67	43,52	43,83	44,21	28.640,00
05-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	43,77	300,00	13.132,48	43,52	43,83	44,21	28.640,00
05-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	43,78	600,00	26.265,15	43,52	43,83	44,21	28.640,00
05-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	21,78	2.200,00	47.925,56	21,44	21,71	21,88	18.688,00
05-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	20,03	1.200,00	24.032,29	19,98	20,07	20,25	7.799,00
05-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	20,02	600,00	12.014,89	19,98	20,07	20,25	7.799,00
05-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	20,07	839,00	16.841,57	19,98	20,07	20,25	7.799,00
05-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	42,32	1.200,00	50.780,67	41,79	42,25	42,50	21.960,00
05-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	22,49	900,00	20.238,10	22,06	22,40	22,58	9.838,00
05-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	54,95	1.400,00	76.929,46	54,51	54,94	55,47	18.466,00
05-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	10,00	1.900,00	18.992,02	9,78	9,99	10,20	15.270,00
05-09-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	48,15	4.789,00	230.597,54	47,83	48,81	49,59	10.830,00
05-09-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQT3	35,11	6.300,00	221.185,00	34,71	35,02	35,56	21.254,00
05-09-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ITUB4	37,49	5.900,00	221.209,00	37,14	37,40	37,60	22.663,00
05-09-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	21,77	9.148,00	199.151,96	21,44	21,71	21,88	18.688,00
05-09-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	21,71	45.741,00	993.056,75	21,44	21,71	21,88	18.688,00
05-09-24	FIA RVA EMB IV	Compra	UGPA3	23,18	19.100,00	442.790,00	22,71	23,14	23,32	25.317,00
06-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	23,02	1.400,00	32.227,36	22,92	23,04	23,38	11.082,00
06-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	47,00	300,00	14.100,00	46,92	47,27	47,94	6.003,00
06-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	47,35	2.400,00	113.645,38	46,92	47,27	47,94	6.003,00
06-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	47,12	1.100,00	51.836,57	46,92	47,27	47,94	6.003,00
06-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	BBA53	28,83	500,00	14.414,14	28,76	28,91	29,29	22.030,00
06-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	36,73	600,00	22.039,79	36,66	36,77	37,01	13.016,00
06-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	34,97	600,00	20.979,68	34,87	35,12	35,64	10.208,00
06-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPLÉ3	9,72	1.000,00	9.719,63	9,65	9,71	9,85	8.660,00
06-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPLÉ6	10,90	5.200,00	56.694,99	10,80	10,87	11,03	21.353,00
06-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	42,05	400,00	16.818,06	41,71	41,97	42,61	12.931,00
06-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	13,86	4.500,00	62.381,06	13,72	13,88	14,21	12.501,00
06-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	13,86	600,00	8.316,22	13,72	13,88	14,21	12.501,00
06-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	48,17	400,00	19.266,63	47,93	48,17	48,72	8.175,00
06-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQT3	34,89	2.300,00	80.239,71	34,70	34,91	35,34	20.648,00
06-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	16,68	2.800,00	46.712,34	16,54	16,68	16,87	8.328,00
06-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	18,11	700,00	12.679,14	17,97	18,12	18,38	7.366,00
06-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,52	5.500,00	24.847,78	4,48	4,52	4,59	21.367,00
06-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	22,03	600,00	13.218,00	21,98	22,11	22,46	8.399,00
06-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	22,09	1.800,00	39.768,04	21,98	22,11	22,46	8.399,00
06-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	22,13	2.900,00	64.175,10	21,98	22,11	22,46	8.399,00
06-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	11,13	2.700,00	30.053,17	11,09	11,13	11,22	19.330,00
06-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	MGLU3	11,91	1.100,00	13.097,10	11,76	12,03	12,51	23.279,00
06-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	13,84	2.600,00	35.979,97	13,50	13,75	14,13	11.396,00
06-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	14,02	1.000,00	14.020,00	13,50	13,75	14,13	11.396,00
06-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	43,08	1.700,00	73.242,91	42,40	42,95	43,87	26.163,00
06-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	42,62	500,00	21.309,76	42,40	42,95	43,87	26.163,00
06-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	21,65	1.500,00	32.475,00	21,56	21,71	21,90	26.422,00
06-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	21,58	1.200,00	25.901,64	21,56	21,71	21,90	26.422,00
06-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	19,61	3.300,00	64.709,87	19,28	19,58	20,18	9.985,00
06-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	42,07	1.300,00	54.695,96	41,92	42,19	42,81	21.016,00
06-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	22,55	1.100,00	24.802,57	22,04	22,31	22,66	12.531,00
06-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	54,41	1.400,00	76.175,23	54,24	54,62	55,42	14.584,00
06-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	9,63	1.200,00	11.558,11	9,53	9,75	10,22	11.475,00
06-09-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	21,63	1.472,00	31.834,57	21,56	21,71	21,90	26.422,00
06-09-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	21,70	8.340,00	180.940,72	21,56	21,71	21,90	26.422,00
06-09-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	21,70	1.708,00	37.063,60	21,56	21,71	21,90	26.422,00
09-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	22,92	1.100,00	25.212,29	22,80	22,91	23,03	9.854,00
09-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	46,60	300,00	13.980,00	46,15	46,51	47,45	7.838,00
09-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	46,55	1.500,00	69.826,31	46,15	46,51	47,45	7.838,00
09-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	BBA53	29,08	400,00	11.632,00	28,71	28,99	29,13	20.698,00
09-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	BBDC4	15,81	1.000,00	15.810,00	15,67	15,79	15,88	27.717,00
09-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	35,36	500,00	17.679,44	34,82	35,33	35,65	15.947,00
09-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ3	9,64	1.600,00	15.424,00	9,56	9,62	9,69	8.078,00
09-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ6	10,81	1.400,00	15.134,00	10,76	10,82	10,87	13.112,00
09-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	41,74	700,00	29.217,00	41,55	41,75	42,05	11.382,00
09-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQT3	34,56	1.400,00	48.385,51	34,51	34,66	34,95	10.337,00
09-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	16,58	1.000,00	16.580,00	16,55	16,65	16,77	9.429,00
09-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	16,72	6.000,00	100.333,92	16,55	16,65	16,77	9.429,00
09-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,46	3.900,00	17.394,00	4,42	4,46	4,50	25.804,00
09-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	21,84	1.300,00	28.392,40	21,73	21,83	22,10	10.059,00
09-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	21,82	3.400,00	74.203,37	21,73	21,83	22,10	10.059,00
09-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	21,85	2.100,00	45.876,00	21,73	21,83	22,10	10.059,00
09-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	11,23	2.000,00	22.458,03	11,10	11,20	11,27	19.973,00
09-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	13,62	1.500,00	20.434,90	13,52	13,60	13,71	8.754,00
09-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	42,18	2.500,00	105.456,70	41,92	42,17	42,77	26.088,00
09-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	42,13	500,00	21.066,00	41,92	42,17	42,77	26.088,00
09-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	21,37	6.100,00	130.357,00	21,26	21,34	21,70	14.202,00
09-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	21,43	3.500,00	75.005,00	21,26	21,34	21,70	14.202,00
09-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	21,30	1.700,00	36.210,56	21,26	21,34	21,70	14.202,00
09-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	21,35	2.600,00	55.500,91	21,26	21,34	21,70	14.202,00
09-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	19,07	4.900,00	93.435,41	18,91	19,07	19,35	13.098,00
09-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	41,75	1.000,00	41.745,00	41,55	41,80	42,50	18.759,00

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2024

## RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE SETEMBRO DE 2024 À 30 DE SETEMBRO DE 2024



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
09-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT9	33,48	23,00	770,04	41,55	41,80	42,50	18.759,00
09-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	22,34	900,00	20.106,00	22,01	22,32	22,51	5.374,00
09-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	54,18	1.100,00	59.594,00	54,01	54,27	54,65	13.818,00
10-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	41,46	2.000,00	82.921,69	40,54	41,42	42,40	40.173,00
10-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	21,39	1.000,00	21.388,99	21,05	21,40	21,62	24.595,00
10-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	18,73	4.300,00	80.520,77	18,52	18,74	19,01	10.530,00
10-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	22,64	6.200,00	140.387,15	22,17	22,63	22,79	10.296,00
10-09-24	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	11,14	19.500,00	217.320,00	11,06	11,13	11,17	6.933,00
10-09-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQLT3	34,45	3.922,00	135.097,80	34,26	34,46	34,64	20.400,00
10-09-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQLT3	34,50	2.336,00	80.592,00	34,26	34,46	34,64	20.400,00
10-09-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	26,52	2.479,00	65.740,81	25,60	26,33	26,72	21.768,00
10-09-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	26,49	2.000,00	53.000,00	25,60	26,33	26,72	21.768,00
11-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,52	9.000,00	40.682,98	4,50	4,52	4,56	16.199,00
11-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	42,70	4.700,00	200.674,75	42,20	42,73	43,28	36.048,00
11-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	22,91	5.300,00	121.422,46	22,54	22,75	23,08	7.826,00
12-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	16,60	2.300,00	38.180,00	16,38	16,54	16,65	5.923,00
12-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	42,63	900,00	38.366,84	42,00	42,59	43,23	21.835,00
12-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	18,66	1.600,00	29.855,45	18,58	18,68	18,96	6.491,00
13-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	14,78	8.100,00	119.693,79	14,25	14,55	14,89	13.334,00
13-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	14,77	3.500,00	51.691,50	14,25	14,55	14,89	13.334,00
13-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	43,44	2.300,00	99.903,61	42,73	43,43	43,89	23.680,00
13-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	21,22	4.800,00	101.862,94	21,01	21,21	21,42	17.450,00
13-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	21,24	2.800,00	59.472,00	21,01	21,21	21,42	17.450,00
13-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	19,01	5.300,00	100.737,11	18,72	18,99	19,12	6.049,00
13-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	43,86	6.900,00	302.613,93	42,23	43,79	44,20	30.311,00
13-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	10,94	3.800,00	41.571,52	10,45	10,91	11,10	10.739,00
16-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	47,80	300,00	14.341,20	47,41	47,83	48,31	4.928,00
16-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	BBDC4	15,39	7.900,00	121.576,99	15,29	15,40	15,60	33.515,00
16-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	BBSE3	36,26	400,00	14.505,00	36,04	36,25	36,44	14.320,00
16-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	41,94	400,00	16.776,92	41,51	42,03	42,42	14.422,00
16-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	34,09	600,00	20.455,56	34,01	34,12	34,28	20.796,00
16-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	GGPS3	18,69	800,00	14.955,79	18,46	18,68	18,76	6.075,00
16-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,70	23.600,00	110.868,92	4,59	4,66	4,75	39.359,00
16-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,64	31.900,00	148.025,02	4,59	4,66	4,75	39.359,00
16-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	22,60	1.200,00	27.123,28	22,21	22,55	22,68	10.938,00
16-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	42,98	2.100,00	90.255,43	42,74	43,07	43,80	15.196,00
16-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	42,94	400,00	17.175,52	42,74	43,07	43,80	15.196,00
16-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	21,16	1.000,00	21.164,39	21,01	21,14	21,25	17.749,00
16-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	18,80	1.500,00	28.193,35	18,62	18,81	19,31	5.670,00
16-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	44,00	400,00	17.599,16	43,79	44,08	44,60	17.011,00
16-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	22,90	600,00	13.741,95	22,75	22,98	23,48	10.579,00
16-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	53,26	3.900,00	207.702,86	52,83	53,27	54,43	19.416,00
16-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	53,14	600,00	31.885,32	52,83	53,27	54,43	19.416,00
16-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	10,86	1.400,00	15.205,63	10,73	10,86	10,99	9.253,00
16-09-24	FIA RVA EMB IV	Venda	EQLT3	34,08	6.400,00	218.093,00	34,01	34,12	34,28	20.796,00
16-09-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	EVBI11	9,94	3.238,00	32.189,62	9,91	9,94	10,03	58,00
16-09-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	MAXR11	74,80	1.264,00	94.547,20	74,80	74,86	75,00	83,00
16-09-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	OULG11	29,78	396,00	11.791,68	29,72	29,78	30,30	38,00
16-09-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	PATC11	35,30	802,00	28.306,77	35,04	35,37	35,95	68,00
16-09-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	QAGR11	46,82	1.079,00	50.514,04	46,60	46,83	47,22	344,00
16-09-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	SARE11	39,30	1.433,00	56.316,90	39,29	39,75	40,43	303,00
16-09-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	XPPR11	17,81	6.238,00	111.068,73	17,70	17,80	17,94	969,00
17-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	14,20	2.900,00	41.175,15	13,78	14,14	14,27	24.670,00
17-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQLT3	33,81	3.600,00	121.703,36	33,66	34,00	34,07	33.794,00
17-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	42,98	700,00	30.084,29	42,52	43,10	43,37	14.490,00
17-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	43,10	600,00	25.861,90	42,52	43,10	43,37	14.490,00
17-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	18,80	1.300,00	24.440,00	18,46	18,72	18,88	4.829,00
17-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	18,70	1.500,00	28.046,50	18,46	18,72	18,88	4.829,00
17-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	44,00	4.600,00	202.382,74	43,16	44,06	44,39	19.270,00
17-09-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	20,97	3.304,00	69.273,68	20,84	20,95	21,14	24.420,00
17-09-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	20,94	3.442,00	72.090,89	20,84	20,95	21,14	24.420,00
18-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,63	35.000,00	162.010,02	4,56	4,63	4,74	44.076,00
18-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	45,08	4.600,00	207.373,41	43,80	45,10	45,97	39.378,00
18-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	11,01	17.600,00	193.772,29	10,82	10,97	11,18	12.408,00
18-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	11,03	900,00	9.925,34	10,82	10,97	11,18	12.408,00
18-09-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	20,87	1.172,00	24.463,98	20,65	20,83	21,05	27.995,00
18-09-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	20,85	4.015,00	83.722,92	20,65	20,83	21,05	27.995,00
19-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT9	32,50	18.356,00	596.570,00	33,34	33,52	33,93	15.435,00
19-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	GGPS3	19,18	1.400,00	26.853,80	19,07	19,19	19,34	8.542,00
19-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	GGPS3	19,21	1.600,00	30.736,00	19,07	19,19	19,34	8.542,00
19-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	GGPS3	19,20	7.700,00	147.840,00	19,07	19,19	19,34	8.542,00
19-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	22,19	3.600,00	79.884,00	21,95	22,18	22,81	8.664,00
19-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	22,04	5.600,00	123.408,96	21,95	22,18	22,81	8.664,00
19-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	44,08	2.300,00	101.393,49	42,92	43,75	44,37	33.912,00
19-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	20,52	2.400,00	49.246,11	20,38	20,52	20,76	20.266,00
19-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	20,50	3.000,00	61.485,97	20,38	20,52	20,76	20.266,00
19-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	18,57	800,00	14.858,76	18,50	18,63	19,03	6.174,00
19-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	10,90	7.500,00	81.758,33	10,54	10,82	11,08	12.036,00
19-09-24	FIA RVA EMB IV	Venda	EQLT9	32,50	27.864,00	905.580,00	33,34	33,52	33,93	15.435,00
19-09-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	20,53	5.255,00	107.869,76	20,38	20,52	20,76	20.266,00
19-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Venda	EQLT9	32,50	3.378,00	109.785,00	33,34	33,52	33,93	15.435,00
20-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	6,97	600,00	4.184,71	6,84	6,98	7,26	
20-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	7,01	1.800,00	12.609,39	6,84	6,98	7,26	
20-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	32,84	500,00	16.420,97	32,60	32,76	33,44	
20-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	32,85	5.300,00	174.087,66	32,60	32,76	33,44	
20-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	GGPS3	18,95	2.600,00	49.270,47	18,58	18,74	19,16	

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2024

## RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE SETEMBRO DE 2024 À 30 DE SETEMBRO DE 2024



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
20-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	GGPS3	18,74	3.900,00	73.079,36	18,58	18,74	19,16	
20-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	21,24	900,00	19.116,00	21,18	21,43	22,13	
20-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	21,38	3.600,00	76.973,37	21,18	21,43	22,13	
20-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	19,95	4.100,00	81.779,33	19,74	19,96	20,44	
20-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	22,01	1.800,00	39.621,89	21,86	22,13	23,09	
20-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	10,13	5.100,00	51.669,31	9,89	10,13	10,56	
20-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	10,40	900,00	9.360,00	9,89	10,13	10,56	
20-09-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	19,91	1.729,00	34.423,94	19,74	19,96	20,44	
20-09-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	20,03	692,00	13.860,76	19,74	19,96	20,44	
20-09-24	FIA RVA EMB IV	Venda	RAIL3	19,96	2.478,00	49.453,64	19,74	19,96	20,44	
23-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	22,15	1.900,00	42.082,46	21,91	22,12	22,30	11.701,00
23-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	7,10	3.700,00	26.265,78	6,93	7,09	7,19	10.443,00
23-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	BBDC4	14,41	26.500,00	381.848,17	14,33	14,41	14,68	36.128,00
23-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	35,18	400,00	14.070,05	34,85	35,16	35,36	16.713,00
23-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	32,69	4.200,00	137.303,48	32,39	32,74	33,49	26.433,00
23-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPLÉ3	9,24	1.900,00	17.564,64	9,21	9,25	9,38	6.765,00
23-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ6	10,37	17.100,00	177.259,02	10,31	10,36	10,46	19.736,00
23-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	39,58	700,00	27.702,91	39,13	39,52	39,70	18.877,00
23-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	13,85	7.000,00	96.974,81	13,79	13,86	14,12	18.699,00
23-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	13,83	1.800,00	24.894,00	13,79	13,86	14,12	18.699,00
23-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	13,84	1.300,00	17.990,14	13,79	13,86	14,12	18.699,00
23-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	45,28	4.100,00	185.661,95	45,11	45,33	45,80	12.569,00
23-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	45,32	500,00	22.660,00	45,11	45,33	45,80	12.569,00
23-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	45,30	2.700,00	122.310,00	45,11	45,33	45,80	12.569,00
23-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	16,09	1.300,00	20.921,52	16,05	16,12	16,36	9.075,00
23-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	GGPS3	18,63	700,00	13.043,03	18,40	18,62	18,71	3.309,00
23-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,22	51.600,00	217.650,58	4,18	4,21	4,36	32.331,00
23-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,91	2.900,00	31.633,28	10,87	10,91	10,97	22.961,00
23-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,91	41.800,00	455.978,27	10,87	10,91	10,97	22.961,00
23-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	13,67	200,00	2.734,66	13,39	13,66	13,88	14.316,00
23-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRIQ3	44,62	2.100,00	93.712,32	43,92	44,56	45,01	22.785,00
23-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	19,80	7.800,00	154.472,74	19,55	19,78	19,96	23.850,00
23-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	42,67	2.600,00	110.937,43	42,27	42,75	43,16	18.721,00
23-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	21,57	600,00	12.940,00	21,35	21,53	22,06	8.944,00
23-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	21,73	200,00	4.345,16	21,35	21,53	22,06	8.944,00
23-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	9,56	1.300,00	12.432,82	9,40	9,61	9,90	15.401,00
23-09-24	FIA RVA EMB IV	Compra	AURE3	10,59	4.606,00	48.757,60	1,70	10,60	1,78	
23-09-24	FIA RVA EMB IV	Compra	AURE3	10,60	1.616,00	17.129,25	1,70	10,60	1,78	
23-09-24	FIA RVA EMB IV	Compra	AURE3	10,58	2.627,00	27.803,02	1,70	10,60	1,78	
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ABEV3	12,75	3.140,00	40.034,94	12,65	12,77	12,86	30.192,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ALOS3	22,18	360,00	7.983,40	21,91	22,12	22,30	11.701,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ASAI3	7,86	970,00	7.624,04	7,67	7,82	7,92	20.414,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	AURE3	10,60	2.130,00	22.578,00	1,70	10,60	1,78	
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	AZUL4	5,36	230,00	1.232,96	4,84	5,22	5,47	19.965,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	AZZA3	45,21	90,00	4.068,60	43,78	44,72	45,37	8.863,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	B3SA3	11,20	3.940,00	44.128,04	11,19	11,30	11,55	58.475,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBA53	27,40	2.040,00	55.896,00	27,27	27,51	27,55	28.709,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBDC3	12,93	1.060,00	13.705,94	12,89	12,94	13,24	8.554,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBDC4	14,37	3.670,00	52.738,23	14,33	14,41	14,68	36.128,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBSE3	35,13	460,00	16.159,94	34,85	35,16	35,36	16.713,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BEEF3	6,55	190,00	1.244,50	6,38	6,48	6,58	10.992,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BPAC11	32,79	920,00	30.167,32	32,39	32,74	33,49	26.433,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRAP4	18,28	180,00	3.290,46	18,05	18,29	18,41	10.067,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRAV3	17,90	330,00	5.908,60	17,78	18,05	18,35	16.091,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRFS3	24,83	580,00	14.402,18	24,64	24,81	25,08	13.159,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRKM5	18,75	190,00	3.563,04	18,45	18,74	19,17	8.982,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CCRO3	12,36	710,00	8.775,60	12,28	12,36	12,55	10.057,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CMIG4	11,53	1.320,00	15.220,36	11,47	11,55	11,63	12.712,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CMIN3	6,33	790,00	5.000,70	6,01	6,31	6,50	12.690,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	COGN3	1,29	1.340,00	1.728,65	1,29	1,31	1,34	25.691,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CPFE3	33,35	140,00	4.668,50	33,01	33,24	33,54	4.306,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CPLÉ6	10,34	1.200,00	12.408,19	10,31	10,36	10,46	19.736,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CRFB3	8,70	380,00	3.305,82	8,36	8,50	8,70	12.051,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CSAN3	12,25	830,00	10.167,66	12,25	12,33	12,55	34.231,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CSNA3	11,08	530,00	5.872,84	10,79	10,99	11,13	23.063,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CXSE3	14,39	570,00	8.202,60	14,30	14,39	14,58	14.663,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CYRE3	20,20	190,00	3.837,66	19,81	20,17	20,61	30.383,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	EGIE3	43,46	180,00	7.823,40	43,21	43,41	43,60	4.102,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ELET3	39,55	1.270,00	50.227,06	39,13	39,52	39,70	18.877,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ELET6	44,26	190,00	8.408,80	43,80	44,15	44,41	5.671,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	EMBR3	49,31	520,00	25.641,29	48,16	48,93	49,58	16.982,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ENEV3	13,85	1.130,00	15.651,28	13,79	13,86	14,12	18.699,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ENGI11	45,33	240,00	10.880,30	45,11	45,33	45,80	12.569,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	EQT3	32,50	890,00	28.924,28	32,26	32,49	32,71	17.247,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	FLRY3	16,10	330,00	5.312,52	16,05	16,12	16,36	9.075,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	GGBR4	17,74	890,00	15.788,08	17,63	17,74	18,02	17.482,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	GOAU4	10,36	480,00	4.972,76	10,27	10,31	10,38	8.453,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	HAPV3	4,23	3.420,00	14.466,33	4,18	4,21	4,36	32.331,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	HYPE3	27,10	290,00	7.858,60	26,79	27,03	27,33	11.604,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	IGT11	21,12	150,00	3.168,24	21,00	21,17	21,35	8.573,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	IRBR3	45,45	60,00	2.726,76	44,54	45,23	46,19	4.988,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ITSA4	10,90	3.940,00	42.946,08	10,87	10,91	10,97	22.961,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ITUB4	35,72	3.180,00	113.589,60	35,57	35,75	35,98	21.828,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	JBSS3	31,81	810,00	25.766,06	31,06	31,74	32,48	24.782,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	KIBN11	20,82	550,00	11.450,68	20,70	20,81	20,96	12.689,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	LEN3	17,71	680,00	12.042,60	17,58	17,73	18,04	23.853,00

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2024

## RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE SETEMBRO DE 2024 À 30 DE SETEMBRO 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
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	LWSA3	4,21	300,00	1.262,12	4,08	4,15	4,21	14.182,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	MGLU3	10,02	230,00	2.304,58	9,93	10,14	10,38	29.868,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	MRFG3	14,07	220,00	3.094,70	13,88	14,06	14,32	12.895,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	MIRVE3	7,30	160,00	1.168,18	7,20	7,30	7,40	13.599,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	MULT3	26,12	230,00	6.007,35	25,80	26,05	26,21	15.869,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	NTCO3	13,64	610,00	8.320,76	13,39	13,66	13,88	14.316,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PETR3	40,20	1.750,00	70.351,28	39,71	40,27	40,67	25.468,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PETRA	36,63	3.170,00	116.117,10	36,22	36,70	36,96	45.244,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PETZ3	4,65	220,00	1.023,24	4,51	4,62	4,70	10.262,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PRI03	44,58	570,00	25.411,77	43,92	44,56	45,01	22.785,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RADL3	26,85	920,00	24.703,10	26,64	26,78	26,85	9.012,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RAIL3	19,80	870,00	17.227,65	19,55	19,78	19,96	23.850,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RAIZ4	3,04	860,00	2.614,40	3,04	3,07	3,14	15.570,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RDOR3	31,79	820,00	26.067,50	31,38	31,70	32,49	20.950,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RECV3	18,35	200,00	3.669,88	18,25	18,38	18,55	8.489,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RENT3	42,71	620,00	26.480,75	42,27	42,75	43,16	18.721,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SANB11	28,89	260,00	7.510,50	28,56	28,91	29,58	9.814,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SBSF3	93,62	490,00	45.874,12	93,08	93,68	94,68	10.528,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SLCE3	17,05	140,00	2.386,45	16,87	17,01	17,09	8.988,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SMT03	26,89	100,00	2.688,78	26,60	26,92	27,40	6.480,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	STBP3	14,80	3.550,00	52.538,60	14,61	14,80	15,14	30.128,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SUZB3	51,65	450,00	23.243,45	51,17	51,57	52,10	24.064,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	TAEF11	34,30	160,00	5.488,03	34,05	34,23	34,39	6.621,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	TIMS3	18,73	580,00	10.863,90	18,62	18,72	18,81	17.186,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	TOTS3	28,60	380,00	10.868,06	28,45	28,65	29,09	11.244,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	TRPL4	24,38	290,00	7.070,20	24,28	24,38	24,51	7.531,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	UGPA3	21,11	780,00	16.465,38	21,02	21,15	21,34	21.529,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	USIM5	5,60	210,00	1.176,63	5,42	5,56	5,67	34.848,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VALE3	57,53	3.050,00	175.466,50	56,60	57,43	57,86	34.970,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VAMO3	6,60	350,00	2.310,00	6,42	6,54	6,64	16.512,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VBBR3	23,78	730,00	17.359,46	23,75	23,84	24,76	23.583,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VIVA3	27,27	90,00	2.454,06	26,85	27,27	27,72	12.680,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VIVT3	54,93	290,00	15.929,84	54,54	54,99	55,24	8.931,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	WEGE3	54,32	910,00	49.429,60	52,39	53,75	54,32	18.050,00
23-09-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	YDUQ3	9,40	150,00	1.410,20	9,40	9,61	9,90	15.401,00
24-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	22,21	1.400,00	31.092,68	22,04	22,26	22,51	8.119,00
24-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	27,54	900,00	24.781,85	27,37	27,58	27,92	29.007,00
24-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	BBDC4	14,39	24.100,00	346.705,41	14,26	14,39	14,57	59.944,00
24-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	32,73	600,00	19.637,74	32,38	32,75	33,16	26.675,00
24-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPL6	9,23	2.100,00	19.386,77	9,19	9,26	9,34	2.926,00
24-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	10,31	7.700,00	79.372,04	10,23	10,31	10,43	15.578,00
24-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	39,74	900,00	35.765,66	39,43	39,85	40,50	21.930,00
24-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	13,97	1.500,00	20.960,40	13,85	14,06	14,44	13.444,00
24-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	45,52	5.000,00	227.600,00	44,92	45,43	45,82	13.452,00
24-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQLT3	32,49	2.200,00	71.484,33	32,15	32,52	32,90	21.441,00
24-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	16,11	1.400,00	22.553,49	15,97	16,10	16,33	9.976,00
24-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	4,28	3.300,00	14.126,99	4,25	4,28	4,35	44.675,00
24-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,90	2.700,00	29.436,20	10,83	10,91	11,05	20.591,00
24-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,90	16.300,00	177.633,44	10,83	10,91	11,05	20.591,00
24-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	13,60	1.300,00	17.680,00	13,46	13,61	13,80	10.346,00
24-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	13,57	2.400,00	32.563,19	13,46	13,61	13,80	10.346,00
24-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	13,55	800,00	10.840,00	13,46	13,61	13,80	10.346,00
24-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	46,35	700,00	32.441,67	45,31	46,05	46,61	33.568,00
24-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	20,03	2.200,00	44.057,52	19,87	19,98	20,17	19.201,00
24-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	18,57	900,00	16.714,99	18,46	18,59	18,92	5.944,00
24-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	42,70	700,00	29.889,69	42,27	43,17	44,04	24.150,00
24-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	42,76	2.200,00	94.071,38	42,27	43,17	44,04	24.150,00
24-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	21,68	1.700,00	36.850,27	21,45	21,66	21,84	5.245,00
24-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	52,99	1.600,00	84.778,46	51,86	52,87	53,27	25.792,00
24-09-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQLT3	32,25	517,00	16.674,99	32,15	32,52	32,90	21.441,00
24-09-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQLT3	32,55	1.437,00	46.780,22	32,15	32,52	32,90	21.441,00
24-09-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQLT3	32,56	2.242,00	73.003,26	32,15	32,52	32,90	21.441,00
24-09-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQLT3	32,64	1.926,00	62.869,66	32,15	32,52	32,90	21.441,00
24-09-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQLT3	32,25	115,00	3.709,20	32,15	32,52	32,90	21.441,00
24-09-24	FIA RVA EMB IV	Compra	EQLT3	32,43	201,00	6.517,88	32,15	32,52	32,90	21.441,00
24-09-24	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	23,85	558,00	13.307,42	23,57	24,01	24,30	19.702,00
24-09-24	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	24,03	2.245,00	53.952,47	23,57	24,01	24,30	19.702,00
24-09-24	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	24,06	1.116,00	26.847,89	23,57	24,01	24,30	19.702,00
24-09-24	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	23,94	1.502,00	35.956,30	23,57	24,01	24,30	19.702,00
24-09-24	FIA RVA EMB IV	Compra	VBBR3	24,11	1.365,00	32.903,92	23,57	24,01	24,30	19.702,00
25-09-24	FIA RVA EMB II	Venda	B3SA3	11,22	28.400,00	318.691,00	10,73	10,86	11,25	48.585,00
25-09-24	FIA RVA EMB II	Venda	CXSE3	14,51	5.500,00	79.809,30	14,43	14,54	14,59	9.902,00
25-09-24	FIA RVA EMB II	Compra	VALE3	60,77	9.000,00	546.903,01	60,42	60,81	61,25	45.468,00
25-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	21,92	1.000,00	21.924,66	21,82	21,98	22,37	8.676,00
25-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	7,17	3.400,00	24.365,41	7,08	7,16	7,26	7.866,00
25-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	AZZA3	43,35	400,00	17.338,07	42,94	43,50	45,03	6.557,00
25-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBDC4	14,46	900,00	13.017,86	14,35	14,44	14,53	40.162,00
25-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	35,30	600,00	21.177,05	35,20	35,40	35,71	16.500,00
25-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	32,67	500,00	16.336,14	32,38	32,73	32,92	16.002,00
25-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	9,18	2.700,00	24.797,74	9,11	9,14	9,27	4.842,00
25-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPL6	10,25	1.400,00	14.350,28	10,13	10,18	10,33	13.435,00
25-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	39,10	700,00	27.368,54	39,00	39,19	39,85	18.537,00
25-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	13,97	1.100,00	15.365,00	13,86	13,95	14,22	8.433,00
25-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	45,53	700,00	31.871,00	45,25	45,49	45,86	7.940,00
25-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	45,42	800,00	36.333,00	45,25	45,49	45,86	7.940,00
25-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	45,35	300,00	13.605,00	45,25	45,49	45,86	7.940,00

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – SETEMBRO 2024

## RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE SETEMBRO DE 2024 À 30 DE SETEMBRO 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
25-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQT13	32,48	1.300,00	42.218,44	32,30	32,47	32,71	21.199,00
25-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	15,86	1.100,00	17.441,40	15,74	15,87	16,09	10.243,00
25-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	GGPS3	18,57	1.000,00	18.566,95	18,42	18,57	18,79	4.697,00
25-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,05	8.400,00	34.020,00	4,03	4,10	4,31	25.772,00
25-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,09	36.100,00	147.748,42	4,03	4,10	4,31	25.772,00
25-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,15	13.400,00	55.609,85	4,03	4,10	4,31	25.772,00
25-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGT11	21,13	8.800,00	185.922,43	21,03	21,16	21,52	7.163,00
25-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	10,96	1.700,00	18.631,20	10,92	10,97	11,00	13.720,00
25-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	13,45	4.200,00	56.494,05	13,27	13,54	13,87	13.661,00
25-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	44,99	500,00	22.496,46	44,67	45,29	46,86	30.593,00
25-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	19,82	1.600,00	31.718,52	19,77	19,94	20,24	16.055,00
25-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	42,39	1.300,00	55.107,00	41,70	42,49	43,78	28.899,00
25-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	42,00	900,00	37.801,18	41,70	42,49	43,78	28.899,00
25-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	21,36	1.300,00	27.771,17	21,21	21,34	21,79	4.174,00
25-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	52,35	1.100,00	57.584,69	52,16	52,38	53,07	11.866,00
25-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	9,21	1.800,00	16.570,98	9,06	9,27	9,72	13.870,00
26-09-24	FIA RVA EMB II	Venda	CXSE3	14,70	6.900,00	101.396,00	14,59	14,68	14,83	16.677,00
26-09-24	FIA RVA EMB II	Venda	PRI03	43,06	3.300,00	142.095,59	42,46	42,98	43,91	49.163,00
26-09-24	FIA RVA EMB II	Compra	VALE3	63,45	8.100,00	513.911,40	62,45	63,64	64,38	119.589,00
26-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	21,96	1.600,00	35.133,01	21,75	21,93	22,17	8.133,00
26-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	AZZA3	42,84	400,00	17.135,62	42,33	42,75	43,48	5.518,00
26-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	27,52	1.000,00	27.515,08	27,28	27,47	27,66	31.820,00
26-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBDC4	14,76	1.200,00	17.706,20	14,48	14,74	14,84	59.678,00
26-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	33,01	800,00	26.410,32	32,68	33,08	33,50	22.575,00
26-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLE3	9,17	2.000,00	18.336,81	9,12	9,18	9,24	5.200,00
26-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLE6	10,25	5.500,00	56.358,24	10,14	10,23	10,32	12.588,00
26-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLE6	10,17	7.500,00	76.275,00	10,14	10,23	10,32	12.588,00
26-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	39,45	4.800,00	189.356,43	38,97	39,56	39,86	21.903,00
26-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	13,99	1.200,00	16.791,08	13,92	13,99	14,15	12.616,00
26-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	14,02	14.400,00	201.816,06	13,92	13,99	14,15	12.616,00
26-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	13,98	1.000,00	13.978,55	13,92	13,99	14,15	12.616,00
26-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	45,37	300,00	13.610,41	44,91	45,42	45,85	9.861,00
26-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQT13	32,61	4.600,00	150.008,98	32,34	32,60	32,87	20.641,00
26-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQT13	32,67	700,00	22.867,94	32,34	32,60	32,87	20.641,00
26-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	15,63	1.500,00	23.445,70	15,50	15,63	15,94	11.173,00
26-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	GGPS3	18,73	400,00	7.492,84	18,44	18,68	18,85	7.396,00
26-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	GGPS3	18,75	4.300,00	80.625,00	18,44	18,68	18,85	7.396,00
26-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	GGPS3	18,71	600,00	11.227,05	18,44	18,68	18,85	7.396,00
26-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,12	45.300,00	186.691,58	4,04	4,10	4,22	42.652,00
26-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,13	6.200,00	25.606,00	4,04	4,10	4,22	42.652,00
26-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGT11	21,30	2.600,00	55.376,31	21,12	21,29	21,46	7.504,00
26-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	ITSA4	11,14	2.400,00	26.728,22	11,04	11,14	11,20	29.475,00
26-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	MGLU3	9,92	1.300,00	12.897,00	9,77	9,98	10,33	23.477,00
26-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	13,61	1.200,00	16.326,58	13,28	13,53	13,71	9.709,00
26-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRI03	42,84	800,00	34.272,83	42,46	42,98	43,91	49.163,00
26-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	20,16	2.300,00	46.370,11	19,90	20,17	20,39	28.541,00
26-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	17,91	700,00	12.538,00	17,72	17,89	18,14	9.477,00
26-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	41,88	1.400,00	58.637,51	41,34	41,92	42,40	27.228,00
26-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	21,52	1.800,00	38.737,84	21,25	21,46	21,68	5.637,00
26-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	53,95	1.500,00	80.919,96	52,29	53,73	54,34	25.656,00
27-09-24	FIA RVA EMB II	Venda	CMIG4	11,37	27.300,00	310.419,97	11,26	11,34	11,48	20.393,00
27-09-24	FIA RVA EMB II	Venda	CXSE3	14,78	19.900,00	294.028,25	14,50	14,75	14,92	12.879,00
27-09-24	FIA RVA EMB II	Compra	GGBR4	19,02	7.900,00	150.264,81	18,88	19,05	19,25	21.782,00
27-09-24	FIA RVA EMB II	Compra	VALE3	64,75	9.400,00	608.625,70	63,17	64,36	65,04	64.033,00
27-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLE6	10,25	11.600,00	118.940,66	10,16	10,24	10,37	17.180,00
27-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	39,64	2.500,00	99.103,06	39,34	39,58	40,19	18.840,00
27-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	14,19	3.600,00	51.084,00	13,94	14,07	14,23	13.973,00
27-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	14,07	10.400,00	146.326,20	13,94	14,07	14,23	13.973,00
27-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	45,53	1.700,00	77.408,93	45,16	45,50	45,84	10.403,00
27-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQT13	32,55	500,00	16.276,70	32,44	32,61	32,89	18.204,00
27-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQT13	32,58	3.100,00	100.998,00	32,44	32,61	32,89	18.204,00
27-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	GGPS3	18,70	600,00	11.220,00	18,50	18,68	19,06	4.564,00
27-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,02	24.100,00	96.800,37	3,96	4,01	4,09	28.946,00
27-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	4,06	10.400,00	42.224,00	3,96	4,01	4,09	28.946,00
27-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	41,83	2.300,00	96.209,00	41,29	41,73	42,07	23.113,00
27-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	41,63	1.000,00	41.632,63	41,29	41,73	42,07	23.113,00
27-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	54,59	1.700,00	92.806,10	53,94	54,45	54,93	17.542,00
27-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	54,43	1.900,00	103.418,22	53,94	54,45	54,93	17.542,00
30-09-24	FIA RVA EMB II	Venda	BPAC11	33,94	6.700,00	227.428,05	33,27	33,69	34,37	22.731,00
30-09-24	FIA RVA EMB II	Venda	INTB3	20,15	12.000,00	241.746,74	19,93	20,08	20,40	8.768,00
30-09-24	FIA RVA EMB II	Venda	JBSS3	31,14	4.000,00	124.557,00	30,85	31,34	31,64	22.438,00
30-09-24	FIA RVA EMB II	Venda	RDOR3	30,97	3.400,00	105.285,94	30,88	31,00	31,52	10.133,00
30-09-24	FIA RVA EMB II	Compra	VALE3	64,92	6.800,00	441.488,85	63,51	64,34	65,32	43.766,00
30-09-24	FIA RVA EMB II	Venda	VBRB3	23,48	6.300,00	147.898,76	23,23	23,42	23,63	11.614,00
30-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	21,70	1.400,00	30.377,79	21,55	21,73	22,05	11.821,00
30-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	21,71	1.300,00	28.228,57	21,55	21,73	22,05	11.821,00
30-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALPA4	6,98	4.300,00	30.019,07	6,94	6,98	7,12	9.408,00
30-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLE6	10,21	7.600,00	77.575,86	10,12	10,18	10,25	11.416,00
30-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	44,93	1.200,00	53.921,21	44,73	44,92	45,75	11.358,00
30-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	45,00	100,00	4.500,02	44,73	44,92	45,75	11.358,00
30-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQT13	32,53	1.500,00	48.801,68	32,32	32,53	32,66	21.452,00
30-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQT13	32,55	900,00	29.295,00	32,32	32,53	32,66	21.452,00
30-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQT19	32,50	676,00	21.970,00	32,32	32,53	32,66	21.452,00
30-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	21,04	900,00	18.934,88	20,91	21,06	21,40	7.391,00
30-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	14,17	5.000,00	70.855,00	13,89	14,09	14,41	15.491,00
30-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	14,03	2.900,00	40.693,95	13,89	14,09	14,41	15.491,00

## RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE SETEMBRO DE 2024 À 30 DE SETEMBRO 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
30-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	13,97	300,00	4.190,58	13,89	14,09	14,41	15.491,00
30-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRI03	43,42	1.300,00	56.446,64	43,07	43,41	44,02	24.727,00
30-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	20,08	4.500,00	90.376,36	20,00	20,07	20,24	15.900,00
30-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	20,10	3.400,00	68.355,88	20,00	20,07	20,24	15.900,00
30-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	20,16	1.700,00	34.280,42	20,00	20,07	20,24	15.900,00
30-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	41,43	1.200,00	49.718,62	41,00	41,24	41,89	12.738,00
30-09-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	41,35	3.400,00	140.606,00	41,00	41,24	41,89	12.738,00
30-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	54,50	700,00	38.150,00	54,03	54,49	54,98	15.609,00
30-09-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	54,52	1.800,00	98.137,30	54,03	54,49	54,98	15.609,00
30-09-24	FIA RVA EMB IV	Venda	EQTL9	32,50	1.027,00	33.377,50	32,32	32,53	32,66	21.452,00
30-09-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	BPML11	88,17	1.701,00	149.973,33	88,00	88,37	90,11	1.185,00
30-09-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	MALL11	103,00	1.456,00	149.967,99	102,14	102,89	103,57	2.965,00

## 7. RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS

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

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

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

## 8. GLOSSÁRIO

### **Administrador**

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

### **Carteira**

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

### **Dados Gerais**

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

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

### **Duration**

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

Vide também glossário de Valor Presente.

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

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

### **Fundo de Investimento**

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

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

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

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

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

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

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

## **Patrimônio de Cobertura**

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

## **Patrimônio Líquido (PL)**

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

## ***Rating***

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

## ***Stress Testing***

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



### ***Tracking Error***

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

### **Túnel de Preços**

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

### **Valor Presente**

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

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

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