



# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO

Fevereiro/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 – FEVEREIRO 2024



bradesco

Data: 29/02/2024

## Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: EMBRAERPREV RENDA FIXA  
CNPJ: 10679245000140

| Dados Gerais |                  |            |         |               |            |              |          |  |  |
|--------------|------------------|------------|---------|---------------|------------|--------------|----------|--|--|
| PL:          | 3.856.947,020,72 | VAR / PL:  | 1,8405% | Limite Fundo: | 0,00%      | Dutacion DC: | 2.034,52 |  |  |
| VAR:         | 70.986.250,12    | ETL / PL:  | 2,3080% | Status:       | ENQUADRADO | Dutacion DU: | 1.400,76 |  |  |
| ETL:         | 89.019.621,49    | VAR / CDI: | 0,0203% | Benchmark:    |            |              |          |  |  |

| Cenários de STRESS        |                  |                            |                |                         |                |                         |                  |  |  |
|---------------------------|------------------|----------------------------|----------------|-------------------------|----------------|-------------------------|------------------|--|--|
| Cenário Alta - 09999 (+): | -                | Cenário Baixa - 10000 (+): | 232.285.597,74 | CENARIO BRADESCO 1 (+): | 197.519.166,23 | CENARIO BRADESCO 2 (+): | -                |  |  |
| Cenário Alta - 09999 (-): | (223.237.064,78) | Cenário Baixa - 10000 (-): | (4.661.498,63) | CENARIO BRADESCO 1 (-): | -              | CENARIO BRADESCO 2 (-): | (225.999.995,30) |  |  |
| Cenário Alta - 09999:     | (223.237.064,78) | Cenário Baixa - 10000:     | 227.624.099,12 | CENARIO BRADESCO 1:     | 197.519.166,23 | CENARIO BRADESCO 2:     | (225.999.995,30) |  |  |

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

| Produto                     | MtM                     | VAR Tot.             | Comp. VAR            | Comp. VAR (%)  | Cenário Alta - 09999   | Cenário Baixa - 10000 | CENARIO BRADESCO 1    | CENARIO BRADESCO 2     |
|-----------------------------|-------------------------|----------------------|----------------------|----------------|------------------------|-----------------------|-----------------------|------------------------|
| CADXA                       | 0,00                    | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%          | 0,00                   | 0,00                  | 0,00                  | 0,00                   |
| CONTAS_A_PAGAR_RECEBER      | 5.000.000,00            | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%          | 0,00                   | 0,00                  | 0,00                  | 0,00                   |
| FI RF EMB II                | 3.082.480.019,00        | 56.025.941,31        | 55.830.654,70        | 78,65%         | -161.184.220,76        | 223.934.092,50        | 174.157.152,53        | -197.416.039,69        |
| FI RF EMB V CREDITO PRIVADO | 137.774.549,18          | 1.427.512,11         | 1.279.707,17         | 1,80%          | -7.544.491,97          | -1.645.366,89         | 1.512.370,09          | -2.000.699,56          |
| FIM EMB II A                | 230.050.063,31          | 693.462,08           | 657.784,40           | 0,93%          | -1.998.579,75          | 2.351.262,43          | 1.473.758,35          | -1.970.036,08          |
| FIM EMB VI A CRED PRIV      | 274.906.650,35          | 4.062.063,60         | 3.787.315,69         | 5,34%          | -11.806.827,30         | 6.000.242,82          | 7.070.336,27          | -7.700.307,36          |
| FIM EMB VII A CRED PRIV     | 374.575.670,33          | 9.968.760,07         | 9.430.788,16         | 13,29%         | -40.702.945,00         | -3.016.131,74         | 13.305.549,00         | -16.912.912,60         |
| <b>Total Var:</b>           | <b>4.104.786.952,17</b> | <b>72.177.739,18</b> | <b>70.986.250,12</b> | <b>100,01%</b> | <b>-223.237.064,78</b> | <b>227.624.099,12</b> | <b>197.519.166,23</b> | <b>-225.999.995,30</b> |



bradesco

Data: 29/02/2024

## Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL  
CNPJ: 10679245000140

| Dados Gerais |                |            |         |               |            |              |      |  |  |
|--------------|----------------|------------|---------|---------------|------------|--------------|------|--|--|
| PL:          | 527.686.204,79 | VAR / PL:  | 6,4950% | Limite Fundo: | 0,00%      | Dutacion DC: | 2,22 |  |  |
| VAR:         | 34.272.999,02  | ETL / PL:  | 8,1449% | Status:       | ENQUADRADO | Dutacion DU: | 1,84 |  |  |
| ETL:         | 42.979.723,46  | VAR / CDI: | 0,0716% | Benchmark:    |            |              |      |  |  |

| Cenários de STRESS        |                |                            |                  |                         |               |                         |                 |  |  |
|---------------------------|----------------|----------------------------|------------------|-------------------------|---------------|-------------------------|-----------------|--|--|
| Cenário Alta - 09999 (+): | 127.816.551,43 | Cenário Baixa - 10000 (+): | -                | CENARIO BRADESCO 1 (+): | 67.351.918,23 | CENARIO BRADESCO 2 (+): | -               |  |  |
| Cenário Alta - 09999 (-): | -              | Cenário Baixa - 10000 (-): | (125.433.952,80) | CENARIO BRADESCO 1 (-): | -             | CENARIO BRADESCO 2 (-): | (67.904.874,71) |  |  |
| Cenário Alta - 09999:     | 127.816.551,43 | Cenário Baixa - 10000:     | (125.433.952,80) | CENARIO BRADESCO 1:     | 67.351.918,23 | CENARIO BRADESCO 2:     | (67.904.874,71) |  |  |

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

| Produto                              | MtM                   | VAR Tot.             | Comp. VAR            | Comp. VAR (%)  | Cenário Alta - 09999  | Cenário Baixa - 10000  | CENARIO BRADESCO 1   | CENARIO BRADESCO 2    |
|--------------------------------------|-----------------------|----------------------|----------------------|----------------|-----------------------|------------------------|----------------------|-----------------------|
| CADXA                                | 0,00                  | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%          | 0,00                  | 0,00                   | 0,00                 | 0,00                  |
| FIA RVA EMB II                       | 110.707.706,53        | 7.527.839,87         | 7.499.394,93         | 21,88%         | 28.894.426,78         | -29.259.457,27         | 15.877.743,36        | -16.006.812,46        |
| FIA RVA EMB III                      | 116.614.061,15        | 8.436.533,26         | 8.319.823,26         | 24,28%         | 33.045.861,01         | -31.593.337,89         | 14.434.007,86        | -14.555.327,06        |
| FIA RVA EMB IV                       | 109.723.169,86        | 5.548.341,85         | 5.345.570,35         | 15,90%         | 29.052.502,90         | -27.327.300,16         | 14.691.166,54        | -14.811.945,28        |
| FIC FIA EMB VIII ETF                 | 72.399.536,42         | 5.958.928,61         | 5.967.168,93         | 14,78%         | 6.511.392,00          | -6.511.392,00          | 5.303.185,83         | -5.346.693,17         |
| FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA E | 118.241.460,28        | 8.067.623,65         | 8.041.041,54         | 23,46%         | 30.312.368,67         | -30.742.465,49         | 17.045.814,65        | -17.184.186,74        |
| <b>Total Var:</b>                    | <b>527.686.934,23</b> | <b>34.666.267,14</b> | <b>34.272.999,02</b> | <b>100,00%</b> | <b>127.816.551,43</b> | <b>-125.433.952,80</b> | <b>67.351.918,23</b> | <b>-67.904.874,71</b> |



# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – FEVEREIRO 2024



bradesco

Data: 29/02/2024

## Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FI RF EMB II  
CNPJ: 11005764000196

| Dados Gerais |                  |            |         |
|--------------|------------------|------------|---------|
| PL:          | 2.940.324.623,39 | VAR / PL:  | 1,9054% |
| VAR:         | 56.025.904,24    | ETL / PL:  | 2,3895% |
| ETL:         | 70.258.744,21    | VAR / CDI: | 0,021%  |

| Cenários de STRESS        |                  |                            |                |
|---------------------------|------------------|----------------------------|----------------|
| Cenário Alta - 09999 (+): | -                | Cenário Baixa - 10000 (+): | 224.775.497,12 |
| Cenário Alta - 09999 (-): | (161.184.114,11) | Cenário Baixa - 10000 (-): | (841.552,79)   |
| Cenário Alta - 09999:     | (161.184.114,11) | Cenário Baixa - 10000:     | 223.933.944,33 |

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

| Produto                          | MM                      | VAR Tot.             | Comp. VAR            | Comp. VAR (%)  | Cenário Alta - 09999   | Cenário Baixa - 10000 | CENARIO BRADESCO 1    | CENARIO BRADESCO 2     |
|----------------------------------|-------------------------|----------------------|----------------------|----------------|------------------------|-----------------------|-----------------------|------------------------|
| CSMG3                            | 8.248.020,01            | 57.972,67            | 42.851,85            | 0,08%          | 0,00                   | 0,00                  | 0,00                  | 0,00                   |
| ELET4                            | 14.953.651,71           | 316.893,59           | 288.398,93           | 0,51%          | 0,00                   | 0,00                  | 0,00                  | 0,00                   |
| ENTV12                           | 13.912.177,90           | 327.866,91           | 300.693,42           | 0,54%          | -27.333,64             | 27.877,29             | 103.092,05            | -156.912,04            |
| GASP17                           | 51.725.924,14           | 238.130,90           | -75.349,34           | -0,13%         | 0,00                   | 0,00                  | 0,00                  | 0,00                   |
| IGSN15                           | 2.694.804,64            | 73.030,49            | 65.778,92            | 0,12%          | -313.352,51            | -120.867,07           | 31.793,53             | -42.921,23             |
| NEOE16                           | 7.670.781,40            | 167.046,07           | 152.328,64           | 0,27%          | 0,00                   | 0,00                  | 0,00                  | 0,00                   |
| NTNB20240815 - 760199_VENCIMENTO | 123.971.115,98          | 332.826,40           | 116.425,26           | 0,21%          | -1.370.426,48          | -248.835,96           | 333.064,37            | -438.757,90            |
| NTNB20260815 - 760199_VENCIMENTO | 42.722.656,80           | 505.151,53           | 444.465,02           | 0,79%          | -1.352.857,96          | -186.371,61           | 369.468,17            | -482.926,62            |
| NTNB20300815 - 760199_VENCIMENTO | 26.726.730,22           | 486.749,99           | 483.329,39           | 0,86%          | -1.394.492,25          | 1.683.900,82          | 993.374,94            | -1.313.893,01          |
| NTNB20350515 - 760199_VENCIMENTO | 244.118.182,01          | 5.771.783,22         | 5.746.644,60         | 10,26%         | -290.601,95            | -27.632,69            | 90.756,58             | -116.538,57            |
| NTNB20400815 - 760199_VENCIMENTO | 30.099.039,34           | 834.019,93           | 833.147,62           | 1,49%          | -715.452,85            | -125.007,00           | 177.254,55            | -233.265,69            |
| NTNB20450515 - 760199_VENCIMENTO | 233.590.236,09          | 7.079.131,37         | 7.070.663,70         | 12,62%         | -850.748,62            | 827.639,80            | 609.884,37            | -822.858,13            |
| NTNB20500815 - 760199_VENCIMENTO | 733.020.397,66          | 25.603.044,48        | 25.590.115,91        | 45,68%         | -1.107.499,84          | 1.127.304,87          | 824.640,13            | -1.093.411,93          |
| NTNB20550515 - 760199_VENCIMENTO | 234.502.099,22          | 6.745.748,69         | 8.740.678,08         | 15,50%         | -1.456.397,46          | 1.494.162,92          | 1.207.468,65          | -1.547.340,96          |
| PETRA5                           | 9.485.389,11            | 80.498,00            | 57.779,41            | 0,10%          | -17.896.614,63         | 21.460.925,93         | 17.302.800,06         | -21.310.282,61         |
| SBSPC2                           | 4.851.791,35            | 26.482,46            | 15.749,08            | 0,03%          | -2.829.043,70          | 3.524.284,49          | 2.849.771,24          | -3.378.349,30          |
| BBTOPIND                         | 339.814.749,48          | 6.188.660,73         | 6.150.074,41         | 10,98%         | -21.950.408,18         | 35.323.855,20         | 25.677.879,27         | -29.482.244,72         |
| CAIXA                            | 5.000,00                | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%          | -81.765.972,51         | 118.926.715,83        | 92.131.558,18         | -102.708.893,13        |
| COMPROMISSADA_PRE                | 960.465.958,97          | 10.989,05            | 2.129,37             | 0,00%          | -27.469.955,56         | 40.378.829,98         | 31.403.506,51         | -34.218.819,92         |
| CONTAS_A_PAGAR_RECEBER           | -100.636,53             | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%          | 0,00                   | 0,00                  | 0,00                  | 0,00                   |
| DESPESAS                         | 0,00                    | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%          | -202.259,71            | -75.711,22            | 25.704,86             | -34.771,93             |
| OUTRAS_DESPESAS                  | 0,00                    | 0,00                 | 0,00                 | 0,00%          | -190.706,27            | -57.127,35            | 24.999,84             | -33.721,48             |
| <b>Total Var:</b>                | <b>3.082.477.979,51</b> | <b>56.847.026,37</b> | <b>56.025.904,24</b> | <b>100,01%</b> | <b>-161.184.114,12</b> | <b>223.933.944,33</b> | <b>174.157.037,30</b> | <b>-197.415.909,07</b> |

## Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FI RF EMB V CREDITO PRIVADO  
CNPJ: 20726178000121

| Dados Gerais |                |            |         |
|--------------|----------------|------------|---------|
| PL:          | 126.666.198,15 | VAR / PL:  | 1,1270% |
| VAR:         | 1.427.512,11   | ETL / PL:  | 1,4133% |
| ETL:         | 1.790.157,78   | VAR / CDI: | 0,0124% |

| Cenários de STRESS        |                |                            |                |
|---------------------------|----------------|----------------------------|----------------|
| Cenário Alta - 09999 (+): | -              | Cenário Baixa - 10000 (+): | 348.544,37     |
| Cenário Alta - 09999 (-): | (7.544.491,97) | Cenário Baixa - 10000 (-): | (1.993.911,26) |
| Cenário Alta - 09999:     | (7.544.491,97) | Cenário Baixa - 10000:     | (1.645.366,89) |

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

| Produto                | MM                    | VAR Tot.            | Comp. VAR           | Comp. VAR (%)  | Cenário Alta - 09999 | Cenário Baixa - 10000 | CENARIO BRADESCO 1  | CENARIO BRADESCO 2   |
|------------------------|-----------------------|---------------------|---------------------|----------------|----------------------|-----------------------|---------------------|----------------------|
| 17H0164854             | 7.498.859,83          | 80.239,82           | 79.825,50           | 5,59%          | -445.833,51          | -144.171,70           | 67.883,89           | -90.716,07           |
| AEGP23                 | 15.327.164,84         | 109.374,47          | 106.454,22          | 7,46%          | -602.365,78          | -260.258,37           | 50.042,98           | -67.594,78           |
| CCRDD1                 | 3.225.762,61          | 32.652,42           | 28.916,72           | 2,03%          | 0,00                 | 0,00                  | 0,00                | 0,00                 |
| CMDDT33                | 700.677,01            | 3.824,49            | 3.218,00            | 0,23%          | -87.820,49           | -21.678,91            | 14.276,00           | -19.270,60           |
| ENJG21                 | 1.685.583,02          | 17.530,41           | 17.468,55           | 1,22%          | -27.541,06           | -8.250,11             | 3.610,38            | -4.869,93            |
| ENMIZ1                 | 1.076.705,81          | 11.452,21           | 11.405,12           | 0,80%          | -148,15              | 151,10                | 558,77              | -850,48              |
| ENTV12                 | 16.288.717,20         | 431.008,38          | 424.210,48          | 29,72%         | 0,00                 | 0,00                  | 0,00                | 0,00                 |
| ERDV17_VENCIMENTO      | 13.427.039,43         | 79.886,28           | 76.710,26           | 5,37%          | 0,00                 | 0,00                  | 0,00                | 0,00                 |
| ERDV36                 | 2.150.746,63          | 22.201,70           | 19.664,76           | 1,38%          | -97.446,00           | -32.963,12            | 13.980,77           | -18.705,35           |
| GASP17                 | 10.701.915,34         | 49.268,46           | -11.033,69          | -0,77%         | -64.075,82           | -21.557,58            | 9.253,18            | -12.377,90           |
| GRRB24_VENCIMENTO      | 16.709.096,15         | 361.994,62          | 357.262,88          | 25,03%         | -1.778.444,53        | -245.001,01           | 485.696,69          | -634.847,29          |
| LFSN16000GM            | 15.161.396,86         | 96.765,18           | 88.012,44           | 6,17%          | -507.049,55          | -230.809,63           | 34.065,68           | -46.023,71           |
| LFSN18000DC5           | 5.049.933,24          | 45.326,63           | 42.748,98           | 2,99%          | -59.565,53           | -14.573,30            | 9.756,43            | -13.169,59           |
| OMGE31                 | 13.607.598,33         | 130.292,57          | 127.506,69          | 8,93%          | -288.515,64          | 348.393,27            | 205.525,85          | -271.839,93          |
| SBSPC2                 | 3.718.221,67          | 20.295,11           | 17.076,67           | 1,20%          | -1.554.819,99        | -274.945,47           | 382.618,42          | -503.830,94          |
| TAE33                  | 4.264.487,85          | 41.879,82           | 38.070,00           | 2,67%          | -571.533,96          | -175.819,24           | 74.695,27           | -100.780,73          |
| CAIXA                  | 1.000,00              | 0,00                | 0,00                | 0,00%          | -318.478,99          | -138.819,38           | 26.234,92           | -35.385,96           |
| COMPROMISSADA_PRE      | 5.205.812,69          | 59,56               | -5,36               | 0,00%          | -890.573,54          | -355.306,68           | 97.683,17           | -131.183,46          |
| CONTAS_A_PAGAR_RECEBER | -26.169,36            | 0,00                | 0,00                | 0,00%          | 0,00                 | 0,00                  | 0,00                | 0,00                 |
| DESPESAS               | 0,00                  | 0,00                | 0,00                | 0,00%          | -146.149,77          | -43.780,15            | 19.158,89           | -25.842,82           |
| OUTRAS_DESPESAS        | 0,00                  | 0,00                | 0,00                | 0,00%          | -104.129,66          | -26.076,61            | 17.328,81           | -23.404,03           |
| <b>Total Var:</b>      | <b>137.774.549,14</b> | <b>1.534.052,15</b> | <b>1.427.512,11</b> | <b>100,02%</b> | <b>-7.544.491,97</b> | <b>-1.645.366,89</b>  | <b>1.512.370,09</b> | <b>-2.000.699,56</b> |



# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – FEVEREIRO 2024



bradesco

Data: 29/02/2024

## Relatório de Risco de Mercado

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

| Dados Gerais |                |            |         |               |            |              |        |  |  |
|--------------|----------------|------------|---------|---------------|------------|--------------|--------|--|--|
| PL:          | 260.361.717,67 | VAR / PL:  | 1,5602% | Limite Fundo: | 0,00%      | Dutacion DC: | 882,88 |  |  |
| VAR:         | 4.062.063,29   | ETL / PL:  | 1,9565% | Status:       | ENQUADRADO | Dutacion DU: | 608,95 |  |  |
| ETL:         | 5.093.991,24   | VAR / CDI: | 0,0172% | Benchmark:    |            |              |        |  |  |

| Cenários de STRESS        |                 |                            |                |                         |                 |                         |                |  |  |
|---------------------------|-----------------|----------------------------|----------------|-------------------------|-----------------|-------------------------|----------------|--|--|
| Cenário Alta - 09999 (+): | 327.763,14      | Cenário Baixa - 10000 (+): | 13.112.108,45  | CENARIO BRADESCO 1 (+): | 18.884.439,81   | CENARIO BRADESCO 2 (+): | 292.532,68     |  |  |
| Cenário Alta - 09999 (-): | (12.134.589,53) | Cenário Baixa - 10000 (-): | (7.111.866,09) | CENARIO BRADESCO 1 (-): | (11.814.104,09) | CENARIO BRADESCO 2 (-): | (7.992.839,45) |  |  |
| Cenário Alta - 09999:     | (11.806.826,39) | Cenário Baixa - 10000:     | 6.000.242,36   | CENARIO BRADESCO 1:     | 7.070.335,72    | CENARIO BRADESCO 2:     | (7.700.306,77) |  |  |

| 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   |
|-------------------|-----------------------|---------------------|---------------------|---------------|-----------------------|-----------------------|---------------------|----------------------|
| RBCAPMZ           | 567.787,60            | 3.980,91            | -415,53             | -0,01%        | 0,00                  | 0,00                  | 0,00                | 0,00                 |
| RDCO10            | 3.796.017,39          | 486,85              | 466,05              | 0,01%         | -2.400,15             | 1.961,00              | 2.913,75            | -4.249,78            |
| RDORB9            | 1.095.930,73          | 1.421,14            | 1.368,78            | 0,03%         | -5.469,40             | 4.663,34              | 6.464,16            | -8.660,11            |
| RDORC9            | 1.567.180,94          | 2.032,23            | 1.957,36            | 0,05%         | -7.821,24             | 6.668,57              | 9.243,75            | -12.383,96           |
| RIS412            | 2.820.300,25          | 88.465,58           | 80.488,98           | 1,98%         | -336.059,61           | -22.740,51            | 111.458,63          | -142.946,54          |
| RLOG11            | 989.849,11            | 21,25               | 20,01               | 0,00%         | -164,66               | 134,71                | 213,73              | -317,30              |
| RODB11            | 2.915.462,37          | 5.479,29            | 5.274,03            | 0,13%         | -21.417,84            | 18.088,99             | 25.085,45           | -34.178,52           |
| RSAN24            | 1.818.965,00          | 96,20               | 91,67               | 0,00%         | -591,14               | 482,77                | 746,04              | -1.100,89            |
| RSAN44            | 896.809,15            | 17.323,32           | 16.780,36           | 0,41%         | -77.598,58            | -13.538,05            | 19.314,11           | -25.292,85           |
| SMFT16            | 2.573.169,06          | 1.541,91            | 1.481,14            | 0,04%         | -6.349,33             | 5.241,71              | 7.313,41            | -10.309,76           |
| SNGO18            | 1.476.777,51          | 43,58               | 41,20               | 0,00%         | -300,71               | 249,06                | 406,01              | -602,21              |
| TBSP11            | 2.650.609,51          | 767,70              | 736,74              | 0,02%         | -3.333,80             | 2.732,43              | 3.878,91            | -5.536,89            |
| UNEG11            | 4.770.560,03          | 180.794,75          | 158.081,22          | 3,89%         | -687.543,61           | 19.103,53             | 278.560,11          | -345.983,46          |
| VAMO33            | 2.879.503,82          | 81.579,68           | 77.748,76           | 1,91%         | -312.034,17           | -24.547,55            | 98.100,81           | -127.151,92          |
| VCCS11            | 2.773.936,67          | 2.318,32            | 2.229,86            | 0,05%         | -9.126,24             | 7.651,24              | 10.575,32           | -14.546,73           |
| VECS11            | 3.514.064,75          | 63,63               | 59,79               | 0,00%         | -495,87               | 412,44                | 681,06              | -1.013,16            |
| VERDECS2          | 0,00                  | 0,00                | 0,00                | 0,00%         | 0,00                  | 0,00                  | 0,00                | 0,00                 |
| VIXL14            | 3.329.127,62          | 148,53              | 141,37              | 0,00%         | -880,88               | 717,35                | 1.106,62            | -1.631,34            |
| VVRT11            | 2.589.202,87          | 432,24              | 414,44              | 0,01%         | -1.978,20             | 1.614,72              | 2.326,50            | -3.353,29            |
| <b>Total Var:</b> | <b>274.906.629,13</b> | <b>4.782.052,84</b> | <b>4.062.063,29</b> | <b>99,97%</b> | <b>-11.806.826,39</b> | <b>6.000.242,36</b>   | <b>7.070.335,72</b> | <b>-7.700.306,77</b> |

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – FEVEREIRO 2024



## Relatório de Risco de Mercado

Data: 29/02/2024

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

| Dados Gerais |                | Limite Fundo: |         | ENQUADRADO |  | Dutacion DC: |  | 1.966,55 |          |
|--------------|----------------|---------------|---------|------------|--|--------------|--|----------|----------|
| PL:          | 309.096.774,27 | VAR / PL:     | 3,2205% | Status:    |  | Dutacion DU: |  |          | 1.354,42 |
| VAR:         | 9.954.571,44   | ETL / PL:     | 4,0387% | Benchmark: |  |              |  |          |          |
| ETL:         | 12.483.434,18  | VAR / CDI:    | 0,0355% |            |  |              |  |          |          |

| Cenários de STRESS        |                 |                            |                |                         |               |                         |                 |
|---------------------------|-----------------|----------------------------|----------------|-------------------------|---------------|-------------------------|-----------------|
| Cenário Alta - 09999 (+): | -               | Cenário Baixa - 10000 (+): | 254.623,24     | CENÁRIO BRADESCO 1 (+): | 13.286.611,07 | CENÁRIO BRADESCO 2 (+): | -               |
| Cenário Alta - 09999 (-): | (40.645.012,09) | Cenário Baixa - 10000 (-): | (3.266.462,08) | CENÁRIO BRADESCO 1 (-): | -             | CENÁRIO BRADESCO 2 (-): | (16.888.840,28) |
| Cenário Alta - 09999:     | (40.645.012,09) | Cenário Baixa - 10000:     | (3.011.838,84) | CENÁRIO BRADESCO 1:     | 13.286.611,07 | CENÁRIO BRADESCO 2:     | (16.888.840,28) |

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

| Produto                | MM             | VAR Tot.      | Comp. VAR    | Comp. VAR (%) | Cenário Alta - 09999 | Cenário Baixa - 10000 | CENÁRIO BRADESCO 1 | CENÁRIO BRADESCO 2 |
|------------------------|----------------|---------------|--------------|---------------|----------------------|-----------------------|--------------------|--------------------|
| ANEM11                 | 11.107.877,02  | 354.442,08    | 351.949,46   | 3,54%         | -1.397.439,00        | -22.083,36            | 520.757,01         | -651.541,63        |
| ANET11                 | 2.145.295,93   | 28.712,19     | 26.756,17    | 0,27%         | -140.976,30          | -36.169,40            | 27.411,29          | -36.329,54         |
| APPSA2                 | 3.407.799,35   | 94.008,66     | 93.071,14    | 0,93%         | -364.469,67          | -31.909,38            | 112.295,99         | -145.727,61        |
| ASAB11                 | 6.419.220,19   | 153.405,45    | 153.109,06   | 1,54%         | -629.176,70          | -76.961,54            | 183.522,65         | -237.121,26        |
| ASER12                 | 2.839.934,18   | 116.241,77    | 114.526,75   | 1,19%         | -473.287,90          | 29.898,47             | 205.681,66         | -250.572,16        |
| BRKPF28                | 10.920.914,41  | 398.777,48    | 390.115,17   | 3,92%         | -1.433.078,31        | -53.850,28            | 513.402,95         | -653.051,94        |
| BTOW16                 | 6.667.646,05   | 199.456,92    | 198.194,62   | 2,00%         | -708.705,85          | -7.283,23             | 254.553,94         | -327.736,91        |
| CAEC21                 | 9.358.954,29   | 177.971,50    | 168.808,71   | 1,68%         | -811.854,87          | -171.692,03           | 182.455,62         | -241.085,41        |
| CAIXA                  | 1.000,00       | 0,00          | 0,00         | 0,00%         | 0,00                 | 0,00                  | 0,00               | 0,00               |
| CART13                 | 10.246.685,00  | 296.952,01    | 296.521,23   | 2,98%         | -1.163.082,46        | -87.426,62            | 379.092,11         | -485.064,48        |
| CBAN32                 | 16.517.893,91  | 501.117,22    | 500.530,79   | 5,03%         | -1.925.054,99        | -137.251,86           | 630.830,65         | -809.650,43        |
| CBANT2                 | 4.853.371,75   | 153.353,00    | 152.951,47   | 1,54%         | -581.495,78          | -36.543,30            | 194.497,67         | -249.191,49        |
| CJEN13                 | 7.272.498,93   | 205.501,39    | 205.113,13   | 2,06%         | -812.328,20          | -61.979,27            | 264.619,01         | -337.904,43        |
| CNRD11                 | 10.354.517,68  | 333.669,77    | 330.729,16   | 3,32%         | -1.269.645,15        | -61.545,73            | 440.992,44         | -560.211,30        |
| COMPROMISSADA_PRE      | 3.260.963,89   | 37,31         | 1,79         | 0,00%         | -92,80               | 94,65                 | 350,02             | -532,75            |
| CONTAS_A_PAGAR_RECEBER | -148.634,02    | 0,00          | 0,00         | 0,00%         | 0,00                 | 0,00                  | 0,00               | 0,00               |
| CONX12                 | 9.527.854,26   | 186.752,58    | 176.706,56   | 1,78%         | -842.015,43          | -172.874,95           | 193.722,25         | -255.387,36        |
| CREDZMZ4               | 210.806,29     | 0,00          | 0,00         | 0,00%         | 0,00                 | 0,00                  | 0,00               | 0,00               |
| CRMG15                 | 9.494.878,88   | 194.710,07    | 190.078,90   | 1,91%         | -838.795,36          | -139.044,84           | 215.105,86         | -280.968,48        |
| DESPESAS               | 0,00           | 0,00          | 0,00         | 0,00%         | 0,00                 | 0,00                  | 0,00               | 0,00               |
| ERDV17                 | 10.003.144,38  | 59.515,28     | 50.270,39    | 0,50%         | -377.751,92          | -171.953,18           | 25.376,93          | -34.292,14         |
| ERDV38                 | 6.153.163,50   | 51.737,06     | 45.680,53    | 0,46%         | -370.242,07          | -145.520,21           | 40.434,05          | -54.354,85         |
| GBSP11                 | 10.324.443,64  | 375.470,83    | 370.744,24   | 3,72%         | -1.562.316,59        | 88.494,02             | 669.994,67         | -814.693,76        |
| GRRB24                 | 9.619.976,36   | 208.412,21    | 198.784,39   | 1,98%         | -895.161,02          | -158.295,15           | 220.286,01         | -290.072,05        |
| HARG11                 | 10.724.754,91  | 328.127,89    | 325.221,69   | 3,27%         | -1.264.984,22        | -40.903,52            | 453.898,44         | -572.599,10        |
| HVRD15                 | 11.616.979,50  | 381.216,48    | 380.318,97   | 3,82%         | -1.459.282,89        | -71.655,78            | 501.640,51         | -639.982,56        |
| IPIL11                 | 8.096.227,89   | 197.933,49    | 197.838,45   | 1,99%         | -812.037,36          | -84.505,69            | 247.214,27         | -317.106,17        |
| IRBR12                 | 11.812.703,23  | 145.555,32    | 133.585,67   | 1,34%         | -847.365,46          | -294.039,16           | 121.931,98         | -163.197,22        |
| ITPO14                 | 9.315.203,60   | 331.475,69    | 328.679,33   | 3,30%         | -1.247.814,58        | -22.151,95            | 459.672,28         | -580.675,22        |
| LAMEA6                 | 9.581.654,82   | 256.086,48    | 255.319,59   | 2,56%         | -973.270,37          | -59.088,80            | 314.773,00         | -407.280,47        |
| LCAMD1                 | 11.487.210,88  | 327.448,92    | 326.301,29   | 3,28%         | -1.247.455,05        | -86.161,51            | 400.812,03         | -518.526,44        |
| LORTA7                 | 6.652.244,12   | 193.993,67    | 193.401,97   | 1,94%         | -731.199,98          | -43.131,31            | 238.709,19         | -308.816,54        |
| MOVI37                 | 9.050.160,11   | 252.311,90    | 251.306,27   | 2,52%         | -967.499,76          | -71.451,67            | 307.706,33         | -398.242,94        |
| MTRJ19                 | 9.092.371,00   | 194.976,47    | 191.833,89   | 1,93%         | -828.324,10          | -124.908,51           | 221.198,18         | -288.265,94        |
| OUTRAS_DESPESAS        | 0,00           | 0,00          | 0,00         | 0,00%         | 0,00                 | 0,00                  | 0,00               | 0,00               |
| PASN12                 | 4.238.238,18   | 73.125,19     | 69.761,77    | 0,70%         | -332.606,65          | -69.908,94            | 75.094,36          | -98.794,91         |
| PEJAJ1                 | 5.040.705,96   | 132.606,00    | 131.921,67   | 1,33%         | -534.395,31          | -56.698,71            | 159.549,66         | -206.621,29        |
| QUAT12                 | 3.607.369,98   | 35.715,66     | 31.412,78    | 0,32%         | -225.435,98          | -92.536,13            | 23.785,10          | -32.012,05         |
| RAHD11                 | 9.618.055,64   | 297.179,52    | 295.687,42   | 2,97%         | -1.197.568,52        | -14.636,16            | 450.254,83         | -561.243,33        |
| RDVE11                 | 8.855.020,02   | 246.771,03    | 246.307,63   | 2,47%         | -989.958,04          | -18.380,89            | 335.602,09         | -424.702,05        |
| RMSA12                 | 11.843.187,11  | 475.246,36    | 468.064,03   | 4,71%         | -1.904.445,85        | 93.152,02             | 806.601,64         | -988.872,33        |
| RSAN44                 | 10.157.609,21  | 196.210,68    | 190.497,65   | 1,91%         | -878.911,66          | -153.337,21           | 218.759,14         | -286.476,68        |
| TCI11                  | 10.493.418,86  | 331.425,53    | 329.854,00   | 3,31%         | -1.354.352,63        | 2.421,10              | 524.290,89         | -649.287,81        |
| UNEG11                 | 10.129.442,77  | 383.885,75    | 377.682,80   | 3,79%         | -1.459.877,58        | 40.562,98             | 591.473,27         | -734.634,85        |
| UTPS21                 | 6.673.022,99   | 228.749,38    | 226.466,64   | 2,28%         | -850.344,09          | -15.520,19            | 312.878,35         | -395.613,38        |
| VAMO33                 | 1.308.986,06   | 37.085,09     | 36.801,08    | 0,37%         | -141.846,79          | -11.159,01            | 44.595,39          | -57.801,66         |
| VAMO34                 | 7.469.129,52   | 210.823,48    | 210.175,52   | 2,11%         | -808.961,69          | -59.884,92            | 257.787,91         | -333.435,30        |
| VERDECS2               | 0,00           | 0,00          | 0,00         | 0,00%         | 0,00                 | 0,00                  | 0,00               | 0,00               |
| VERO12                 | 8.536.038,06   | 177.433,02    | 169.663,00   | 1,70%         | -761.597,67          | -128.024,54           | 192.058,29         | -252.189,37        |
| VIMT13                 | 9.185.204,15   | 288.201,73    | 286.488,20   | 2,88%         | -1.099.621,50        | -43.895,50            | 387.541,75         | -491.182,19        |
| VRDN12                 | 10.097.388,68  | 287.862,41    | 287.336,55   | 2,89%         | -1.128.884,38        | -92.089,66            | 363.397,44         | -465.590,54        |
| Total Var:             | 374.042.533,01 | 10.101.691,82 | 9.954.571,44 | 100,00%       | -40.645.012,09       | -3.011.838,84         | 13.286.611,07      | -16.888.840,28     |

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – FEVEREIRO 2024



## Relatório de Risco de Mercado

Data: 29/02/2024

FUNDO: FIRF EMB II A CRED PRIV  
CNPJ: 20725957000102

|      |                | Dados Gerais |         |               |            |              |        |
|------|----------------|--------------|---------|---------------|------------|--------------|--------|
| PL:  | 215.498.807,24 | VAR / PL:    | 0,3039% | Limite Fundo: | 0,00%      | Dutacion DC: | 806,76 |
| VAR: | 654.889,76     | ETL / PL:    | 0,3811% | Status:       | ENQUADRADO | Dutacion DU: | 557,38 |
| ETL: | 821.258,18     | VAR / CDI:   | 0,0033% | Benchmark:    |            |              |        |

| Cenários de STRESS        |                |                            |                |                         |                |                         |                |
|---------------------------|----------------|----------------------------|----------------|-------------------------|----------------|-------------------------|----------------|
| Cenário Alta - 09999 (+): | 835.860,86     | Cenário Baixa - 10000 (+): | 4.162.001,66   | CENARIO BRADESCO 1 (+): | 4.786.073,92   | CENARIO BRADESCO 2 (+): | 1.297.073,84   |
| Cenário Alta - 09999 (-): | (2.723.273,97) | Cenário Baixa - 10000 (-): | (1.941.523,08) | CENARIO BRADESCO 1 (-): | (3.394.290,16) | CENARIO BRADESCO 2 (-): | (3.157.530,95) |
| Cenário Alta - 09999:     | (1.887.413,10) | Cenário Baixa - 10000:     | 2.220.478,58   | CENARIO BRADESCO 1:     | 1.391.783,75   | CENARIO BRADESCO 2:     | (1.860.457,12) |

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

| Produto                          | MM             | VAR Tot.     | Comp. VAR   | Comp. VAR (%) | Cenário Alta - 09999 | Cenário Baixa - 10000 | CENARIO BRADESCO 1 | CENARIO BRADESCO 2 |
|----------------------------------|----------------|--------------|-------------|---------------|----------------------|-----------------------|--------------------|--------------------|
| CAIXA                            | 9.000,00       | 0,00         | 0,00        | 0,00%         | 0,00                 | 0,00                  | 0,00               | 0,00               |
| CDB323R5ITI                      | 6.465.084,92   | 0,00         | 0,00        | 0,00%         | 0,00                 | 0,00                  | 0,00               | 0,00               |
| COMPROMISSADA_PRE                | 14.684.445,76  | 168,01       | -22,45      | 0,00%         | -417,90              | 426,21                | 1.576,16           | -2.399,01          |
| CONTAS_A_PAGAR_RECEBER           | -41.957,29     | 0,00         | 0,00        | 0,00%         | 0,00                 | 0,00                  | 0,00               | 0,00               |
| CPGT16                           | 144.544,56     | 4,09         | -3,43       | 0,00%         | 66,99                | -61,77                | -123,24            | 187,78             |
| DESPESAS                         | 0,00           | 0,00         | 0,00        | 0,00%         | 0,00                 | 0,00                  | 0,00               | 0,00               |
| DHF26                            | -286,20        | 21.258,83    | -20.258,50  | -3,10%        | 86.478,15            | -69.376,41            | -95.168,51         | 137.050,02         |
| DHF27                            | -3.877,47      | 109.927,99   | -104.785,47 | -16,00%       | 413.231,72           | -340.915,71           | -459.442,51        | 641.088,77         |
| DHF29                            | -2.121,90      | 34.859,91    | -33.483,11  | -8,11%        | 127.964,88           | -111.507,85           | -153.322,28        | 200.180,69         |
| DHF33                            | -3.263,88      | 57.203,58    | -54.800,38  | -8,37%        | 202.050,44           | -189.433,68           | -273.965,49        | 312.487,88         |
| DHN25                            | 2.691,03       | 76.110,61    | 72.366,76   | 11,05%        | -369.425,60          | 293.741,12            | 420.463,00         | -614.872,32        |
| ERDV18                           | 1.382.710,07   | 0,00         | 0,00        | 0,00%         | 0,00                 | 0,00                  | 0,00               | 0,00               |
| IDIN24P400700                    | -1.835,58      | 3.980,32     | -3.224,18   | -0,49%        | 1.835,58             | -518.319,68           | -1.133.310,62      | 1.835,58           |
| IDIN24P400800                    | 10.512,31      | 15.456,05    | 12.519,84   | 1,91%         | -10.512,31           | 543.924,50            | 1.159.068,91       | -10.512,31         |
| IDIV24P410200                    | -4.243,11      | 10.429,64    | -9.487,55   | -1,45%        | 4.243,11             | -711.908,99           | -1.278.937,52      | 4.243,11           |
| IDIV24P410300                    | 8.947,20       | 18.016,56    | 16.389,17   | 2,50%         | -8.947,20            | 730.061,05            | 1.297.227,81       | -8.947,20          |
| LF002200U5M                      | 10.328.004,02  | 0,00         | 0,00        | 0,00%         | 0,00                 | 0,00                  | 0,00               | 0,00               |
| LF002200U5N                      | 10.828.285,80  | 0,00         | 0,00        | 0,00%         | 0,00                 | 0,00                  | 0,00               | 0,00               |
| LF002306J15                      | 10.737.836,31  | 0,00         | 0,00        | 0,00%         | 0,00                 | 0,00                  | 0,00               | 0,00               |
| LF002306U55                      | 6.452.215,20   | 0,00         | 0,00        | 0,00%         | 0,00                 | 0,00                  | 0,00               | 0,00               |
| LF0024000XE                      | 10.327.772,20  | 0,00         | 0,00        | 0,00%         | 0,00                 | 0,00                  | 0,00               | 0,00               |
| LF0024000XG                      | 10.309.235,71  | 0,00         | 0,00        | 0,00%         | 0,00                 | 0,00                  | 0,00               | 0,00               |
| LF0024000XN                      | 10.286.602,74  | 0,00         | 0,00        | 0,00%         | 0,00                 | 0,00                  | 0,00               | 0,00               |
| LF0024002C7                      | 6.598.887,27   | 113.194,31   | 107.888,99  | 16,48%        | -425.510,19          | 351.045,43            | 473.084,05         | -660.137,62        |
| LF0024002SX                      | 4.423.558,68   | 0,00         | 0,00        | 0,00%         | 0,00                 | 0,00                  | 0,00               | 0,00               |
| LF0024002TZ                      | 10.273.718,53  | 0,00         | 0,00        | 0,00%         | 0,00                 | 0,00                  | 0,00               | 0,00               |
| LF00240033U                      | 6.579.941,22   | 0,00         | 0,00        | 0,00%         | 0,00                 | 0,00                  | 0,00               | 0,00               |
| LF0024003CF                      | 10.825.203,87  | 0,00         | 0,00        | 0,00%         | 0,00                 | 0,00                  | 0,00               | 0,00               |
| LF0024006I2                      | 10.868.023,29  | 0,00         | 0,00        | 0,00%         | 0,00                 | 0,00                  | 0,00               | 0,00               |
| LFT20260301 - 210100             | 188.573,37     | 40,15        | -12,49      | 0,00%         | -850,66              | 1.797,37              | 33,43              | -50,88             |
| LFT20260901 - 210100             | 1.710.474,93   | 411,87       | -320,11     | -0,05%        | -8.758,70            | 21.455,32             | 607,96             | -925,18            |
| LFT20300301 - 210100             | 8.285.398,38   | 3.691,74     | 1.865,61    | 0,28%         | -108.716,21          | 314.265,91            | 22.978,35          | -34.861,79         |
| NTNB20240815 - 760199_NEGOCIACAO | 13.327.463,80  | 35.780,36    | 22.241,25   | 3,40%         | -91.459,38           | 88.975,08             | 65.565,37          | -88.461,03         |
| NTNB20250515 - 760199_NEGOCIACAO | 9.139.782,76   | 64.031,55    | 57.690,42   | 8,81%         | -152.211,03          | 147.838,45            | 92.367,93          | -123.839,55        |
| NTNB20260815 - 760199_NEGOCIACAO | 13.602.893,93  | 160.840,25   | 159.392,19  | 24,34%        | -352.627,95          | 358.933,87            | 262.565,42         | -348.142,36        |
| NTNB20270515 - 760199_NEGOCIACAO | 10.679.635,08  | 136.803,96   | 136.493,80  | 20,84%        | -335.936,70          | 350.794,19            | 255.503,96         | -336.670,99        |
| NTNB20280815 - 760199_NEGOCIACAO | 17.554.413,83  | 260.576,21   | 253.372,41  | 38,69%        | -715.582,39          | 751.745,27            | 574.662,00         | -748.940,77        |
| NTNB20500815 - 760199_NEGOCIACAO | 1.275.858,66   | 44.563,38    | 41.087,00   | 6,27%         | -142.317,77          | 206.997,90            | 160.359,59         | -178.769,97        |
| OUTRAS_DESPESAS                  | 0,00           | 0,00         | 0,00        | 0,00%         | 0,00                 | 0,00                  | 0,00               | 0,00               |
| Total Var:                       | 217.254.030,00 | 1.167.349,39 | 654.889,76  | 100,00%       | -1.887.413,10        | 2.220.478,58          | 1.391.783,76       | -1.860.457,12      |



# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – FEVEREIRO 2024



bradesco

Data: 29/02/2024

## Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIM EMB I A  
CNPJ: 20725946000122

| Dados Gerais |                |           |         |               |            |              |        |  |  |
|--------------|----------------|-----------|---------|---------------|------------|--------------|--------|--|--|
| PL:          | 381.330.541,67 | VAR / PL: | 0,7067% | Limite Fundo: | 0,00%      | Dutacion DC: | 597,33 |  |  |
| VAR:         | 2.694.764,66   | ETL / PL: | 0,8862% | Status:       | ENQUADRADO | Dutacion DU: | 412,74 |  |  |
| ETL:         | 3.379.343,60   | VAR / CD: | 0,0078% | Benchmark:    |            |              |        |  |  |

| Cenários de STRESS        |                 |                            |                  |                         |                  |                         |                 |  |  |
|---------------------------|-----------------|----------------------------|------------------|-------------------------|------------------|-------------------------|-----------------|--|--|
| Cenário Alta - 09999 (+): | 19.116.975,01   | Cenário Baixa - 10000 (+): | 124.102.170,38   | CENARIO BRADESCO 1 (+): | 223.589.767,91   | CENARIO BRADESCO 2 (+): | 26.042.340,75   |  |  |
| Cenário Alta - 09999 (-): | (44.297.173,62) | Cenário Baixa - 10000 (-): | (101.192.488,87) | CENARIO BRADESCO 1 (-): | (193.437.156,72) | CENARIO BRADESCO 2 (-): | (71.573.904,42) |  |  |
| Cenário Alta - 09999:     | (25.180.198,61) | Cenário Baixa - 10000:     | 22.909.681,50    | CENARIO BRADESCO 1:     | 30.152.611,18    | CENARIO BRADESCO 2:     | (45.531.563,68) |  |  |

| 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    |
|-------------------|-----------------------|----------------------|---------------------|---------------|-----------------------|-----------------------|----------------------|-----------------------|
| VAM022            | 1.051.670,51          | 74,14                | 73,62               | 0,00%         | -390,90               | 316,42                | 467,91               | -654,82               |
| WDOH24            | 5.979.960,00          | 0,00                 | 0,00                | 0,00%         | 0,00                  | 0,00                  | 0,00                 | 0,00                  |
| WDOJ24            | -11.456.787,99        | 314.936,07           | 219.285,76          | 8,14%         | -1.271.828,44         | 1.292.996,30          | -1.654.505,27        | 1.664.007,65          |
| <b>Total Var:</b> | <b>420.126.108,76</b> | <b>16.930.246,66</b> | <b>2.694.764,66</b> | <b>99,96%</b> | <b>-25.180.198,61</b> | <b>22.909.681,50</b>  | <b>30.152.611,18</b> | <b>-45.531.563,68</b> |



bradesco

Data: 29/02/2024

## Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIM EMB III A IMOBILIÁRIO  
CNPJ: 32711990000162

| Dados Gerais |               |           |         |               |            |              |      |  |  |
|--------------|---------------|-----------|---------|---------------|------------|--------------|------|--|--|
| PL:          | 71.322.572,21 | VAR / PL: | 2,4800% | Limite Fundo: | 0,00%      | Dutacion DC: | 1,00 |  |  |
| VAR:         | 1.768.828,94  | ETL / PL: | 3,1101% | Status:       | ENQUADRADO | Dutacion DU: | 1,00 |  |  |
| ETL:         | 2.216.162,66  | VAR / CD: | 0,0273% | Benchmark:    |            |              |      |  |  |

| Cenários de STRESS        |               |                            |                 |                         |              |                         |                |  |  |
|---------------------------|---------------|----------------------------|-----------------|-------------------------|--------------|-------------------------|----------------|--|--|
| Cenário Alta - 09999 (+): | 34.321.132,01 | Cenário Baixa - 10000 (+): | 12,47           | CENARIO BRADESCO 1 (+): | 8.538.902,67 | CENARIO BRADESCO 2 (+): | -              |  |  |
| Cenário Alta - 09999 (-): | (12,23)       | Cenário Baixa - 10000 (-): | (34.321.139,27) | CENARIO BRADESCO 1 (-): | -            | CENARIO BRADESCO 2 (-): | (8.608.821,89) |  |  |
| Cenário Alta - 09999:     | 34.321.119,78 | Cenário Baixa - 10000:     | (34.321.126,79) | CENARIO BRADESCO 1:     | 8.538.902,67 | CENARIO BRADESCO 2:     | (8.608.821,89) |  |  |

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

| Produto                | MtM                  | VAR Tot.            | Comp. VAR           | Comp. VAR (%)  | Cenário Alta - 09999 | Cenário Baixa - 10000 | CENARIO BRADESCO 1  | CENARIO BRADESCO 2   |
|------------------------|----------------------|---------------------|---------------------|----------------|----------------------|-----------------------|---------------------|----------------------|
| AIEC11                 | 1.799.352,00         | 149.353,66          | 33.739,06           | 1,91%          | 899.678,00           | -899.678,00           | 263.795,00          | -265.944,23          |
| BMLC11                 | 3.781.319,84         | 72.880,87           | -15.797,08          | -0,89%         | 3.781.319,84         | -3.781.319,84         | 554.341,49          | -558.879,07          |
| BPML11                 | 2.700.627,00         | 184.082,15          | -57.595,34          | -3,26%         | 2.700.627,00         | -2.700.627,00         | 395.911,92          | -399.152,67          |
| CAIXA                  | 1.000,00             | 0,00                | 0,00                | 0,00%          | 0,00                 | 0,00                  | 0,00                | 0,00                 |
| CEOC11                 | 665.267,40           | 34.406,07           | 7.759,82            | 0,44%          | 332.632,27           | -332.633,70           | 97.528,20           | -98.326,52           |
| CNES11                 | 399.059,10           | 47.745,51           | 2.306,78            | 0,13%          | 199.529,55           | -199.529,55           | 58.502,06           | -58.980,94           |
| COMPROMISSADA_PRE      | 429.758,50           | 4,92                | 0,55                | 0,00%          | -12,23               | 12,47                 | 46,13               | -70,21               |
| CONTAS_A_PAGAR_RECEBER | -475.561,94          | 0,00                | 0,00                | 0,00%          | 0,00                 | 0,00                  | 0,00                | 0,00                 |
| DESPESAS               | 0,00                 | 0,00                | 0,00                | 0,00%          | 0,00                 | 0,00                  | 0,00                | 0,00                 |
| FVPQ11                 | 1.087.738,75         | 53.028,33           | 15.455,35           | 0,87%          | 543.869,38           | -543.869,38           | 159.462,50          | -160.767,79          |
| MALL11                 | 4.467.816,10         | 69.013,37           | 34.556,36           | 1,95%          | 2.233.908,05         | -2.233.908,05         | 654.981,84          | -660.343,22          |
| MAXR11                 | 1.880.856,25         | 96.810,73           | 18.705,03           | 1,06%          | 940.428,13           | -940.428,13           | 275.733,53          | -277.990,55          |
| NEWL11                 | 7.127.625,96         | 470.953,78          | 129.313,78          | 7,31%          | 3.563.807,15         | -3.563.812,98         | 1.044.909,97        | -1.053.463,12        |
| NEWU11                 | 1.754.952,64         | 110.478,05          | -31.972,64          | -1,81%         | 1.754.952,64         | -1.754.952,64         | 257.276,06          | -259.382,00          |
| OULG11                 | 185.896,60           | 11.754,44           | 7.892,00            | 0,45%          | 92.949,30            | -92.949,30            | 27.252,74           | -27.475,81           |
| OUTRAS_DESPESAS        | 0,00                 | 0,00                | 0,00                | 0,00%          | 0,00                 | 0,00                  | 0,00                | 0,00                 |
| PATC11                 | 4.302.528,48         | 1.182.488,11        | 836.116,58          | 47,27%         | 2.151.264,24         | -2.151.264,24         | 630.750,68          | -635.913,71          |
| PVBH11                 | 2.500.935,39         | 54.985,90           | 44.747,39           | 2,53%          | 0,00                 | 0,00                  | 0,00                | 0,00                 |
| QAGR11                 | 5.392.404,95         | 158.673,21          | 48.397,19           | 2,74%          | 2.696.202,48         | -2.696.202,48         | 790.526,57          | -796.997,45          |
| RBRL11                 | 2.159.427,20         | 103.985,05          | 22.356,87           | 1,26%          | 2.159.427,20         | -2.159.427,20         | 316.572,03          | -319.163,34          |
| RCRB11                 | 6.513.950,92         | 251.823,23          | 127.125,06          | 7,19%          | 0,00                 | 0,00                  | 0,00                | 0,00                 |
| TEPP11                 | 5.863.805,48         | 172.214,99          | 107.374,80          | 6,07%          | 2.931.902,74         | -2.931.902,74         | 859.633,88          | -866.670,45          |
| TRXF11                 | 9.621.577,70         | 230.117,78          | 143.801,36          | 8,13%          | 4.810.788,85         | -4.810.788,85         | 1.410.523,29        | -1.422.069,18        |
| VVMR11                 | 4.106.537,50         | 184.351,19          | 51.047,18           | 2,89%          | 0,00                 | 0,00                  | 0,00                | 0,00                 |
| XPIN11                 | 2.445.288,80         | 87.813,25           | -3.825,60           | -0,22%         | 1.222.629,40         | -1.222.629,40         | 358.474,94          | -361.409,25          |
| XPPR11                 | 2.610.435,60         | 491.856,13          | 247.324,45          | 13,98%         | 1.305.217,80         | -1.305.217,80         | 382.689,86          | -385.822,38          |
| <b>Total Var:</b>      | <b>71.322.572,22</b> | <b>4.218.860,73</b> | <b>1.768.828,94</b> | <b>100,00%</b> | <b>34.321.119,78</b> | <b>-34.321.126,79</b> | <b>8.538.902,67</b> | <b>-8.608.821,90</b> |

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – FEVEREIRO 2024



## Relatório de Risco de Mercado

Data: 29/02/2024

**FUNDO:** FIA RVA EMB II  
**CNPJ:** 13294268000125

| Dados Gerais  |                |              |            |
|---------------|----------------|--------------|------------|
| PL:           | 110.707.707,54 | VAR / PL:    | 6,7997%    |
| VAR:          | 7.527.839,87   | ETL / PL:    | 8,5272%    |
| ETL:          | 9.440.214,90   | VAR / CDI:   | 0,0749%    |
| Limite Fundo: |                | Status:      | ENQUADRADO |
| Benchmark:    |                | Dutacion DC: | 0,00%      |
|               |                | Dutacion DU: | 1,00       |

| Cenários de STRESS        |               |                            |                 |                         |                 |
|---------------------------|---------------|----------------------------|-----------------|-------------------------|-----------------|
| Cenário Alta - 09999 (+): | 28.894.510,99 | Cenário Baixa - 10000 (+): | 85,90           | CENÁRIO BRADESCO 1 (+): | 15.877.743,35   |
| Cenário Alta - 09999 (-): | (84,23)       | Cenário Baixa - 10000 (-): | (29.259.543,16) | CENÁRIO BRADESCO 1 (-): | -               |
| Cenário Alta - 09999:     | 28.894.426,76 | Cenário Baixa - 10000:     | (29.259.457,26) | CENÁRIO BRADESCO 1:     | 15.877.743,35   |
|                           |               |                            |                 | CENÁRIO BRADESCO 2 (+): | -               |
|                           |               |                            |                 | CENÁRIO BRADESCO 2 (-): | (16.006.812,45) |
|                           |               |                            |                 | CENÁRIO BRADESCO 2:     | (16.006.812,45) |

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

| Produto                | MM             | VAR Tot.      | Comp. VAR    | Comp. VAR (%) | Cenário Alta - 09999 | Cenário Baixa - 10000 | CENÁRIO BRADESCO 1 | CENÁRIO BRADESCO 2 |
|------------------------|----------------|---------------|--------------|---------------|----------------------|-----------------------|--------------------|--------------------|
| ABEV3                  | 2.615.444,90   | 226.714,28    | 203.264,04   | 2,70%         | 366.162,29           | -784.654,26           | 383.424,22         | -386.562,76        |
| AZUL4                  | 546.468,00     | 106.180,11    | 82.355,86    | 1,09%         | 327.880,80           | -191.263,80           | 80.112,21          | -80.767,97         |
| B3SA3                  | 3.178.363,07   | 504.123,08    | 441.451,16   | 5,86%         | 816.267,06           | -781.585,00           | 465.948,03         | -469.762,06        |
| BBAS3                  | 3.379.024,00   | 113.260,20    | 44.923,07    | 0,60%         | 844.756,00           | -844.761,84           | 495.364,92         | -499.419,75        |
| BBDC4                  | 2.897.475,00   | 518.387,63    | 438.838,49   | 5,63%         | 674.368,75           | -674.368,75           | 395.449,84         | -396.686,81        |
| BPAC11                 | 3.893.730,00   | 382.819,15    | 333.801,73   | 4,43%         | 1.168.119,00         | -1.362.905,60         | 570.820,82         | -575.493,29        |
| BRIT3                  | 362.560,00     | 65.793,76     | 40.236,34    | 0,53%         | 170.403,20           | -170.403,20           | 53.151,30          | -53.586,37         |
| BRSR6                  | 569.367,00     | 23.092,18     | -2.386,60    | -0,03%        | 142.341,75           | -142.341,75           | 83.469,20          | -84.152,44         |
| CAIXA                  | 10.000,00      | 0,00          | 0,00         | 0,00%         | 0,00                 | 0,00                  | 0,00               | 0,00               |
| CIEL3                  | 556.935,00     | 44.611,81     | 26.268,42    | 0,35%         | 167.080,50           | -139.233,75           | 81.646,67          | -82.314,99         |
| CMG4                   | 1.337.049,00   | 122.536,55    | 2.637,46     | 0,04%         | 334.262,25           | -401.114,70           | 196.011,38         | -197.615,84        |
| COMPROMISSADA_PRE      | 2.959.633,18   | 33,86         | 4,38         | 0,00%         | -84,23               | 85,90                 | 317,67             | -483,52            |
| CONTAS_A_PAGAR_RECEBER | 1.485.711,37   | 0,00          | 0,00         | 0,00%         | 0,00                 | 0,00                  | 0,00               | 0,00               |
| CPFE3                  | 778.580,00     | 74.253,05     | 70.309,15    | 0,93%         | 155.713,80           | -155.716,00           | 114.139,83         | -115.074,12        |
| CPLE6                  | 1.141.574,00   | 78.574,41     | 75.430,82    | 1,00%         | 251.146,28           | -251.146,28           | 167.354,75         | -168.724,64        |
| CRFB3                  | 633.516,00     | 109.560,74    | 77.421,42    | 1,03%         | 158.379,00           | -158.384,24           | 92.873,45          | -93.633,67         |
| CSAN3                  | 1.438.200,00   | 162.962,03    | 136.980,85   | 1,82%         | 359.550,00           | -359.550,00           | 210.840,12         | -212.565,96        |
| CURY3                  | 620.816,00     | 36.451,39     | 22.002,07    | 0,29%         | 186.244,80           | -186.244,80           | 91.011,63          | -91.756,61         |
| CXSE3                  | 1.105.816,00   | 79.977,36     | 4.238,21     | 0,06%         | 220.723,20           | -220.723,20           | 161.790,11         | -163.114,45        |
| DESPESAS               | 0,00           | 0,00          | 0,00         | 0,00%         | 0,00                 | 0,00                  | 0,00               | 0,00               |
| DIRR3                  | 1.126.692,00   | 91.101,83     | 77.324,83    | 1,02%         | 338.007,60           | -338.007,60           | 165.173,05         | -166.525,08        |
| ECOR3                  | 862.734,00     | 78.292,69     | 71.602,88    | 0,95%         | 140.683,50           | -140.683,50           | 82.496,80          | -83.172,09         |
| ELT3                   | 3.920.307,00   | 290.825,03    | 236.288,33   | 3,14%         | 1.176.092,10         | -1.176.092,10         | 574.717,01         | -579.421,38        |
| ELTE6                  | 1.311.898,00   | 97.595,61     | 88.216,05    | 1,17%         | 399.569,40           | -399.569,40           | 195.256,26         | -196.854,52        |
| ENEV3                  | 890.402,00     | 97.513,88     | 88.152,68    | 1,17%         | 329.448,74           | -454.105,02           | 130.532,93         | -131.601,42        |
| EQLT3                  | 2.990.750,00   | 202.017,17    | 151.247,69   | 2,01%         | 598.150,00           | -598.150,00           | 438.443,95         | -442.032,85        |
| GGBR4                  | 670.800,00     | 57.874,25     | 37.137,52    | 0,49%         | 167.700,00           | -167.700,00           | 98.339,28          | -99.144,24         |
| GGPS3                  | 630.432,00     | 59.115,03     | 40.089,66    | 0,53%         | 283.694,40           | -283.694,40           | 92.421,33          | -93.177,85         |
| GMAT3                  | 478.551,00     | 62.777,03     | 8.783,95     | 0,12%         | 86.139,18            | -76.568,16            | 10.155,58          | -70.729,84         |
| GOAU4                  | 867.438,00     | 69.353,24     | 50.576,20    | 0,67%         | 260.231,40           | -216.859,50           | 127.166,41         | -128.207,34        |
| HAPV3                  | 351.174,96     | 69.617,12     | 56.065,79    | 0,74%         | 119.399,49           | -119.409,06           | 51.482,25          | -51.903,66         |
| ITSA4                  | 2.572.363,20   | 190.619,31    | 163.400,63   | 2,17%         | 488.749,01           | -488.749,01           | 377.108,45         | -380.195,28        |
| ITUB4                  | 9.453.545,78   | 727.921,58    | 565.811,24   | 7,51%         | 1.890.681,30         | -1.796.173,70         | 1.385.889,81       | -1.397.234,07      |
| JBS3                   | 1.897.638,00   | 310.850,04    | 241.635,69   | 3,21%         | 664.243,30           | -664.243,30           | 276.223,05         | -280.500,46        |
| LJQQ3                  | 473.976,00     | 133.836,90    | 127.119,79   | 1,69%         | 213.280,12           | -213.289,20           | 89.484,88          | -70.953,65         |
| LREN3                  | 1.149.450,00   | 252.153,00    | 222.473,41   | 2,96%         | 229.890,00           | -229.890,00           | 168.509,37         | -169.888,71        |
| LWSA3                  | 217.787,00     | 21.860,24     | 12.539,94    | 0,17%         | 87.114,80            | -87.114,80            | 31.927,57          | -32.188,92         |
| MRFG3                  | 1.777.050,00   | 370.318,35    | 290.106,26   | 3,85%         | 710.820,00           | -533.115,00           | 260.515,63         | -262.647,99        |
| MULT3                  | 565.174,00     | 69.582,83     | 52.630,34    | 0,70%         | 169.552,20           | -141.293,50           | 82.854,51          | -83.532,72         |
| ONCO3                  | 1.170.080,00   | 282.452,11    | 208.427,00   | 2,77%         | 409.528,00           | -409.528,00           | 171.533,73         | -172.937,82        |
| OUTRAS_DESPESAS        | 0,00           | 0,00          | 0,00         | 0,00%         | 0,00                 | 0,00                  | 0,00               | 0,00               |
| PETR3                  | 3.206.916,00   | 281.618,19    | -114.309,61  | -1,52%        | 801.729,00           | -962.082,58           | 470.133,89         | -473.982,19        |
| PETRA                  | 10.462.852,26  | 795.593,59    | -266.358,96  | -3,54%        | 2.615.713,07         | -3.138.855,68         | 1.533.854,14       | -1.546.409,56      |
| PRI03                  | 2.119.935,00   | 159.427,57    | 29.393,97    | 0,39%         | 1.271.961,00         | -1.271.961,00         | 310.782,47         | -313.326,39        |
| RADL3                  | 2.043.181,44   | 277.344,73    | 239.769,38   | 3,19%         | 408.636,29           | -408.636,29           | 299.530,40         | -301.982,29        |
| RAIL3                  | 777.024,00     | 33.971,95     | 1.154,42     | 0,02%         | 349.657,38           | -256.421,34           | 113.911,72         | -114.844,15        |
| RECV3                  | 439.300,00     | 37.986,15     | -14.553,50   | -0,19%        | 263.580,00           | -263.580,00           | 64.401,38          | -64.928,54         |
| RENT3                  | 2.999.800,00   | 561.811,83    | 502.887,66   | 6,68%         | 989.934,00           | -779.948,00           | 439.770,68         | -443.370,44        |
| RRRP3                  | 204.035,00     | 24.484,87     | -18.776,92   | -0,25%        | 122.421,00           | -122.421,00           | 29.911,53          | -30.156,37         |
| SBP3                   | 574.877,00     | 138.468,47    | 75.997,85    | 1,01%         | 216.453,26           | -229.950,80           | 84.276,97          | -84.966,92         |
| SBSF3                  | 2.184.816,00   | 124.523,00    | 85.331,42    | 1,15%         | 546.201,24           | -546.204,00           | 320.624,03         | -322.915,61        |
| SUZB3                  | 2.237.095,00   | 217.863,22    | 55.640,13    | 0,74%         | 559.273,75           | -447.419,00           | 327.958,13         | -330.642,64        |
| TIMS3                  | 685.009,00     | 45.538,72     | 23.668,77    | 0,31%         | 219.202,68           | -157.552,07           | 100.422,32         | -101.244,33        |
| TOTS3                  | 999.972,27     | 135.733,07    | 118.828,64   | 1,58%         | 199.994,45           | -199.994,45           | 146.595,94         | -147.795,90        |
| VALE3                  | 13.323.976,05  | 1.679.173,32  | 1.623.898,80 | 21,57%        | 3.330.994,01         | -3.331.013,90         | 1.953.294,89       | -1.969.283,66      |
| VBBR3                  | 2.218.788,00   | 152.011,76    | 3.150,56     | 0,04%         | 554.697,00           | -554.697,00           | 325.274,32         | -327.936,87        |
| VIVT3                  | 1.084.152,00   | 91.714,49     | 26.462,81    | 0,35%         | 162.622,80           | -162.622,80           | 158.936,68         | -160.237,67        |
| WEGE3                  | 2.010.612,00   | 262.018,31    | 122.752,07   | 1,63%         | 502.653,00           | -502.653,00           | 294.755,72         | -297.168,45        |
| WINJ24                 | -18.352,00     | 145.556,45    | 145.075,60   | 1,93%         | 379.000,98           | -378.194,94           | 298.139,02         | -299.517,42        |
| YDUQ3                  | 747.212,00     | 112.609,96    | 99.620,04    | 1,32%         | 291.412,68           | -186.803,00           | 109.541,28         | -110.437,93        |
| Total Var:             | 110.707.706,48 | 11.462.158,50 | 7.527.839,87 | 99,99%        | 28.894.426,77        | -29.259.457,26        | 15.877.743,35      | -16.006.812,46     |



# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – FEVEREIRO 2024



bradesco

Data: 29/02/2024

## Relatório de Risco de Mercado

|               |                        |
|---------------|------------------------|
| <b>FUNDO:</b> | <b>FIA RVA EMB III</b> |
| <b>CNPJ:</b>  | <b>38452593000108</b>  |

| Dados Gerais |                |            |         |               |            |
|--------------|----------------|------------|---------|---------------|------------|
| PL:          | 116.613.276,80 | VAR / PL:  | 7,2346% | Limite Fundo: | 0,00%      |
| VAR:         | 8.436.533,26   | ETL / PL:  | 9,0725% | Status:       | ENQUADRADO |
| ETL:         | 10.579.753,07  | VAR / CDI: | 0,0797% | Benchmark:    |            |
|              |                |            |         | Dutacion DC:  | 1,00       |
|              |                |            |         | Dutacion DU:  | 1,00       |

| Cenários de STRESS        |               |                            |                 |                         |                 |
|---------------------------|---------------|----------------------------|-----------------|-------------------------|-----------------|
| Cenário Alta - 09999 (+): | 33.958.399,14 | Cenário Baixa - 10000 (+): | 927.726,57      | CENÁRIO BRADESCO 1 (+): | 15.620.935,54   |
| Cenário Alta - 09999 (-): | (912.538,15)  | Cenário Baixa - 10000 (-): | (32.521.064,44) | CENÁRIO BRADESCO 1 (-): | (1.186.927,69)  |
| Cenário Alta - 09999:     | 33.045.860,99 | Cenário Baixa - 10000:     | (31.593.337,87) | CENÁRIO BRADESCO 1:     | 14.434.007,85   |
|                           |               |                            |                 | CENÁRIO BRADESCO 2 (+): | 1.193.744,62    |
|                           |               |                            |                 | CENÁRIO BRADESCO 2 (-): | (15.749.071,66) |
|                           |               |                            |                 | CENÁRIO BRADESCO 2:     | (14.555.327,05) |

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

| Produto                | MM                    | VAR Tot.             | Comp. VAR           | Comp. VAR (%)  | Cenário Alta - 09999 | Cenário Baixa - 10000 | CENÁRIO BRADESCO 1   | CENÁRIO BRADESCO 2    |
|------------------------|-----------------------|----------------------|---------------------|----------------|----------------------|-----------------------|----------------------|-----------------------|
| ALOS3                  | 5.109.694,26          | 455.723,90           | 440.588,62          | 5,22%          | 0,00                 | 0,00                  | 0,00                 | 0,00                  |
| ALPA4                  | 486.126,00            | 106.117,78           | 42.260,38           | 0,50%          | 121.531,50           | -121.531,50           | 71.266,07            | -71.849,42            |
| BBAS3                  | 2.147.936,78          | 71.995,86            | 26.019,37           | 0,31%          | 536.984,20           | -536.987,91           | 314.897,53           | -317.466,06           |
| BBSE3                  | 3.414.016,00          | 142.039,63           | 26.693,85           | 0,32%          | 682.803,20           | -682.803,20           | 500.494,75           | -504.591,57           |
| BPAC11                 | 2.495.296,69          | 245.329,83           | 214.461,74          | 2,54%          | 746.569,61           | -873.354,54           | 365.610,79           | -368.805,15           |
| CAXA                   | 1.000,00              | 0,00                 | 0,00                | 0,00%          | 0,00                 | 0,00                  | 0,00                 | 0,00                  |
| CIEL3                  | 722.250,00            | 57.853,93            | 30.031,03           | 0,36%          | 216.675,00           | -180.562,50           | 106.881,85           | -106.748,55           |
| COMPROMISSADA_PRE      | 4.901.402,20          | 56,08                | 4,28                | 0,00%          | -139,49              | 142,26                | 526,09               | -800,75               |
| CONTAS_A_PAGAR_RECEBER | -513.066,65           | 0,00                 | 0,00                | 0,00%          | 0,00                 | 0,00                  | 0,00                 | 0,00                  |
| CPLE3                  | 1.519.960,14          | 102.733,61           | 93.803,44           | 1,11%          | 334.391,23           | -334.391,23           | 222.826,16           | -224.650,11           |
| CPLE6                  | 1.139.611,76          | 78.439,35            | 74.972,80           | 0,89%          | 250.714,69           | -250.714,69           | 167.067,08           | -168.434,62           |
| DESPESAS               | 0,00                  | 0,00                 | 0,00                | 0,00%          | 0,00                 | 0,00                  | 0,00                 | 0,00                  |
| DOLJ24                 | 2.644,67              | 225.932,40           | 169.716,99          | 2,01%          | -912.398,66          | 927.584,31            | -1.186.927,69        | 1.193.744,62          |
| ELET3                  | 8.216.628,00          | 609.544,37           | 496.309,36          | 5,88%          | 2.464.988,40         | -2.464.988,40         | 1.204.557,67         | -1.214.417,62         |
| ENAT3                  | 670.124,00            | 155.525,64           | -25.507,16          | -0,30%         | 234.543,40           | -234.543,40           | 98.240,18            | -99.044,33            |
| ENEV3                  | 7.055.409,45          | 772.685,09           | 704.076,46          | 8,35%          | 2.610.501,50         | -3.598.258,82         | 1.034.323,03         | -1.042.789,52         |
| ENJ3                   | 185.802,00            | 32.458,56            | 19.356,48           | 0,23%          | 83.600,16            | -80.166,54            | 27.238,57            | -27.461,54            |
| EQTL3                  | 9.182.559,54          | 620.257,37           | 474.934,18          | 5,63%          | 1.836.511,91         | -1.836.511,91         | 1.346.163,23         | -1.357.182,30         |
| FLRY3                  | 2.104.893,00          | 268.202,48           | 258.793,30          | 3,07%          | 420.978,60           | -420.978,60           | 308.577,31           | -311.103,19           |
| HAPO3                  | 3.474.502,77          | 688.787,34           | 603.338,24          | 7,15%          | 1.181.330,94         | -1.181.425,62         | 509.362,11           | -513.531,51           |
| IGTH1                  | 7.526.564,64          | 733.077,67           | 698.839,15          | 8,22%          | 1.505.312,93         | -1.505.312,93         | 1.103.394,38         | -1.112.426,25         |
| ITSA4                  | 6.368.490,00          | 471.922,93           | 392.626,97          | 4,65%          | 1.210.013,10         | -1.210.013,10         | 933.620,63           | -941.262,82           |
| IREN3                  | 1.508.536,60          | 330.925,25           | 306.031,10          | 3,63%          | 301.707,32           | -301.707,32           | 221.151,47           | -222.961,71           |
| LWSA3                  | 101.034,23            | 10.141,25            | 6.647,95            | 0,08%          | 40.413,69            | -40.413,69            | 14.811,62            | -14.932,86            |
| MGLU3                  | 2.759.883,60          | 502.408,18           | 418.785,81          | 4,96%          | 1.435.139,47         | -1.241.947,62         | 404.598,94           | -407.910,80           |
| MGLU9                  | 539.750,52            | 25.685,26            | 586,65              | 0,01%          | 0,00                 | 0,00                  | 0,00                 | 0,00                  |
| NTCO3                  | 3.758.949,39          | 480.496,94           | 392.287,81          | 4,65%          | 939.737,35           | -939.760,39           | 551.061,98           | -555.572,72           |
| ONCO3                  | 492.340,00            | 118.848,69           | 90.324,61           | 1,07%          | 172.319,00           | -172.319,00           | 72.177,04            | -72.767,85            |
| OUTRAS_DESPESAS        | 0,00                  | 0,00                 | 0,00                | 0,00%          | 0,00                 | 0,00                  | 0,00                 | 0,00                  |
| PRI03                  | 5.197.119,00          | 390.844,09           | 43.563,15           | 0,52%          | 3.118.271,40         | -3.118.271,40         | 761.897,65           | -768.134,19           |
| RAIL3                  | 8.358.551,68          | 365.440,85           | 6.974,09            | 0,08%          | 3.761.311,47         | -2.758.358,84         | 1.225.363,68         | -1.235.393,94         |
| RECV3                  | 3.644.557,00          | 315.143,87           | -128.826,30         | -1,53%         | 2.186.734,20         | -2.186.734,20         | 534.292,06           | -538.665,53           |
| RENT3                  | 6.427.893,00          | 1.203.835,70         | 1.127.427,91        | 13,36%         | 2.121.204,69         | -1.671.252,18         | 942.329,11           | -950.042,59           |
| RENT9                  | 21.412,00             | 3.974,49             | 3.732,84            | 0,04%          | 0,00                 | 0,00                  | 0,00                 | 0,00                  |
| SBSP3                  | 667.318,80            | 38.033,65            | 25.871,09           | 0,31%          | 166.828,96           | -166.829,70           | 97.828,94            | -98.628,72            |
| SCAR3                  | 170.048,00            | 17.737,81            | 5.757,38            | 0,07%          | 102.028,80           | -102.028,80           | 24.929,04            | -25.133,09            |
| SMFT3                  | 2.741.966,00          | 367.843,68           | 336.626,34          | 3,99%          | 1.096.786,40         | -1.096.786,40         | 401.972,22           | -405.262,58           |
| SOMA3                  | 2.858.100,00          | 493.315,85           | 437.514,20          | 5,19%          | 857.430,00           | -857.470,83           | 418.997,46           | -422.427,18           |
| SUZB3                  | 8.080.984,45          | 786.980,13           | 193.164,40          | 2,29%          | 2.020.246,11         | -1.616.196,89         | 1.184.672,32         | -1.194.369,50         |
| WDOJ24                 | 0,00                  | 0,00                 | 0,00                | 0,00%          | 0,00                 | 0,00                  | 0,00                 | 0,00                  |
| YDUQ3                  | 3.073.769,56          | 463.238,09           | 429.024,76          | 5,09%          | 1.198.770,13         | -768.442,39           | 450.614,62           | -454.303,14           |
| <b>Total Var:</b>      | <b>116.614.061,08</b> | <b>11.753.577,59</b> | <b>8.436.533,26</b> | <b>100,01%</b> | <b>33.045.860,99</b> | <b>-31.593.337,87</b> | <b>14.434.007,85</b> | <b>-14.555.327,05</b> |

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – FEVEREIRO 2024



bradesco

Data: 29/02/2024

## Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIA RVA EMB IV  
CNPJ: 38452613000132

| Dados Gerais |                |            |         |               |            |
|--------------|----------------|------------|---------|---------------|------------|
| PL:          | 109.723.173,20 | VAR / PL:  | 5,0567% | Limite Fundo: | 0,00%      |
| VAR:         | 5.548.341,85   | ETL / PL:  | 6,3413% | Status:       | ENQUADRADO |
| ETL:         | 6.957.844,51   | VAR / CDI: | 0,0557% | Benchmark:    |            |
|              |                |            |         | Dutacion DC:  | 1,00       |
|              |                |            |         | Dutacion DU:  | 1,00       |

| Cenários de STRESS        |               |                            |                 |                         |                 |
|---------------------------|---------------|----------------------------|-----------------|-------------------------|-----------------|
| Cenário Alta - 09999 (+): | 29.052.773,05 | Cenário Baixa - 10000 (+): | 275,54          | CENARIO BRADESCO 1 (+): | 14.691.166,54   |
| Cenário Alta - 09999 (-): | (270,17)      | Cenário Baixa - 10000 (-): | (27.327.575,69) | CENARIO BRADESCO 1 (-): | -               |
| Cenário Alta - 09999:     | 29.052.502,88 | Cenário Baixa - 10000:     | (27.327.300,14) | CENARIO BRADESCO 1:     | 14.691.166,54   |
|                           |               |                            |                 | CENARIO BRADESCO 2 (+): | -               |
|                           |               |                            |                 | CENARIO BRADESCO 2 (-): | (14.811.945,27) |
|                           |               |                            |                 | CENARIO BRADESCO 2:     | (14.811.945,27) |

| 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    |
|------------------------|-----------------------|---------------------|---------------------|----------------|----------------------|-----------------------|----------------------|-----------------------|
| AURE3                  | 1.456.589,90          | 92.015,60           | 65.778,09           | 1,19%          | 364.147,48           | -451.554,22           | 213.536,08           | -215.283,99           |
| CAIXA                  | 1.000,00              | 0,00                | 0,00                | 0,00%          | 0,00                 | 0,00                  | 0,00                 | 0,00                  |
| COMPROMISSADA_PRE      | 9.493.292,73          | 106,62              | 25,19               | 0,00%          | -270,17              | 275,54                | 1.018,97             | -1.550,93             |
| CONTAS_A_PAGAR_RECEBER | 10.829,99             | 0,00                | 0,00                | 0,00%          | 0,00                 | 0,00                  | 0,00                 | 0,00                  |
| CPLES                  | 2.414.211,48          | 163.175,77          | 147.370,05          | 2,66%          | 531.126,53           | -531.126,53           | 353.923,40           | -356.820,46           |
| CPLE6                  | 5.346.000,24          | 367.964,58          | 321.764,14          | 5,80%          | 1.176.120,05         | -1.176.120,05         | 783.723,64           | -790.138,84           |
| DESPESAS               | 0,00                  | 0,00                | 0,00                | 0,00%          | 0,00                 | 0,00                  | 0,00                 | 0,00                  |
| ENGH1                  | 10.748.287,76         | 938.503,00          | 851.953,89          | 15,36%         | 1.827.208,92         | -2.364.623,31         | 1.575.698,99         | -1.588.596,93         |
| ENGH4                  | 16,96                 | 1,28                | 1,15                | 0,00%          | 13,57                | -13,57                | 2,49                 | -2,51                 |
| EQTL3                  | 7.786.443,26          | 525.953,44          | 321.451,82          | 5,79%          | 1.557.288,65         | -1.557.288,65         | 1.141.492,58         | -1.150.836,31         |
| GGPS3                  | 6.593.853,06          | 618.299,58          | 314.718,91          | 5,67%          | 2.967.233,88         | -2.967.233,88         | 966.658,86           | -974.571,48           |
| GMAT3                  | 8.315.884,83          | 1.090.890,13        | 401.753,14          | 7,24%          | 1.496.859,27         | -1.330.541,57         | 1.219.108,72         | -1.229.087,78         |
| HAPV3                  | 4.273.872,81          | 847.254,89          | 659.967,49          | 11,89%         | 1.453.116,76         | -1.453.233,21         | 626.549,75           | -631.678,40           |
| ITUB4                  | 12.539.438,46         | 965.534,84          | 834.916,14          | 15,05%         | 2.507.850,75         | -2.382.493,31         | 1.838.281,68         | -1.853.329,00         |
| MATD3                  | 965.739,19            | 188.869,44          | 162.060,03          | 2,92%          | 289.721,76           | -289.721,76           | 141.577,37           | -142.736,25           |
| OUTRAS_DESPESAS        | 0,00                  | 0,00                | 0,00                | 0,00%          | 0,00                 | 0,00                  | 0,00                 | 0,00                  |
| PRIO3                  | 7.583.510,16          | 570.310,23          | 193.599,56          | 3,49%          | 4.550.106,10         | -4.550.106,10         | 1.111.742,69         | -1.120.842,80         |
| RAIL3                  | 10.138.550,08         | 443.263,44          | 78.192,29           | 1,41%          | 4.562.302,91         | -3.345.766,15         | 1.486.311,44         | -1.498.477,70         |
| RENT3                  | 3.235.809,00          | 606.012,33          | 475.849,97          | 8,57%          | 1.067.816,97         | -841.310,34           | 474.369,60           | -478.252,57           |
| RENT9                  | 12.402,00             | 2.302,05            | 1.817,18            | 0,03%          | 0,00                 | 0,00                  | 0,00                 | 0,00                  |
| UGPA3                  | 12.308.328,56         | 733.378,65          | 566.393,85          | 10,57%         | 3.077.082,14         | -2.461.665,71         | 1.804.400,97         | -1.819.170,96         |
| VBBR3                  | 6.499.109,34          | 445.261,57          | 130.928,97          | 2,36%          | 1.624.777,34         | -1.624.777,34         | 952.769,43           | -960.568,36           |
| <b>Total Var:</b>      | <b>109.723.169,81</b> | <b>8.599.099,44</b> | <b>5.548.341,85</b> | <b>100,00%</b> | <b>29.052.502,88</b> | <b>-27.327.300,14</b> | <b>14.691.166,54</b> | <b>-14.811.945,27</b> |





## Relatório de Risco de Mercado

Data: 29/02/2024

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

| Dados Gerais |                |            |         |               |            |
|--------------|----------------|------------|---------|---------------|------------|
| PL:          | 118.242.517,04 | VAR / PL:  | 6,8229% | Limite Fundo: | 0,00%      |
| VAR:         | 8.067.623,65   | ETL / PL:  | 8,5563% | Status:       | ENQUADRADO |
| ETL:         | 10.117.125,53  | VAR / CDI: | 0,0752% | Benchmark:    |            |
|              |                |            |         | Dutacion DC:  | 6,44       |
|              |                |            |         | Dutacion DU:  | 4,76       |

| Cenários de STRESS        |               |                            |                 |                         |                 |
|---------------------------|---------------|----------------------------|-----------------|-------------------------|-----------------|
| Cenário Alta - 09999 (+): | 30.316.680,44 | Cenário Baixa - 10000 (+): | 7.478,74        | CENARIO BRADESCO 1 (+): | 17.045.826,51   |
| Cenário Alta - 09999 (-): | (4.311,78)    | Cenário Baixa - 10000 (-): | (30.749.944,23) | CENARIO BRADESCO 1 (-): | (11,87)         |
| Cenário Alta - 09999:     | 30.312.368,67 | Cenário Baixa - 10000:     | (30.742.465,49) | CENARIO BRADESCO 1:     | 17.045.814,64   |
|                           |               |                            |                 | CENARIO BRADESCO 2 (+): | 18,07           |
|                           |               |                            |                 | CENARIO BRADESCO 2 (-): | (17.184.204,81) |
|                           |               |                            |                 | CENARIO BRADESCO 2:     | (17.184.186,74) |

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

| Produto           | MtM                   | VAR Tot.             | Comp. VAR           | Comp. VAR (%)  | Cenário Alta - 09999 | Cenário Baixa - 10000 | CENARIO BRADESCO 1   | CENARIO BRADESCO 2    |
|-------------------|-----------------------|----------------------|---------------------|----------------|----------------------|-----------------------|----------------------|-----------------------|
| TIMS3             | 768.518,32            | 51.090,34            | 27.588,35           | 0,34%          | 245.925,86           | -176.769,21           | 112.664,79           | -113.587,01           |
| TOTS3             | 826.052,04            | 112.125,69           | 98.145,24           | 1,22%          | 165.210,41           | -165.210,41           | 121.099,23           | -122.090,49           |
| TRPL4             | 534.601,80            | 68.745,70            | 48.336,29           | 0,60%          | 106.920,36           | -133.650,45           | 78.372,62            | -79.014,15            |
| UGPA3             | 1.669.908,72          | 99.499,73            | 76.476,69           | 0,95%          | 417.477,18           | -333.951,74           | 244.808,62           | -246.812,51           |
| USM5              | 298.535,76            | 43.223,43            | 22.216,92           | 0,28%          | 116.428,95           | -65.677,67            | 43.785,34            | -44.123,59            |
| VALE3             | 14.719.042,80         | 1.854.988,62         | 1.797.744,95        | 22,28%         | 3.679.760,70         | -3.679.782,67         | 2.157.811,67         | -2.175.474,53         |
| VAMQ3             | 192.592,53            | 41.717,96            | 34.573,52           | 0,43%          | 67.407,39            | -77.037,01            | 28.234,07            | -28.465,18            |
| VBBR3             | 1.508.749,98          | 103.366,22           | 6.147,20            | 0,08%          | 377.187,50           | -377.187,50           | 221.182,75           | -222.993,25           |
| VIVT3             | 1.206.732,00          | 102.084,22           | 33.317,07           | 0,41%          | 181.009,80           | -181.009,80           | 176.906,91           | -178.354,99           |
| WEGE3             | 2.845.859,85          | 370.865,87           | 185.628,14          | 2,30%          | 711.464,96           | -711.464,96           | 417.203,05           | -420.618,09           |
| YDUQ3             | 308.413,28            | 46.479,99            | 41.150,34           | 0,51%          | 120.281,18           | -77.103,32            | 45.213,39            | -45.583,48            |
| <b>Total Var:</b> | <b>118.241.460,27</b> | <b>12.421.983,82</b> | <b>8.067.623,65</b> | <b>100,02%</b> | <b>30.312.368,66</b> | <b>-30.742.465,49</b> | <b>17.045.814,64</b> | <b>-17.184.186,74</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 – FEVEREIRO 2024



## RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO - EMBRAER PREV

29/02/2024

| INFORMAÇÕES DOS ATIVOS                 |               |             |                |          |               |       | INFORMAÇÕES DE RATING |          |  |
|--|---------------|-------------|----------------|----------|---------------|-------|-----------------------|----------|--|
| Fundo                                  | DataAquisição | DataEmissão | DataVencimento | Emissor  | Financeiro    | S&P   | Moody's               | Fitch    |  |
| FIR F EMB V CREDITO PRIVADO            | 18/05/16      | 15/10/12    | 15/10/24       | TRANS AL | 650.289,96    | brAA- | Aaa.br                | AAA(bra) |  |
| FIR F EMB V CREDITO PRIVADO            | 03/06/16      | 15/10/12    | 15/10/24       | TRANS AL | 240.508,89    | brAA- | Aaa.br                | AAA(bra) |  |
| FIR F EMB V CREDITO PRIVADO            | 03/06/16      | 15/10/12    | 15/10/24       | TRANS AL | 144.305,34    | brAA- | Aaa.br                | AAA(bra) |  |
| FIR F EMB V CREDITO PRIVADO            | 20/06/16      | 15/10/12    | 15/10/24       | TRANS AL | 480.746,98    | brAA- | Aaa.br                | AAA(bra) |  |
| FIR F EMB II                           | 25/08/17      | 25/08/17    | 15/08/24       | PETR     | 9.436.093,40  | AAA   | Aaa.br                | AA(bra)  |  |
| FIR F EMB V CREDITO PRIVADO            | 18/12/17      | 06/08/17    | 06/11/27       | RB CAPIT | 3.069.445,74  | -     | -                     | AAA(bra) |  |
| FIR F EMB V CREDITO PRIVADO            | 21/12/17      | 06/08/17    | 06/11/27       | RB CAPIT | 895.951,62    | -     | -                     | AAA(bra) |  |
| FIR F EMB V CREDITO PRIVADO            | 26/01/18      | 06/08/17    | 06/11/27       | RB CAPIT | 3.182.613,64  | -     | -                     | AAA(bra) |  |
| FIR F EMB II                           | 19/02/18      | 19/02/18    | 15/02/25       | SABESP   | 4.760.727,65  | brAAA | -                     | AAA(bra) |  |
| FIR F EMB V CREDITO PRIVADO            | 19/02/18      | 19/02/18    | 15/02/25       | SABESP   | 2.954.551,57  | brAAA | -                     | AAA(bra) |  |
| FIR F EMB V CREDITO PRIVADO            | 13/03/18      | 13/03/18    | 15/12/30       | ENTREVIA | 12.701.534,13 | brAA  | -                     | AA(bra)  |  |
| FIR F EMB II                           | 23/05/18      | 23/05/18    | 15/05/28       | COMGAS   | 26.255.859,23 | -     | -                     | AAA(bra) |  |
| FIR F EMB V CREDITO PRIVADO            | 15/06/18      | 13/03/18    | 15/12/30       | ENTREVIA | 625.338,03    | brAA  | -                     | AA(bra)  |  |
| FIR F EMB V CREDITO PRIVADO            | 15/06/18      | 13/03/18    | 15/12/30       | ENTREVIA | 625.338,03    | brAA  | -                     | AA(bra)  |  |
| FIR F EMB V CREDITO PRIVADO            | 15/06/18      | 13/03/18    | 15/12/30       | ENTREVIA | 625.338,03    | brAA  | -                     | AA(bra)  |  |
| FIR F EMB V CREDITO PRIVADO            | 15/06/18      | 13/03/18    | 15/12/30       | ENTREVIA | 624.121,06    | brAA  | -                     | AA(bra)  |  |
| FIR F EMB V CREDITO PRIVADO            | 15/06/18      | 13/03/18    | 15/12/30       | ENTREVIA | 625.338,03    | brAA  | -                     | AA(bra)  |  |
| FIR F EMB V CREDITO PRIVADO            | 04/07/18      | 04/07/18    | 15/06/25       | ECORODOV | 12.874.166,02 | brAAA | A2.br                 | AA(bra)  |  |
| FIR F EMB V CREDITO PRIVADO            | 26/07/18      | 26/07/18    | 15/07/25       | AEGEA SA | 14.820.487,46 | brA   | Aa1.br                | AA(bra)  |  |
| FIR F EMB II                           | 26/07/18      | 26/07/18    | 15/07/25       | CSMG     | 8.037.618,20  | -     | Aa3.br                | AA(bra)  |  |
| FIR F EMB V CREDITO PRIVADO            | 07/08/18      | 15/02/13    | 15/02/25       | CEMG     | 672.288,09    | brA+  | A1.br                 | AA-(bra) |  |
| FIM EMB IA                             | 12/02/19      | 09/01/19    | 15/01/25       | ITAUBB   | 2.513.557,57  | -     | AAA.br                | AAA(bra) |  |
| FIR F EMB V CREDITO PRIVADO            | 19/08/20      | 24/05/19    | 15/05/26       | OMEGA GE | 581.486,75    | -     | -                     | AA(bra)  |  |
| FIR F EMB V CREDITO PRIVADO            | 19/08/20      | 24/05/19    | 15/05/26       | OMEGA GE | 3.681.817,58  | -     | -                     | AA(bra)  |  |
| FIR F EMB V CREDITO PRIVADO            | 19/08/20      | 24/05/19    | 15/05/26       | OMEGA GE | 2.096.707,05  | -     | -                     | AA(bra)  |  |
| FIR F EMB V CREDITO PRIVADO            | 19/08/20      | 24/05/19    | 15/05/26       | OMEGA GE | 6.339.044,31  | -     | -                     | AA(bra)  |  |
| FIR F EMB V CREDITO PRIVADO            | 19/08/20      | 17/07/19    | 15/07/29       | GUARIROB | 734.337,52    | -     | -                     | AA(bra)  |  |
| FIR F EMB V CREDITO PRIVADO            | 19/08/20      | 17/07/19    | 15/07/29       | GUARIROB | 5.941.458,17  | -     | -                     | AA(bra)  |  |
| FIR F EMB V CREDITO PRIVADO            | 19/08/20      | 17/07/19    | 15/07/29       | GUARIROB | 8.812.050,31  | -     | -                     | AA(bra)  |  |
| FIR F EMB V CREDITO PRIVADO            | 19/08/20      | 17/07/19    | 15/07/29       | GUARIROB | 907.908,21    | -     | -                     | AA(bra)  |  |
| FIR F EMB V CREDITO PRIVADO            | 19/08/20      | 24/05/19    | 15/05/26       | OMEGA GE | 636.001,13    | -     | -                     | AA(bra)  |  |
| FIM EMB IA                             | 30/09/20      | 28/09/20    | 22/09/25       | HAPVIDA  | 178.921,67    | -     | -                     | AAA(bra) |  |
| FIR F EMB II A CRED PRIV               | 08/01/21      | 22/05/19    | 15/04/24       | ECORODOV | 1.381.447,63  | -     | -                     | AA(bra)  |  |
| FIR F EMB II A CRED PRIV               | 05/02/21      | 07/08/19    | 15/07/24       | COPEL GT | 144.287,55    | -     | -                     | AA+(bra) |  |
| FIR F EMB II                           | 12/02/21      | 13/03/18    | 15/12/30       | ENTREVIA | 6.169.519,82  | brAA  | -                     | AA(bra)  |  |
| FIR F EMB II                           | 12/02/21      | 13/03/18    | 15/12/30       | ENTREVIA | 6.181.779,04  | brAA  | -                     | AA(bra)  |  |
| FIR F EMB II                           | 12/02/21      | 17/05/19    | 15/05/29       | ELETROB  | 4.393.986,70  | brAAA | -                     | -        |  |
| FIR F EMB II                           | 12/02/21      | 17/07/19    | 15/06/29       | NEOENERG | 637.234,14    | brAA+ | -                     | -        |  |
| FIR F EMB II                           | 12/02/21      | 17/07/19    | 15/06/29       | NEOENERG | 6.334.425,35  | brAA+ | -                     | -        |  |
| FIR F EMB II                           | 12/02/21      | 17/05/19    | 15/05/29       | ELETROB  | 1.819.530,86  | brAAA | -                     | -        |  |
| FIR F EMB II                           | 12/02/21      | 17/05/19    | 15/05/29       | ELETROB  | 3.487.368,89  | brAAA | -                     | -        |  |
| FIR F EMB II                           | 12/02/21      | 17/05/19    | 15/05/29       | ELETROB  | 3.731.136,47  | brAAA | -                     | -        |  |
| FIR F EMB II                           | 12/02/21      | 31/07/20    | 15/07/34       | IGUA SAN | 2.609.941,79  | brAA  | -                     | -        |  |
| FIR F EMB II                           | 12/02/21      | 23/05/18    | 15/05/28       | COMGAS   | 22.865.836,15 | -     | -                     | AAA(bra) |  |
| FIR F EMB V CREDITO PRIVADO            | 14/05/21      | 15/10/12    | 15/10/24       | TRANS AL | 242.903,73    | brAA- | Aaa.br                | AAA(bra) |  |
| FIR F EMB V CREDITO PRIVADO            | 14/05/21      | 15/10/12    | 15/10/24       | TRANS AL | 427.510,56    | brAA- | Aaa.br                | AAA(bra) |  |
| FIR F EMB V CREDITO PRIVADO            | 14/05/21      | 15/10/12    | 15/10/24       | TRANS AL | 485.807,46    | brAA- | Aaa.br                | AAA(bra) |  |
| FIR F EMB V CREDITO PRIVADO            | 14/05/21      | 15/10/12    | 15/10/24       | TRANS AL | 242.903,73    | brAA- | Aaa.br                | AAA(bra) |  |
| FIR F EMB V CREDITO PRIVADO            | 14/05/21      | 15/10/12    | 15/10/24       | TRANS AL | 297.314,16    | brAA- | Aaa.br                | AAA(bra) |  |
| FIR F EMB V CREDITO PRIVADO            | 14/05/21      | 15/10/12    | 15/10/24       | TRANS AL | 250.400,72    | brAA- | Aaa.br                | AAA(bra) |  |
| FIR F EMB V CREDITO PRIVADO            | 14/05/21      | 15/10/12    | 15/10/24       | TRANS AL | 726.501,13    | brAA- | Aaa.br                | AAA(bra) |  |
| FIR F EMB V CREDITO PRIVADO            | 14/05/21      | 26/10/16    | 27/01/25       | BRADESCO | 14.728.154,87 | brAAA | Aa1.br                | AAA(bra) |  |
| FIR F EMB V CREDITO PRIVADO            | 14/05/21      | 12/12/17    | 15/11/24       | CCR      | 3.191.588,38  | brAAA | -                     | AA(bra)  |  |
| FIR F EMB V CREDITO PRIVADO            | 14/05/21      | 14/12/17    | 15/11/24       | ECORODOV | 2.127.158,96  | brAA  | A2.br                 | -        |  |
| FIR F EMB V CREDITO PRIVADO            | 14/05/21      | 19/02/18    | 15/02/25       | SABESP   | 693.870,58    | brAAA | -                     | AAA(bra) |  |
| FIR F EMB V CREDITO PRIVADO            | 14/05/21      | 23/05/18    | 15/05/28       | COMGAS   | 10.162.463,71 | -     | -                     | AAA(bra) |  |
| FIR F EMB V CREDITO PRIVADO            | 14/05/21      | 28/06/18    | 15/06/27       | JAGUARA  | 1.598.588,52  | -     | -                     | AAA(bra) |  |
| FIR F EMB V CREDITO PRIVADO            | 14/05/21      | 28/06/18    | 15/06/27       | ENERGMIR | 1.019.269,72  | -     | -                     | AAA(bra) |  |
| FIR F EMB V CREDITO PRIVADO            | 14/05/21      | 31/07/18    | 01/08/25       | BRADESCO | 4.747.962,89  | brAAA | Aa1.br                | AAA(bra) |  |
| FIRENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 28/05/21      | 27/02/20    | 15/12/34       | VIARONDO | 191.083,03    | -     | -                     | AA-(bra) |  |
| FIRENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 28/05/21      | 13/10/20    | 15/10/30       | LAMEA    | 334.970,00    | -     | -                     | D        |  |
| FIRENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 28/05/21      | 22/12/20    | 15/12/26       | IRB      | 2.696.880,69  | brAA+ | -                     | -        |  |
| FIRENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 28/05/21      | 13/10/20    | 15/10/30       | LAMEA    | 164.000,00    | -     | -                     | D        |  |
| FIRENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 28/05/21      | 23/09/20    | 15/10/36       | PAMPASUL | 920.691,02    | -     | -                     | AAA(bra) |  |
| FIRENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 28/05/21      | 13/10/20    | 15/10/30       | LAMEA    | 76.875,00     | -     | -                     | D        |  |
| FIRENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 28/05/21      | 10/02/21    | 15/12/31       | METRORIO | 1.414.504,47  | brAA  | -                     | AA-(bra) |  |
| FIRENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 28/05/21      | 07/04/21    | 15/03/31       | LOCALIZA | 5.527.469,93  | brAAA | Aa1.br                | AAA(bra) |  |
| FIRENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 28/05/21      | 27/02/20    | 15/12/34       | VIARONDO | 1.727.953,25  | -     | -                     | AA-(bra) |  |
| FIRENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 09/06/21      | 06/01/21    | 15/11/25       | QUATA    | 581.233,48    | -     | -                     | A(bra)   |  |
| FIRENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 10/06/21      | 26/08/20    | 25/08/25       | CSAN     | 18.826,72     | -     | -                     | AAA(bra) |  |
| FIRENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 10/06/21      | 26/12/19    | 25/11/24       | DASA     | 217.876,30    | -     | -                     | AA       |  |
| FIRENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 10/06/21      | 26/08/20    | 25/08/25       | CSAN     | 508.321,43    | -     | -                     | AAA(bra) |  |
| FIRENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 10/06/21      | 24/11/20    | 04/11/25       | HAPVIDA  | 340.780,17    | -     | -                     | AAA(bra) |  |
| FIRENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 10/06/21      | 24/11/20    | 04/11/25       | HAPVIDA  | 340.780,17    | -     | -                     | AAA(bra) |  |
| FIRENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 10/06/21      | 11/12/20    | 27/11/25       | SANEAMEN | 291.057,99    | -     | -                     | AA-      |  |
| FIRENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 10/06/21      | 11/12/20    | 27/11/25       | SANEAMEN | 591.581,29    | -     | -                     | AA-      |  |
| FIRENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 10/06/21      | 11/12/20    | 27/11/25       | SANEAMEN | 582.707,57    | -     | -                     | AA-      |  |
| FIRENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 10/06/21      | 26/12/19    | 25/11/24       | DASA     | 884.897,12    | -     | -                     | AA       |  |
| FIRENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 10/06/21      | 26/12/19    | 25/11/24       | DASA     | 220.966,74    | -     | -                     | AA       |  |
| FIRENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 10/06/21      | 26/08/20    | 25/08/25       | CSAN     | 127.080,36    | -     | -                     | AAA(bra) |  |
| FIRENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 10/06/21      | 26/08/20    | 25/08/25       | CSAN     | 318.037,09    | -     | -                     | AAA(bra) |  |

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – FEVEREIRO 2024



## RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO - EMBRAER PREV

29/02/2024

| INFORMAÇÕES DOS ATIVOS                |               |             |                |           |              | INFORMAÇÕES DE RATING |         |          |
|---------------------------------------|---------------|-------------|----------------|-----------|--------------|-----------------------|---------|----------|
| Fundo                                 | DataAquisição | DataEmissão | DataVencimento | Emissor   | Financeiro   | S&P                   | Moody's | Fitch    |
| FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO | 10/06/21      | 24/11/20    | 04/11/25       | HAPVIDA   | 1.021.639,31 | -                     | -       | AAA(bra) |
| FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO | 14/06/21      | 19/06/19    | 19/06/24       | BNBBM     | 612.200,25   | brAAA                 | AAb     | AA(bra)  |
| FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO | 14/06/21      | 12/06/19    | 12/06/24       | BNBBM     | 927.989,51   | brAAA                 | AAb     | AA(bra)  |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV     | 15/06/21      | 24/11/20    | 15/12/30       | LAMEA     | 83.230,00    | -                     | -       | D        |
| FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO | 16/06/21      | 15/03/21    | 15/03/29       | OMEGA GE  | 406.392,53   | -                     | -       | AA-(bra) |
| FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO | 17/06/21      | 18/03/21    | 15/02/31       | CORSAN    | 830.206,78   | -                     | -       | AA(bra)  |
| FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO | 17/06/21      | 18/03/21    | 15/02/26       | CORSAN    | 505.325,16   | -                     | -       | AA(bra)  |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV     | 18/06/21      | 18/06/21    | 15/12/30       | MG050     | 537.162,73   | brAA+                 | -       | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV     | 25/06/21      | 13/10/20    | 15/10/30       | LAMEA     | 50.225,00    | -                     | -       | D        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV     | 25/06/21      | 12/02/21    | 15/12/35       | MS 306    | 780.101,14   | -                     | A.br    | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV     | 25/06/21      | 13/10/20    | 15/10/30       | LAMEA     | 260.350,00   | -                     | -       | D        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV     | 25/06/21      | 12/02/21    | 15/12/35       | MS 306    | 89.122,98    | -                     | A.br    | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO | 25/06/21      | 25/06/21    | 20/06/26       | OURO VER  | 1.450.266,64 | -                     | -       | AA-(bra) |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV     | 30/06/21      | 12/02/21    | 15/12/35       | MS 306    | 3.300.851,07 | -                     | A.br    | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV     | 01/07/21      | 12/02/21    | 15/12/35       | MS 306    | 2.887.144,41 | -                     | A.br    | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO | 02/07/21      | 01/03/21    | 18/02/25       | RENNER    | 555.516,66   | brAAA                 | -       | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO | 02/07/21      | 01/03/21    | 18/02/25       | RENNER    | 117.483,92   | brAAA                 | -       | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV     | 07/07/21      | 07/04/21    | 15/03/29       | CAGECE    | 1.301.308,75 | -                     | -       | AA-(bra) |
| FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO | 08/07/21      | 08/07/21    | 15/06/31       | VAMOS     | 270.519,18   | brAA+                 | -       | AAA(bra) |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV     | 08/07/21      | 07/04/21    | 15/03/29       | CAGECE    | 2.965.745,74 | -                     | -       | AA-(bra) |
| FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO | 12/07/21      | 12/07/21    | 12/07/26       | BRADESCO  | 4.391.165,16 | brAAA                 | Aa1.br  | AAA(bra) |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV     | 13/07/21      | 22/12/20    | 15/12/26       | IRB       | 2.118.286,00 | brAA+                 | -       | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV     | 13/07/21      | 27/02/20    | 15/12/34       | VIARONDO  | 237.974,57   | -                     | -       | AA-(bra) |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV     | 13/07/21      | 22/12/20    | 15/12/26       | IRB       | 1.028.881,77 | brAA+                 | -       | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV     | 13/07/21      | 24/11/20    | 15/12/30       | LAMEA     | 299.710,00   | -                     | -       | D        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV     | 13/07/21      | 22/12/20    | 15/12/26       | IRB       | 535.018,52   | brAA+                 | -       | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV     | 13/07/21      | 24/11/20    | 15/12/30       | LAMEA     | 264.450,00   | -                     | -       | D        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV     | 13/07/21      | 24/11/20    | 15/12/30       | LAMEA     | 387.860,00   | -                     | -       | D        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV     | 13/07/21      | 24/11/20    | 15/12/30       | LAMEA     | 193.930,00   | -                     | -       | D        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV     | 13/07/21      | 27/02/20    | 15/12/34       | VIARONDO  | 2.002.268,76 | -                     | -       | AA-(bra) |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV     | 13/07/21      | 27/02/20    | 15/12/34       | VIARONDO  | 313.001,03   | -                     | -       | AA-(bra) |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV     | 13/07/21      | 22/12/20    | 15/12/26       | IRB       | 4.236.572,01 | brAA+                 | -       | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO | 15/07/21      | 02/10/18    | 20/09/24       | IGUATEMI  | 389.015,79   | -                     | -       | AAA(bra) |
| FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO | 15/07/21      | 02/10/18    | 20/09/24       | IGUATEMI  | 389.015,79   | -                     | -       | AAA(bra) |
| FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO | 15/07/21      | 02/10/18    | 20/09/24       | IGUATEMI  | 1.386.925,85 | -                     | -       | AAA(bra) |
| FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO | 15/07/21      | 10/12/19    | 15/07/27       | RT BANDE  | 837.238,59   | -                     | -       | AAA(bra) |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV     | 16/07/21      | 18/03/21    | 15/02/31       | CORSAN    | 2.465.252,91 | -                     | -       | AA(bra)  |
| FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO | 19/07/21      | 31/07/20    | 15/07/30       | PARANAGU  | 586.499,84   | brAA                  | -       | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV     | 19/07/21      | 13/10/20    | 15/10/30       | LAMEA     | 331.690,00   | -                     | -       | D        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV     | 21/07/21      | 23/09/20    | 15/10/36       | PAMPASUL  | 2.148.279,05 | -                     | -       | AAA(bra) |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV     | 21/07/21      | 23/09/20    | 15/10/36       | PAMPASUL  | 787.197,70   | -                     | -       | AAA(bra) |
| FIM EMB IA                            | 21/07/21      | 11/06/18    | 15/05/25       | INTERVIA  | 1.305.568,12 | -                     | Aa2.br  | -        |
| FIM EMB IA                            | 21/07/21      | 17/03/21    | 05/03/24       | ENERG TR  | 1.345.276,36 | -                     | -       | AAA(bra) |
| FIM EMB IA                            | 21/07/21      | 10/12/19    | 15/07/27       | RT BANDE  | 1.068.238,35 | -                     | -       | AAA(bra) |
| FIM EMB IA                            | 21/07/21      | 15/03/21    | 15/03/29       | OMEGA GE  | 957.722,25   | -                     | -       | AA-(bra) |
| FIM EMB IA                            | 21/07/21      | 20/09/19    | 20/08/26       | VAMOS     | 1.027.288,34 | brAA+                 | -       | AA-(bra) |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV     | 23/07/21      | 18/06/21    | 15/12/30       | MG050     | 1.611.488,20 | brAA+                 | -       | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO | 29/07/21      | 07/11/19    | 15/10/24       | BKBR      | 1.060.737,18 | -                     | -       | AA(bra)  |
| FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO | 29/07/21      | 23/12/20    | 15/12/26       | RD COLIN  | 2.126.303,35 | brAA+                 | -       | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO | 04/08/21      | 04/08/21    | 15/07/39       | UTE GNA   | 390.006,65   | brA                   | -       | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO | 06/08/21      | 10/02/21    | 15/12/31       | METRORIO  | 663.708,72   | brAA                  | -       | AA-(bra) |
| FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO | 11/08/21      | 11/08/21    | 15/08/31       | CSAN      | 1.030.071,67 | -                     | -       | AAA(bra) |
| FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO | 11/08/21      | 19/11/19    | 15/06/27       | AUTOPIST  | 1.125.198,25 | brAAA                 | -       | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO | 17/08/21      | 02/06/20    | 15/05/30       | NORTE EN  | 2.875.646,02 | -                     | -       | AA(bra)  |
| FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO | 18/08/21      | 10/02/21    | 15/12/31       | METRORIO  | 1.231.093,91 | brAA                  | -       | AA-(bra) |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV     | 18/08/21      | 10/02/21    | 15/12/31       | METRORIO  | 955.318,32   | brAA                  | -       | AA-(bra) |
| FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO | 27/08/21      | 27/08/21    | 20/08/31       | S LUIZA A | 1.005.660,84 | -                     | -       | AAA(bra) |
| FIM EMB IA                            | 16/09/21      | 17/07/19    | 15/07/26       | GUARIROB  | 669.230,50   | -                     | -       | AA(bra)  |
| FIM EMB IA                            | 16/09/21      | 17/07/19    | 15/07/26       | GUARIROB  | 59.931,09    | -                     | -       | AA(bra)  |
| FIM EMB IA                            | 16/09/21      | 17/07/19    | 15/07/26       | GUARIROB  | 299.655,45   | -                     | -       | AA(bra)  |
| FIM EMB IA                            | 16/09/21      | 17/06/19    | 15/06/24       | PROLAGOS  | 1.126.205,65 | -                     | -       | AA(bra)  |
| FIM EMB IA                            | 16/09/21      | 12/05/21    | 15/04/26       | ELETROB   | 2.076.920,84 | brAAA                 | -       | -        |
| FIM EMB IA                            | 16/09/21      | 22/10/19    | 21/10/26       | AUTOBAN   | 557.969,96   | brAAA                 | -       | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO | 20/09/21      | 20/09/21    | 15/09/29       | MOV_PART  | 1.107.522,32 | brAA+                 | -       | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV     | 20/09/21      | 18/06/21    | 15/12/30       | MG050     | 1.074.325,46 | brAA+                 | -       | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV     | 20/09/21      | 18/06/21    | 15/12/30       | MG050     | 1.074.325,46 | brAA+                 | -       | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV     | 20/09/21      | 20/09/21    | 15/09/31       | MOV_PART  | 1.144.789,79 | brAA+                 | -       | AAA(bra) |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV     | 22/09/21      | 18/03/21    | 15/02/31       | CORSAN    | 853.268,08   | -                     | -       | AA(bra)  |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV     | 22/09/21      | 18/03/21    | 15/02/31       | CORSAN    | 853.268,08   | -                     | -       | AA(bra)  |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV     | 22/09/21      | 18/03/21    | 15/02/31       | CORSAN    | 283.653,98   | -                     | -       | AA(bra)  |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV     | 22/09/21      | 18/03/21    | 15/02/31       | CORSAN    | 283.653,98   | -                     | -       | AA(bra)  |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV     | 22/09/21      | 22/05/19    | 15/04/26       | ECORODOV  | 809.954,28   | -                     | -       | AA(bra)  |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV     | 22/09/21      | 22/05/19    | 15/04/26       | ECORODOV  | 809.954,28   | -                     | -       | AA(bra)  |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV     | 22/09/21      | 22/05/19    | 15/04/26       | ECORODOV  | 1.040.797,92 | -                     | -       | AA(bra)  |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV     | 22/09/21      | 22/05/19    | 15/04/26       | ECORODOV  | 404.309,96   | -                     | -       | AA(bra)  |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV     | 22/09/21      | 22/05/19    | 15/04/26       | ECORODOV  | 404.309,96   | -                     | -       | AA(bra)  |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV     | 23/09/21      | 23/09/21    | 15/09/31       | LOCAMERI  | 4.166.563,29 | brAAA                 | -       | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO | 23/09/21      | 23/09/21    | 15/09/31       | LOCAMERI  | 4.427.803,70 | brAAA                 | -       | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO | 24/09/21      | 05/04/21    | 15/03/24       | CCPR      | 42.309,39    | -                     | A.br    | -        |

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – FEVEREIRO 2024



## RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO - EMBRAER PREV

29/02/2024

| Fundo                                   | INFORMAÇÕES DOS ATIVOS |             |                |          | INFORMAÇÕES DE RATING |       |         |            |
|---|------------------------|-------------|----------------|----------|-----------------------|-------|---------|------------|
|   | DataAquisição          | DataEmissão | DataVencimento | Emissor  | Financeiro            | S&P   | Moody's | Fitch      |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 27/09/21               | 28/12/20    | 15/01/26       | LOCALIZA | 1.840.208,80          | brAAA | -       | -          |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 27/09/21               | 29/03/21    | 01/04/24       | CNH      | 2.527.034,65          | -     | -       | AAA(bra)   |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 30/09/21               | 30/09/21    | 15/09/31       | SMPAR    | 900.388,05            | brAA+ | -       | -          |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 04/10/21               | 10/02/21    | 15/12/31       | METRORIO | 651.833,22            | brAA  | -       | AA-(bra)   |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 08/10/21               | 08/10/21    | 15/09/41       | AESTUCAN | 2.619.711,39          | -     | -       | AA-(bra)   |
| FIM EMB IA                              | 20/10/21               | 20/10/21    | 20/10/25       | DAYCOVAL | 2.828.436,11          | brAA+ | AA.br   | AA(bra)    |
| FIM EMB IA                              | 20/10/21               | 20/10/21    | 20/10/24       | DAYCOVAL | 1.567.409,17          | brAA+ | AA.br   | AA(bra)    |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 22/10/21               | 22/10/21    | 15/12/35       | CART     | 2.415.397,85          | brAA+ | -       | -          |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 22/10/21               | 22/10/21    | 15/12/35       | CART     | 907.247,00            | brAA+ | -       | -          |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 25/10/21               | 22/04/21    | 15/03/26       | VIX LOGI | 178.252,69            | -     | -       | A+(bra)    |
| FIM EMB IA                              | 27/10/21               | 27/10/21    | 15/10/29       | CONT GLO | 2.051.105,66          | -     | -       | AA(bra)    |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 28/10/21               | 28/10/21    | 15/10/36       | HOLDARAG | 932.886,26            | brAAA | -       | -          |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 04/11/21               | 04/08/21    | 15/07/39       | UTE GNA  | 3.528.631,58          | brA   | -       | -          |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 10/11/21               | 10/11/21    | 15/10/28       | LIGHT    | 363.813,38            | -     | -       | D          |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 12/11/21               | 12/11/21    | 15/10/31       | VAMOS    | 2.224.730,21          | brAA+ | -       | AAA(bra)   |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 22/11/21               | 27/07/21    | 15/06/39       | ANEMUS   | 12.384,99             | -     | -       | AA(bra)    |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 26/11/21               | 22/05/19    | 15/04/26       | ECORODOV | 2.305.767,69          | -     | -       | AA(bra)    |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 30/11/21               | 27/07/21    | 15/06/39       | ANEMUS   | 2.410.119,40          | -     | -       | AA(bra)    |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 03/12/21               | 11/06/19    | 11/06/24       | BNBBM    | 612.861,64            | brAAA | AA.br   | AA(bra)    |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 06/12/21               | 06/12/21    | 15/12/35       | TESC     | 2.845.394,33          | -     | -       | A+(bra)    |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 09/12/21               | 06/01/21    | 15/11/25       | QUATA    | 2.603.520,79          | -     | -       | A(bra)     |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 20/12/21               | 20/12/21    | 15/11/35       | ORIZON   | 2.245.021,91          | brAA+ | -       | -          |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 10/01/22               | 22/04/21    | 15/03/26       | VIX LOGI | 1.025.753,50          | -     | -       | A+(bra)    |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 13/01/22               | 31/07/20    | 15/07/30       | PARANAGU | 1.187.640,64          | brAA  | -       | -          |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 25/01/22               | 10/12/19    | 15/07/34       | RT BANDE | 377.143,45            | -     | -       | AAA(bra)   |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 25/01/22               | 10/12/19    | 15/07/34       | RT BANDE | 2.245.502,65          | -     | -       | AAA(bra)   |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 10/02/22               | 22/10/21    | 15/12/35       | CART     | 377.037,71            | brAA+ | -       | -          |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 10/02/22               | 22/10/21    | 15/12/35       | CART     | 365.255,29            | brAA+ | -       | -          |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 10/02/22               | 10/02/22    | 15/12/35       | IP SUL C | 3.042.357,62          | -     | -       | AA+(bra)   |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 14/02/22               | 22/10/21    | 15/12/35       | CART     | 871.899,71            | brAA+ | -       | -          |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 14/02/22               | 22/10/21    | 15/12/35       | CART     | 777.640,28            | brAA+ | -       | -          |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 28/03/22               | 27/07/21    | 15/06/39       | ANEMUS   | 1.105.979,77          | -     | -       | AA(bra)    |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 19/04/22               | 19/04/22    | 16/04/29       | VERT-10  | 534.548,75            | -     | -       | AAAsf(bra) |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 26/04/22               | 26/04/22    | 15/04/24       | LIGHT    | 970.169,02            | -     | -       | D          |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 06/05/22               | 31/07/20    | 15/07/30       | PARANAGU | 105.070,46            | brAA  | -       | -          |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 06/05/22               | 31/07/20    | 15/07/30       | PARANAGU | 1.213.477,64          | brAA  | -       | -          |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 12/05/22               | 12/05/22    | 15/04/27       | BRKA     | 1.925.818,93          | -     | A+.br   | -          |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 12/05/22               | 31/07/20    | 15/07/30       | PARANAGU | 1.454.622,95          | brAA  | -       | -          |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 19/05/22               | 19/05/22    | 13/05/28       | CEA MODA | 525.530,88            | -     | -       | AA-(bra)   |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 26/05/22               | 26/05/22    | 10/05/27       | GUAR     | 2.518.988,57          | -     | -       | A          |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 30/05/22               | 28/10/21    | 15/10/36       | HOLDARAG | 2.662.944,00          | brAAA | -       | -          |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 30/05/22               | 10/02/22    | 15/12/35       | IP SUL C | 557.208,35            | -     | -       | AA+(bra)   |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 30/05/22               | 31/07/20    | 15/07/30       | PARANAGU | 1.118.741,98          | brAA  | -       | -          |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 03/03/22               | 08/10/21    | 15/09/41       | AESTUCAN | 3.452.784,79          | -     | -       | AA-(bra)   |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 04/03/22               | 04/07/18    | 15/06/25       | ECORODOV | 2.428.234,93          | brAAA | A2.br   | AA(bra)    |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 04/03/22               | 04/07/18    | 15/06/25       | ECORODOV | 1.083.651,53          | brAAA | A2.br   | AA(bra)    |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 07/03/22               | 22/07/21    | 15/12/36       | VIA BRAS | 3.387.166,08          | -     | -       | AA(bra)    |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 07/03/22               | 22/07/21    | 15/12/36       | VIA BRAS | 2.711.184,36          | -     | -       | AA(bra)    |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 07/06/22               | 06/12/21    | 15/12/35       | TESC     | 885.531,54            | -     | -       | A+(bra)    |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 10/06/22               | 10/02/22    | 15/12/35       | IP SUL C | 445.766,68            | -     | -       | AA+(bra)   |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 10/06/22               | 06/12/21    | 15/12/35       | TESC     | 555.436,57            | -     | -       | A+(bra)    |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 10/06/22               | 27/07/21    | 15/06/39       | ANEMUS   | 282.377,81            | -     | -       | AA(bra)    |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 13/06/22               | 30/09/21    | 15/09/31       | SMPAR    | 1.938.203,75          | brAA+ | -       | -          |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 13/06/22               | 08/07/21    | 15/06/31       | VAMOS    | 921.053,39            | brAA+ | -       | AAA(bra)   |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 13/06/22               | 08/07/21    | 15/06/31       | VAMOS    | 75.144,22             | brAA+ | -       | AAA(bra)   |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 13/06/22               | 15/03/21    | 15/03/29       | OMEGA GE | 796.680,92            | -     | -       | AA-(bra)   |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 13/06/22               | 15/03/21    | 15/03/29       | OMEGA GE | 900.884,13            | -     | -       | AA-(bra)   |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 21/06/22               | 10/12/19    | 15/07/34       | RT BANDE | 1.376.573,58          | -     | -       | AA(bra)    |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 27/06/22               | 27/06/22    | 07/07/24       | LAGE     | 2.499.523,23          | -     | -       | AA(bra)    |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 19/07/22               | 10/12/19    | 15/07/34       | RT BANDE | 3.375.433,85          | -     | -       | AA(bra)    |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 19/07/22               | 12/11/21    | 15/10/31       | VAMOS    | 2.151.314,11          | brAA+ | -       | AAA(bra)   |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 19/07/22               | 12/11/21    | 15/10/31       | VAMOS    | 1.612.929,40          | brAA+ | -       | AAA(bra)   |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 26/07/22               | 10/01/22    | 10/01/28       | AMBIPAR  | 2.475.152,74          | -     | -       | AA-(bra)   |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 27/07/22               | 25/03/22    | 15/03/44       | GBS PART | 1.503.813,77          | -     | -       | AA(bra)    |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 28/07/22               | 28/07/22    | 18/07/25       | 1V11     | 1.665.380,52          | -     | AAA.br  | -          |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 29/07/22               | 08/10/21    | 15/09/41       | AESTUCAN | 1.904.537,95          | -     | -       | AA-(bra)   |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 08/08/22               | 06/01/21    | 15/11/25       | QUATA    | 1.266,30              | -     | -       | A(bra)     |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 09/08/22               | 17/07/19    | 15/07/29       | GUARIROB | 457.022,55            | -     | -       | AA(bra)    |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 09/08/22               | 07/04/21    | 15/03/29       | CAGECE   | 1.608.479,53          | -     | -       | AA-(bra)   |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 09/08/22               | 07/04/21    | 15/03/29       | CAGECE   | 2.680.005,49          | -     | -       | AA-(bra)   |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 30/08/22               | 30/08/22    | 15/08/29       | TRBR     | 5.715.635,29          | brA+  | -       | -          |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 02/09/22               | 02/09/22    | 02/09/29       | AEGEA SA | 1.814.260,75          | brAA+ | -       | -          |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 27/09/22               | 06/01/21    | 15/11/25       | QUATA    | 54.451,07             | -     | -       | A(bra)     |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 28/09/22               | 28/09/22    | 28/09/27       | B.BRASIL | 4.560.621,43          | -     | AAA.br  | AA(bra)    |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 14/10/22               | 06/01/21    | 15/11/25       | QUATA    | 37.989,12             | -     | -       | A(bra)     |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 03/11/22               | 06/04/21    | 15/03/29       | ANET     | 1.927.223,01          | brA+  | -       | -          |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 08/11/22               | 08/11/22    | 15/06/42       | BRK AMBI | 5.584.195,52          | -     | AA-.br  | -          |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 09/11/22               | 02/05/22    | 15/04/38       | RDVE     | 1.835.756,92          | -     | -       | AA(bra)    |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 09/11/22               | 04/08/21    | 15/07/39       | UTE GNA  | 1.665.653,40          | brA   | -       | -          |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 11/11/22               | 11/11/22    | 15/10/40       | RAHOLD   | 2.969.562,04          | -     | -       | AA(bra)    |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 11/11/22               | 11/11/22    | 15/10/40       | RAHOLD   | 7.726.649,93          | -     | -       | AA(bra)    |

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – FEVEREIRO 2024



## RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO - EMBRAER PREV

29/02/2024

| INFORMAÇÕES DOS ATIVOS                  |               |             |                |          |               | INFORMAÇÕES DE RATING |         |          |
|---|---------------|-------------|----------------|----------|---------------|-----------------------|---------|----------|
| Fundo                                   | DataAquisição | DataEmissão | DataVencimento | Emissor  | Financeiro    | S&P                   | Moody's | Fitch    |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 28/11/22      | 17/07/19    | 15/07/29       | GUARIROB | 3.980.906,96  | -                     | -       | AA(bra)  |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 28/11/22      | 17/07/19    | 15/07/29       | GUARIROB | 1.792.009,48  | -                     | -       | AA(bra)  |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 28/11/22      | 17/07/19    | 15/07/29       | GUARIROB | 1.467.282,93  | -                     | -       | AA(bra)  |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 28/11/22      | 02/10/20    | 15/09/34       | BRKA     | 1.532.297,34  | -                     | Aa3.br  | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 28/11/22      | 02/10/20    | 15/09/34       | BRKA     | 1.865.249,80  | -                     | Aa3.br  | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 28/11/22      | 02/10/20    | 15/09/34       | BRKA     | 1.527.523,83  | -                     | Aa3.br  | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 01/12/22      | 27/07/21    | 15/06/39       | ANEMUS   | 1.751.237,84  | -                     | -       | AA(bra)  |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 05/12/22      | 20/09/21    | 15/09/31       | MOV_PART | 2.219.184,25  | brAA+                 | -       | AAA(bra) |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 05/12/22      | 20/09/21    | 15/09/31       | MOV_PART | 2.354.204,82  | brAA+                 | -       | AAA(bra) |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 05/12/22      | 20/09/21    | 15/09/31       | MOV_PART | 1.717.184,69  | brAA+                 | -       | AAA(bra) |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 13/12/22      | 10/02/22    | 15/12/35       | IP SUL C | 3.076.904,53  | -                     | -       | AA+(bra) |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 26/12/22      | 15/12/21    | 15/11/36       | ITAPOA T | 1.309.137,47  | -                     | AA.br   | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 26/12/22      | 02/05/22    | 15/04/38       | RDVE     | 2.124.429,39  | -                     | -       | AA(bra)  |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 26/12/22      | 27/07/21    | 15/06/39       | ANEMUS   | 3.290.692,32  | -                     | -       | AA(bra)  |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 26/01/23      | 26/01/23    | 20/01/26       | CELG     | 3.144.165,24  | -                     | -       | AA+(bra) |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 10/03/23      | 24/11/20    | 04/11/25       | HAPVIDA  | 318.341,97    | -                     | -       | AA(bra)  |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 16/03/23      | 08/10/21    | 15/09/41       | AESTUCAN | 1.270.987,57  | -                     | -       | AA-(bra) |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 16/03/23      | 15/12/21    | 15/11/36       | ITAPOA T | 3.974.761,47  | -                     | AA.br   | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 16/03/23      | 27/07/22    | 15/04/36       | BRV_VDR  | 8.985.495,95  | -                     | A.br    | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 20/03/23      | 31/07/20    | 15/07/30       | PARANAGU | 948.217,80    | brAA                  | -       | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 14/04/23      | 31/07/20    | 15/07/30       | PARANAGU | 671.761,93    | brAA                  | -       | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 17/04/23      | 17/04/23    | 17/03/30       | VERO     | 3.078.482,80  | brA+                  | -       | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 20/04/23      | 12/05/22    | 15/04/27       | BRKA     | 1.143.677,77  | -                     | A+.br   | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 20/04/23      | 12/05/22    | 15/04/27       | BRKA     | 31.570,80     | -                     | A+.br   | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 26/04/23      | 28/10/21    | 15/10/36       | HOLDARAG | 2.380.510,54  | brAAA                 | -       | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 06/04/23      | 23/09/20    | 15/10/36       | PAMPASUL | 1.974.875,36  | -                     | -       | AAA(bra) |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 06/04/23      | 23/09/21    | 15/09/31       | LOCAMERI | 2.315.741,34  | brAAA                 | -       | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 06/04/23      | 18/06/21    | 15/12/30       | MG050    | 3.258.429,13  | brAA+                 | -       | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 06/04/23      | 08/11/22    | 15/06/42       | BRK AMBI | 1.401.803,91  | -                     | AA-.br  | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 06/04/23      | 08/07/21    | 15/06/31       | VAMOS    | 1.058.459,95  | brAA+                 | -       | AAA(bra) |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 05/05/23      | 28/10/21    | 15/10/36       | HOLDARAG | 826.515,22    | brAAA                 | -       | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 05/05/23      | 22/10/21    | 15/12/35       | CART     | 1.555.280,57  | brAA+                 | -       | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 05/05/23      | 28/10/21    | 15/10/36       | HOLDARAG | 2.541.901,09  | brAAA                 | -       | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 05/05/23      | 02/10/20    | 15/09/34       | BRKA     | 317.438,55    | -                     | Aa3.br  | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 05/05/23      | 02/10/20    | 15/09/34       | BRKA     | 3.029.986,71  | -                     | Aa3.br  | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 05/05/23      | 18/03/21    | 15/02/31       | CORSAN   | 1.626.974,67  | -                     | -       | AA(bra)  |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 05/05/23      | 22/10/21    | 15/12/35       | CART     | 671.598,43    | brAA+                 | -       | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 05/05/23      | 10/02/21    | 15/12/31       | METRORIO | 5.206.748,73  | brAA                  | -       | AA-(bra) |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 08/05/23      | 28/10/21    | 15/10/36       | HOLDARAG | 234.749,88    | brAAA                 | -       | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 09/05/23      | 08/11/22    | 15/06/42       | BRK AMBI | 2.452.248,15  | -                     | AA-.br  | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 09/05/23      | 22/10/21    | 15/12/35       | CART     | 2.215.096,57  | brAA+                 | -       | -        |
| FIM EMB IA                              | 16/05/23      | 10/12/19    | 15/07/27       | RT BANDE | 1.109.449,57  | -                     | -       | AAA(bra) |
| FIM EMB IA                              | 16/05/23      | 23/12/20    | 15/12/27       | SABESP   | 2.318.527,85  | brAAA                 | -       | -        |
| FIM EMB IA                              | 16/05/23      | 21/07/21    | 15/07/31       | CACHOEIR | 1.799.494,01  | brAAA                 | -       | -        |
| FIM EMB IA                              | 16/05/23      | 29/10/21    | 15/10/26       | COELBA   | 1.893.728,82  | brAAA                 | -       | -        |
| FIM EMB IA                              | 16/05/23      | 04/05/22    | 15/04/27       | LOCALIZA | 2.946.750,44  | -                     | -       | AAA(bra) |
| FIM EMB IA                              | 16/05/23      | 23/12/21    | 21/12/28       | SMARTIFI | 3.166.379,23  | -                     | -       | AA(bra)  |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 26/05/23      | 04/08/21    | 15/07/39       | UTE GNA  | 62.679,64     | brA                   | -       | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 02/06/23      | 25/06/21    | 20/06/26       | OURO VER | 290.872,69    | -                     | -       | AA-(bra) |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 19/06/23      | 25/03/22    | 15/03/44       | GBS PART | 3.077.876,95  | -                     | -       | AAA(bra) |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 19/06/23      | 26/07/21    | 15/06/33       | ASA BRAN | 2.776.637,51  | -                     | -       | AA(bra)  |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 23/06/23      | 23/06/23    | 15/05/43       | IGUA RJ  | 1.383.360,45  | brAA+                 | -       | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 28/06/23      | 08/07/21    | 15/06/31       | VAMOS    | 1.061.680,42  | brAA+                 | -       | AAA(bra) |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 28/06/23      | 28/07/22    | 18/07/25       | 1V11     | 377.893,68    | -                     | AAA.br  | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 10/07/23      | 04/08/21    | 15/07/39       | UTE GNA  | 1.573.955,40  | brA                   | -       | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 10/07/23      | 10/12/19    | 15/07/34       | RT BANDE | 1.034.626,44  | -                     | -       | AAA(bra) |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 10/07/23      | 10/12/19    | 15/07/34       | RT BANDE | 1.034.626,44  | -                     | -       | AAA(bra) |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 10/07/23      | 04/08/21    | 15/07/39       | UTE GNA  | 1.573.955,40  | brA                   | -       | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 13/07/23      | 28/07/22    | 18/07/25       | 1V11     | 1.145.904,02  | -                     | AAA.br  | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 13/07/23      | 28/07/22    | 18/07/25       | 1V11     | 280.109,87    | -                     | AAA.br  | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 21/07/23      | 23/12/20    | 15/12/26       | RD COLIN | 1.584.283,98  | brAA+                 | -       | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 31/07/23      | 04/07/18    | 15/06/25       | ECORODOV | 1.509.982,85  | brAAA                 | A2.br   | AA(bra)  |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 31/07/23      | 04/07/18    | 15/06/25       | ECORODOV | 1.509.982,85  | brAAA                 | A2.br   | AA(bra)  |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 31/07/23      | 15/12/21    | 15/11/36       | ITAPOA T | 2.572.205,59  | -                     | AA.br   | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 31/07/23      | 26/07/21    | 15/06/33       | ASA BRAN | 2.733.030,37  | -                     | -       | AA(bra)  |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 01/08/23      | 31/07/23    | 25/07/28       | TIMSA    | 2.573.224,16  | -                     | -       | AA(bra)  |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 09/08/23      | 17/04/23    | 17/03/30       | VERO     | 1.359.010,22  | brA+                  | -       | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 09/08/23      | 06/12/21    | 15/12/35       | TESC     | 2.079.232,93  | -                     | -       | A+(bra)  |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 09/08/23      | 02/05/22    | 15/04/38       | RDVE     | 3.159.151,47  | -                     | -       | AA(bra)  |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 10/08/23      | 10/12/19    | 15/07/27       | RT BANDE | 1.190.787,53  | -                     | -       | AAA(bra) |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 10/08/23      | 05/06/18    | 05/06/28       | BRADERCO | 4.203.298,77  | brAAA                 | AAA.br  | AAA(bra) |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 21/08/23      | 08/08/23    | 15/01/34       | SPERIO4  | 2.468.032,50  | brAA+                 | -       | -        |
| FIRF EMB II A CRED PRIV                 | 29/08/23      | 29/08/23    | 29/08/25       | BRADERCO | 10.660.893,75 | brAAA                 | AAA.br  | AAA(bra) |
| FIRF EMB II A CRED PRIV                 | 30/08/23      | 30/08/23    | 01/09/25       | VOLKSWAG | 6.399.780,93  | brAAA                 | AAA.br  | -        |
| FIRF EMB II A CRED PRIV                 | 08/09/23      | 08/09/23    | 08/09/25       | B VOTORA | 6.385.609,53  | brAAA                 | AA.br   | AA(bra)  |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 14/09/23      | 06/01/21    | 15/11/25       | QUATA    | 2.532,61      | -                     | -       | A(bra)   |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 19/09/23      | 21/08/25    | 21/08/25       | ABC      | 5.296.479,86  | brAAA                 | AA+.br  | AAA(bra) |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 19/09/23      | 13/09/23    | 15/09/25       | PANAMERI | 5.253.362,93  | brAAA                 | AAA.br  | AAA(bra) |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 21/09/23      | 21/09/23    | 15/09/28       | ELETROB  | 2.704.169,66  | brAAA                 | -       | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 28/09/23      | 28/09/23    | 15/09/30       | CSMG     | 2.609.150,42  | -                     | AAA.br  | -        |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 29/09/23      | 23/12/21    | 21/12/28       | SMARTIFI | 2.455.495,02  | -                     | -       | AA(bra)  |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 29/09/23      | 19/05/21    | 10/05/30       | RODO BR  | 2.616.743,94  | -                     | -       | AA(bra)  |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 29/09/23      | 06/09/21    | 20/08/31       | S LUIZA  | 1.438.984,53  | -                     | -       | AAA(bra) |



# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – FEVEREIRO 2024



## RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO - EMBRAER PREV

29/02/2024

| INFORMAÇÕES DOS ATIVOS                  |               |             |                |                      |               | INFORMAÇÕES DE RATING |         |            |
|---|---------------|-------------|----------------|----------------------|---------------|-----------------------|---------|------------|
| Fundo                                   | DataAquisição | DataEmissão | DataVencimento | Emissor              | Financeiro    | S&P                   | Moody's | Fitch      |
| FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO   | 29/09/23      | 13/09/23    | 15/09/25       | B VOTORA             | 5.259.856,15  | brAAA                 | AA.br   | AAA(bra)   |
| FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO   | 02/10/23      | 14/11/22    | 10/10/31       | CORREDOR             | 2.399.556,82  | -                     | -       | AAA(bra)   |
| FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO   | 20/10/23      | 20/10/23    | 20/10/28       | SANTANDE             | 4.138.318,99  | -                     | AAA.br  | A-(bra)    |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 07/11/23      | 23/09/21    | 15/09/31       | LOCAMERI             | 3.097.248,69  | brAAA                 | -       | -          |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 07/11/23      | 04/07/18    | 15/06/25       | ECORODOV             | 3.028.520,85  | brAAA                 | A2.br   | AA(bra)    |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 07/11/23      | 18/03/21    | 15/02/31       | CORSAN               | 3.037.173,13  | -                     | -       | AA(bra)    |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 07/11/23      | 10/12/19    | 15/07/34       | RT BANDE             | 3.102.004,85  | -                     | -       | AAA(bra)   |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 16/11/23      | 18/06/21    | 15/12/30       | MG050                | 977.636,17    | brAA+                 | -       | -          |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 17/11/23      | 23/08/22    | 15/08/32       | PETRJ                | 4.608.257,31  | brAA                  | -       | -          |
| FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO   | 23/11/23      | 29/09/22    | 15/09/28       | VERT5                | 2.505.339,98  | -                     | -       | AAA(bra)   |
| FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO   | 23/11/23      | 10/12/21    | 17/11/28       | DESKTOP              | 2.627.109,78  | -                     | A.br    | -          |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 04/12/23      | 12/02/21    | 15/12/35       | MS 306               | 1.029.865,53  | -                     | A.br    | -          |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 04/12/23      | 30/08/22    | 15/08/29       | TRBR                 | 1.974.934,41  | brA+                  | -       | -          |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 04/12/23      | 02/10/20    | 15/09/34       | BRKA                 | 1.080.007,08  | -                     | Aa3.br  | -          |
| FIRF EMB II A CRED PRIV                 | 26/12/23      | 27/12/22    | 02/06/26       | BRADESCO             | 10.254.256,54 | brAAA                 | AAA.br  | AAA(bra)   |
| FIRF EMB II A CRED PRIV                 | 08/01/24      | 08/01/24    | 08/01/26       | DAYCOVAL             | 10.166.262,22 | brAA+                 | AA.br   | AA(bra)    |
| FIRF EMB II A CRED PRIV                 | 08/01/24      | 08/01/24    | 08/01/26       | B.ALFA               | 10.164.675,61 | -                     | AAA.br  | AA+(bra)   |
| FIRF EMB II A CRED PRIV                 | 08/01/24      | 08/01/24    | 08/01/26       | ABC                  | 10.168.577,89 | brAAA                 | AA+.br  | AAA(bra)   |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 09/01/24      | 17/04/23    | 17/03/30       | VERO                 | 2.985.568,59  | brA+                  | -       | -          |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 09/01/24      | 27/02/20    | 15/12/34       | VIARONDO             | 2.119.497,61  | -                     | -       | AA-(bra)   |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 09/01/24      | 27/02/20    | 15/12/34       | VIARONDO             | 2.119.497,61  | -                     | -       | AA-(bra)   |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 09/01/24      | 25/03/22    | 15/03/44       | GBS PART             | 2.176.541,23  | -                     | -       | AAA(bra)   |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 09/01/24      | 25/03/22    | 15/03/44       | GBS PART             | 2.149.155,86  | -                     | -       | AAA(bra)   |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 09/01/24      | 04/08/21    | 15/07/39       | UTE GNA              | 1.013.320,85  | brA                   | -       | -          |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 09/01/24      | 04/08/21    | 15/07/39       | UTE GNA              | 2.027.802,43  | brA                   | -       | -          |
| FIRF EMB II A CRED PRIV                 | 11/01/24      | 27/12/22    | 02/06/26       | BRADESCO             | 10.780.233,01 | brAAA                 | AAA.br  | AAA(bra)   |
| FIRF EMB II A CRED PRIV                 | 18/01/24      | 18/01/24    | 04/01/27       | TOYOTA               | 6.455.404,02  | brAAA                 | -       | -          |
| FIRF EMB II A CRED PRIV                 | 24/01/24      | 24/01/24    | 26/01/26       | ABC                  | 10.112.338,40 | brAAA                 | AA+.br  | AAA(bra)   |
| FIRF EMB II A CRED PRIV                 | 24/01/24      | 24/01/24    | 25/01/27       | BTG PACT             | 4.298.291,58  | brAAA                 | AAA.br  | AAA(bra)   |
| FIRF EMB II A CRED PRIV                 | 25/01/24      | 25/01/24    | 26/01/26       | BTG PACT             | 6.468.530,24  | brAAA                 | AAA.br  | AAA(bra)   |
| FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO   | 26/01/24      | 15/03/21    | 15/03/29       | OMEGA GE             | 1.163.286,77  | -                     | -       | AA-(bra)   |
| FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO   | 26/01/24      | 10/12/19    | 15/07/27       | RT BANDE             | 1.235.252,27  | -                     | -       | AAA(bra)   |
| FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO   | 26/01/24      | 22/04/21    | 15/03/26       | VIX LOGI             | 2.057.911,30  | -                     | -       | A+(bra)    |
| FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO   | 30/01/24      | 28/04/21    | 15/04/31       | MANAUSEN             | 2.595.865,41  | brAAA                 | -       | -          |
| FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO   | 30/01/24      | 01/06/23    | 25/05/26       | LM TRANS             | 2.605.556,60  | -                     | AA+.br  | -          |
| FI RENDA FIXA EMB VIA CREDITO PRIVADO   | 30/01/24      | 27/10/21    | 15/10/29       | CONT GLO             | 2.602.398,31  | -                     | -       | AA(bra)    |
| FIRF EMB II A CRED PRIV                 | 31/01/24      | 31/01/24    | 02/02/26       | B.ALFA               | 10.690.233,18 | -                     | AAA.br  | AA+(bra)   |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 09/02/24      | 08/02/24    | 15/09/31       | PLANALTO             | 3.014.498,11  | brAAA                 | -       | -          |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 15/02/24      | 15/02/24    | 15/12/43       | AGUAS SE             | 2.162.643,70  | -                     | AA-.br  | -          |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 20/02/24      | 14/05/21    | 07/05/26       | INTERVIA             | 2.593.701,61  | -                     | AA.br   | -          |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 20/02/24      | 12/11/21    | 30/04/29       | HAPVIDA              | 551.708,30    | -                     | -       | AAA(bra)   |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 21/02/24      | 18/03/21    | 15/02/26       | CORSAN               | 1.268.366,15  | -                     | -       | AA(bra)    |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 21/02/24      | 19/05/22    | 13/05/28       | CEA MODA             | 2.091.612,89  | -                     | -       | AA-(bra)   |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 21/02/24      | 07/11/19    | 15/10/24       | BKBR                 | 1.545.168,33  | -                     | -       | AA(bra)    |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 21/02/24      | 19/04/22    | 16/04/29       | VERT-10              | 2.073.207,06  | -                     | -       | AAAsf(bra) |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 26/02/24      | 07/04/21    | 15/03/26       | CAGECE               | 2.587.822,24  | -                     | -       | AA-(bra)   |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 26/02/24      | 24/03/22    | 11/03/27       | ARTERIS              | 2.593.286,56  | brAA+                 | -       | -          |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | 26/02/24      | 16/02/24    | 15/02/34       | NTRASSUD             | 2.595.724,13  | -                     | -       | AAA(bra)   |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 26/02/24      | 04/08/21    | 15/07/39       | UTE GNA              | 299.469,39    | brA                   | -       | -          |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 26/02/24      | 18/06/21    | 15/12/30       | MG050                | 306.182,76    | brAA+                 | -       | -          |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 26/02/24      | 02/05/22    | 15/04/38       | RDVE                 | 798.535,52    | -                     | -       | AA(bra)    |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 26/02/24      | 17/07/19    | 15/07/29       | GUARIROB             | 805.802,92    | -                     | -       | AA(bra)    |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 26/02/24      | 04/08/21    | 15/07/39       | UTE GNA              | 299.469,39    | brA                   | -       | -          |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 26/02/24      | 12/02/21    | 15/12/35       | MS 306               | 302.578,02    | -                     | A.br    | -          |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 26/02/24      | 22/07/21    | 15/12/36       | VIA BRAS             | 1.005.678,33  | -                     | -       | AA(bra)    |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 26/02/24      | 22/07/21    | 15/12/36       | VIA BRAS             | 502.839,16    | -                     | -       | AA(bra)    |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 26/02/24      | 10/02/21    | 15/12/31       | METRORIO             | 501.410,17    | brAA                  | -       | AA-(bra)   |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV       | 26/02/24      | 15/12/21    | 15/11/36       | ITAPOA T             | 400.547,44    | -                     | AA.br   | -          |
| FIRF EMB II A CRED PRIV                 | 26/02/24      | 26/02/24    | 01/03/27       | BTG PACT             | 10.548.975,24 | brAAA                 | AAA.br  | AAA(bra)   |
| FIM EMB VII A CRED PRIV                 | -             | -           | -              | FIDC VERDECARD SN3   | 176.222,22    | brAAA(sf)             | -       | -          |
| FIM EMB VII A CRED PRIV                 | -             | -           | -              | FIDC CREDZ SN6       | 2.389.278,74  | brAA (sf)             | -       | A+sf(bra)  |
| FIM EMB VII A CRED PRIV                 | -             | -           | -              | FIDC VERDECARD SN5   | 87.500,00     | brAAA(sf)             | -       | -          |
| FIM EMB VII A CRED PRIV                 | -             | -           | -              | VERDECARD FIDC SN6   | 1.050.000,00  | 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 | 630.128,37    | brAA-(sf)             | -       | -          |
| FIM EMB VII A CRED PRIV                 | -             | -           | -              | BR ELETRO FIDC S1    | 1.972.082,04  | -                     | -       | Aasf(bra)  |
| FIM EMB VII A CRED PRIV                 | -             | -           | -              | INSS CONS PDL I FIDC | 1.543.077,29  | -                     | -       | AAAsf(bra) |
| FI RENDA FIXA EMB VII A CREDITO PRIVADO | -             | -           | -              | DRIVER SIX FIDC SN   | 1.188.287,19  | -                     | AAA.br  | -          |

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

## 4. RISCO OPERACIONAL

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

## 5. RISCO DE LIQUIDEZ

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

## 6. RISCO LEGAL

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

### 6.1. Relatório de Enquadramentos Legais



## Relatório Resumo de Enquadramento

**Patrimônio Líquido da Fundação** **4.853.784.420,47**

| Tópico do Enquadramento   | Limite  | Aplicação Atual                                    | Valor Limite     | % Aplicado | Status     |
|---|---------|--|------------------|------------|------------|
| % do Segmento RF/PL PLANO                                       | 100,00% | 4.241.818.080,18                                   | 4.853.784.420,47 | 87,39%     | Enquadrado |
| % do PL em Títulos de Emissão do Tesouro Nacional e/ou do BACEN | 100,00% | 3.374.345.470,10                                   | 4.853.784.420,47 | 69,52%     | Enquadrado |
| % do PL em Títulos RF1, exceto títulos do Tesouro Nacional      | 80,00%  | 867.472.610,08                                     | 3.883.027.594,24 | 17,87%     | Enquadrado |
| % do PL em FIDC   | 20,00%  | Verificar Rel. de Diversificação de FIDC's         | 970.756.898,56   | 0,00%      | Enquadrado |
| % do PL em uma mesma pessoa jurídica não-financeira             | 10,00%  | Verificar Rel. de Diversificação Inst. Não Financ. | 485.378.449,28   | 0,00%      | Enquadrado |
| % do PL em Instituições Financeiras                             | 25,00%  | Verificar Rel. de Diversificação Inst. Financ.     | 1.213.446.105,12 | 0,00%      | Enquadrado |
| % de uma mesma Série de Debêntures                              | 25,00%  | Verificar Rel. de Diversificação Debêntures        | 1.213.446.105,12 | 0,00%      | Enquadrado |
| % do PL em RV   | 70,00%  | 505.676.514,94                                     | 3.397.649.036,47 | 10,42%     | Enquadrado |
| % do capital votante de uma empresa                             | 25,00%  | Verificar Rel. de Diversificação RV                | 1.213.446.105,12 | 0,00%      | Enquadrado |
| % do PL da Fundação em Investimentos Imobiliários               | 20,00%  | 79.378.364,68                                      | 970.756.898,56   | 1,64%      | Enquadrado |
| % do PL da Fundação em Empréstimos                              | 15,00%  | 24.927.695,89                                      | 728.067.692,00   | 0,51%      | Enquadrado |
| % do PL da Fundação em Investimentos Estruturados               | 20,00%  | 0,00   | 970.756.898,56   | 0,00%      | Enquadrado |
| % do PL da Fundação em Investimentos no Exterior                | 10,00%  | 0,00   | 485.378.449,28   | 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))

## 6.2. Relatório de Túnel de Preços

### RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE FEVEREIRO DE 2024 À 29 DE FEVEREIRO DE 2024



| FIM EMB I A |             | FONTE ANBIMA |           |        |            |        |           |          |          |          |          |               |
|-------------|-------------|--------------|-----------|--------|------------|--------|-----------|----------|----------|----------|----------|---------------|
| DT          | FUNDO       | GESTOR       | CORRETORA | TÍTULO | VENC.      | C/V    | TX. OPER. | TX. IND. | TX. MÍN. | TX. MÁX. | DIF. TX. | FORA DO TÚNEL |
| 01/02/2024  | FIM EMB I A | BTG ASSE     | PACTUAL   | NTN-B  | 15/08/2050 | Compra | 5,6895%   | 5,6779%  | 5,5271%  | 5,8599%  | 0,0116%  | NÃO           |
| 02/02/2024  | FIM EMB I A | BTG ASSE     | PACTUAL   | LFT    | 01/03/2026 | Compra | 0,0391%   | 0,0404%  | 0,0316%  | 0,0677%  | -0,0013% | NÃO           |
| 07/02/2024  | FIM EMB I A | BTG ASSE     | PACTUAL   | LFT    | 01/09/2026 | Compra | 0,0621%   | 0,0630%  | 0,0545%  | 0,0944%  | -0,0009% | NÃO           |
| 14/02/2024  | FIM EMB I A | BTG ASSE     | PACTUAL   | LFT    | 01/03/2026 | Compra | 0,0412%   | 0,0422%  | 0,0338%  | 0,0535%  | -0,0010% | NÃO           |
| 14/02/2024  | FIM EMB I A | BTG ASSE     | PACTUAL   | LFT    | 01/03/2026 | Compra | 0,0412%   | 0,0422%  | 0,0338%  | 0,0535%  | -0,0010% | NÃO           |
| 14/02/2024  | FIM EMB I A | BTG ASSE     | PACTUAL   | LFT    | 01/03/2026 | Compra | 0,0412%   | 0,0422%  | 0,0338%  | 0,0535%  | -0,0010% | NÃO           |
| 14/02/2024  | FIM EMB I A | BTG ASSE     | PACTUAL   | LFT    | 01/03/2026 | Compra | 0,0417%   | 0,0422%  | 0,0338%  | 0,0535%  | -0,0005% | NÃO           |
| 14/02/2024  | FIM EMB I A | BTG ASSE     | PACTUAL   | LFT    | 01/03/2026 | Compra | 0,0417%   | 0,0422%  | 0,0338%  | 0,0535%  | -0,0005% | NÃO           |
| 14/02/2024  | FIM EMB I A | BTG ASSE     | PACTUAL   | LFT    | 01/03/2027 | Compra | 0,1076%   | 0,1069%  | 0,0718%  | 0,1196%  | 0,0007%  | NÃO           |
| 21/02/2024  | FIM EMB I A | BTG ASSE     | PACTUAL   | NTN-B  | 15/08/2050 | Compra | 5,6895%   | 5,6887%  | 5,5489%  | 5,8524%  | 0,0008%  | NÃO           |
| 21/02/2024  | FIM EMB I A | BTG ASSE     | PACTUAL   | NTN-B  | 15/08/2050 | Compra | 5,6895%   | 5,6887%  | 5,5489%  | 5,8524%  | 0,0008%  | NÃO           |
| 23/02/2024  | FIM EMB I A | BTG ASSE     | PACTUAL   | NTN-B  | 15/08/2050 | Venda  | 5,7105%   | 5,7300%  | 5,5603%  | 5,8639%  | -0,0195% | NÃO           |
| 27/02/2024  | FIM EMB I A | BTG ASSE     | PACTUAL   | NTN-B  | 15/08/2050 | Compra | 5,7295%   | 5,7566%  | 5,6136%  | 5,9175%  | -0,0271% | NÃO           |

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – FEVEREIRO 2024

**RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO**

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE FEVEREIRO DE 2024 À 29 DE FEVEREIRO DE 2024



**FIRF EMB II A CRED PRIV**

| DT         | FUNDO                   | GESTOR | CORRETORA | TÍTULO | VENC.      | C/V    | TX. OPER. | FONTE ANBIMA |          |          |          | FORA DO TÚNEL |
|------------|-------------------------|--------|-----------|--------|------------|--------|-----------|--------------|----------|----------|----------|---------------|
|            |                         |        |           |        |            |        |           | TX. IND.     | TX. MÍN. | TX. MÁX. | DIF. TX. |               |
| 01/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | LIQUIDEZ  | NTN-B  | 15/05/2025 | Venda  | 5,5810%   | 5,6547%      | 5,2625%  | 5,8602%  | -0,0737% | NÃO           |
| 01/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | RENASCEN  | NTN-B  | 15/05/2025 | Venda  | 5,5610%   | 5,6547%      | 5,2625%  | 5,8602%  | -0,0937% | NÃO           |
| 01/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | RENASCEN  | NTN-B  | 15/05/2025 | Venda  | 5,5610%   | 5,6547%      | 5,2625%  | 5,8602%  | -0,0937% | NÃO           |
| 01/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | RENASCEN  | NTN-B  | 15/05/2025 | Venda  | 5,5610%   | 5,6547%      | 5,2625%  | 5,8602%  | -0,0937% | NÃO           |
| 01/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | LIQUIDEZ  | NTN-B  | 15/05/2025 | Venda  | 5,5810%   | 5,6547%      | 5,2625%  | 5,8602%  | -0,0737% | NÃO           |
| 01/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | LIQUIDEZ  | NTN-B  | 15/05/2025 | Venda  | 5,5810%   | 5,6547%      | 5,2625%  | 5,8602%  | -0,0737% | NÃO           |
| 01/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | LIQUIDEZ  | NTN-B  | 15/05/2025 | Venda  | 5,5810%   | 5,6547%      | 5,2625%  | 5,8602%  | -0,0737% | NÃO           |
| 01/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | LIQUIDEZ  | NTN-B  | 15/05/2025 | Venda  | 5,5810%   | 5,6547%      | 5,2625%  | 5,8602%  | -0,0737% | NÃO           |
| 01/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | LIQUIDEZ  | NTN-B  | 15/05/2025 | Venda  | 5,5810%   | 5,6547%      | 5,2625%  | 5,8602%  | -0,0737% | NÃO           |
| 01/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | LIQUIDEZ  | NTN-B  | 15/05/2025 | Venda  | 5,5810%   | 5,6547%      | 5,2625%  | 5,8602%  | -0,0737% | NÃO           |
| 01/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | LIQUIDEZ  | NTN-B  | 15/05/2025 | Venda  | 5,5810%   | 5,6547%      | 5,2625%  | 5,8602%  | -0,0737% | NÃO           |
| 01/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | LIQUIDEZ  | NTN-B  | 15/05/2025 | Venda  | 5,5810%   | 5,6547%      | 5,2625%  | 5,8602%  | -0,0737% | NÃO           |
| 07/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | RENASCEN  | NTN-B  | 15/08/2026 | Compra | 6,6368%   | 6,7333%      | 6,2121%  | 7,1530%  | -0,0965% | NÃO           |
| 07/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | RENASCEN  | NTN-B  | 15/08/2026 | Compra | 5,4716%   | 5,4919%      | 5,2297%  | 5,7285%  | -0,0203% | NÃO           |
| 07/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | RENASCEN  | NTN-B  | 15/08/2026 | Compra | 5,6766%   | 5,6727%      | 5,5031%  | 5,8360%  | 0,0039%  | NÃO           |
| 08/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | XP CCTVM  | NTN-B  | 15/08/2026 | Venda  | 5,4910%   | 5,5162%      | 5,2653%  | 5,7250%  | -0,0252% | NÃO           |
| 08/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | XP CCTVM  | NTN-B  | 15/08/2026 | Venda  | 5,4910%   | 5,5162%      | 5,2653%  | 5,7250%  | -0,0252% | NÃO           |
| 08/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | RENASCEN  | NTN-B  | 15/05/2027 | Compra | 5,4690%   | 5,4969%      | 5,2573%  | 5,6828%  | -0,0219% | NÃO           |
| 08/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | RENASCEN  | NTN-B  | 15/08/2028 | Compra | 5,4790%   | 5,4901%      | 5,2728%  | 5,7040%  | -0,0111% | NÃO           |
| 14/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | LIQUIDEZ  | NTN-B  | 15/08/2026 | Venda  | 5,4910%   | 5,5205%      | 5,2696%  | 5,7299%  | -0,0295% | NÃO           |
| 14/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | LIQUIDEZ  | NTN-B  | 15/08/2026 | Venda  | 5,4910%   | 5,5205%      | 5,2696%  | 5,7299%  | -0,0295% | NÃO           |
| 14/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | LIQUIDEZ  | NTN-B  | 15/08/2026 | Venda  | 5,4910%   | 5,5205%      | 5,2696%  | 5,7299%  | -0,0295% | NÃO           |
| 14/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | LIQUIDEZ  | NTN-B  | 15/08/2026 | Venda  | 5,4910%   | 5,5205%      | 5,2696%  | 5,7299%  | -0,0295% | NÃO           |
| 14/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | XP CCTVM  | NTN-B  | 15/08/2026 | Venda  | 5,5110%   | 5,5205%      | 5,2696%  | 5,7299%  | -0,0095% | NÃO           |
| 14/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | RENASCEN  | NTN-B  | 15/08/2026 | Venda  | 5,5010%   | 5,5205%      | 5,2696%  | 5,7299%  | -0,0195% | NÃO           |
| 14/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | RENASCEN  | NTN-B  | 15/08/2026 | Venda  | 5,5010%   | 5,5205%      | 5,2696%  | 5,7299%  | -0,0195% | NÃO           |
| 14/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | RENASCEN  | NTN-B  | 15/08/2026 | Venda  | 5,5010%   | 5,5205%      | 5,2696%  | 5,7299%  | -0,0195% | NÃO           |
| 14/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | RENASCEN  | NTN-B  | 15/08/2026 | Venda  | 5,5010%   | 5,5205%      | 5,2696%  | 5,7299%  | -0,0195% | NÃO           |
| 14/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | RENASCEN  | NTN-B  | 15/08/2026 | Venda  | 5,5010%   | 5,5205%      | 5,2696%  | 5,7299%  | -0,0195% | NÃO           |
| 14/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | RENASCEN  | NTN-B  | 15/08/2026 | Venda  | 5,5010%   | 5,5205%      | 5,2696%  | 5,7299%  | -0,0195% | NÃO           |
| 14/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | RENASCEN  | NTN-B  | 15/08/2026 | Venda  | 5,5010%   | 5,5205%      | 5,2696%  | 5,7299%  | -0,0195% | NÃO           |
| 14/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | RENASCEN  | NTN-B  | 15/05/2027 | Compra | 5,4690%   | 5,4800%      | 5,2497%  | 5,6754%  | -0,0110% | NÃO           |
| 14/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | RENASCEN  | NTN-B  | 15/05/2027 | Compra | 5,4790%   | 5,4800%      | 5,2497%  | 5,6754%  | -0,0010% | NÃO           |
| 14/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | XP CCTVM  | NTN-B  | 15/05/2027 | Compra | 5,4590%   | 5,4800%      | 5,2497%  | 5,6754%  | -0,0210% | NÃO           |
| 15/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | RENASCEN  | NTN-B  | 15/05/2025 | Compra | 5,6882%   | 5,7398%      | 5,4397%  | 6,0231%  | -0,0516% | NÃO           |
| 15/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | CONCORDI  | NTN-B  | 15/08/2026 | Venda  | 5,4824%   | 5,5037%      | 5,2934%  | 5,7539%  | -0,0213% | NÃO           |
| 15/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | RENASCEN  | NTN-B  | 15/08/2026 | Venda  | 5,4856%   | 5,5037%      | 5,2934%  | 5,7539%  | -0,0181% | NÃO           |
| 15/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | RENASCEN  | NTN-B  | 15/08/2026 | Venda  | 5,4856%   | 5,5037%      | 5,2934%  | 5,7539%  | -0,0181% | NÃO           |
| 15/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | CONCORDI  | NTN-B  | 15/08/2026 | Venda  | 5,4824%   | 5,5037%      | 5,2934%  | 5,7539%  | -0,0213% | NÃO           |
| 15/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | CONCORDI  | NTN-B  | 15/08/2026 | Venda  | 5,4824%   | 5,5037%      | 5,2934%  | 5,7539%  | -0,0213% | NÃO           |
| 15/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | RENASCEN  | NTN-B  | 15/08/2026 | Venda  | 5,4856%   | 5,5037%      | 5,2934%  | 5,7539%  | -0,0181% | NÃO           |
| 15/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | CONCORDI  | NTN-B  | 15/08/2026 | Venda  | 5,4824%   | 5,5037%      | 5,2934%  | 5,7539%  | -0,0213% | NÃO           |
| 15/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | CONCORDI  | NTN-B  | 15/08/2026 | Venda  | 5,4824%   | 5,5037%      | 5,2934%  | 5,7539%  | -0,0213% | NÃO           |
| 15/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | CONCORDI  | NTN-B  | 15/08/2026 | Venda  | 5,4824%   | 5,5037%      | 5,2934%  | 5,7539%  | -0,0213% | NÃO           |
| 15/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | CONCORDI  | NTN-B  | 15/08/2026 | Venda  | 5,4824%   | 5,5037%      | 5,2934%  | 5,7539%  | -0,0213% | NÃO           |
| 15/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | CONCORDI  | NTN-B  | 15/08/2026 | Venda  | 5,4824%   | 5,5037%      | 5,2934%  | 5,7539%  | -0,0213% | NÃO           |
| 15/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | RENASCEN  | NTN-B  | 15/08/2028 | Compra | 5,4441%   | 5,4600%      | 5,2645%  | 5,6956%  | -0,0159% | NÃO           |
| 15/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | PACTUAL   | NTN-B  | 15/08/2028 | Compra | 5,4441%   | 5,4600%      | 5,2645%  | 5,6956%  | -0,0159% | NÃO           |
| 16/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | LIQUIDEZ  | NTN-B  | 15/05/2027 | Compra | 5,4534%   | 5,4772%      | 5,2396%  | 5,6656%  | -0,0238% | NÃO           |
| 21/02/2024 | FIRF EMB II A CRED PRIV | BNP    | LIQUIDEZ  | LFT    | 01/03/2030 | Compra | 0,1808%   | 0,1808%      | 0,1476%  | 0,1938%  | 0,0000%  | NÃO           |

**RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO**

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE FEVEREIRO DE 2024 À 29 DE FEVEREIRO DE 2024



**FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI**

| DT         | FUNDO                                     | GESTOR | CORRETORA | TÍTULO | VENC.      | C/V    | TX. OPER. | FONTE ANBIMA |          |          |          | FORA DO TÚNEL |
|------------|---|--------|-----------|--------|------------|--------|-----------|--------------|----------|----------|----------|---------------|
|            |   |        |           |        |            |        |           | TX. IND.     | TX. MÍN. | TX. MÁX. | DIF. TX. |               |
| 20/02/2024 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | BNP    | RENASCEN  | LFT    | 01/09/2024 | Compra | -0,0146%  | -0,0148%     | -0,0322% | 0,0255%  | 0,0002%  | NÃO           |

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – FEVEREIRO 2024

## RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE FEVEREIRO DE 2024 À 29 DE FEVEREIRO DE 2024



### FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO

| DT         | FUNDO                                  | GESTOR   | CORRETORA | TÍTULO | VENC.      | C/V    | TX. OPER. | FONTE ANBIMA |          |          | DIF. TX. | FORA DO TÚNEL |
|------------|--|----------|-----------|--------|------------|--------|-----------|--------------|----------|----------|----------|---------------|
|            |  |          |           |        |            |        |           | TX. IND.     | TX. MÍN. | TX. MÁX. |          |               |
| 19/02/2024 | FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO | ICATU VA | GUIDE CT  | NTN-B  | 15/08/2024 | Compra | 6,5691%   | 6,6199%      | 6,0580%  | 7,0238%  | -0,0508% | NÃO           |
| 19/02/2024 | FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO | ICATU VA | GUIDE CT  | NTN-B  | 15/08/2026 | Compra | 5,5090%   | 5,5455%      | 5,3003%  | 5,7613%  | -0,0365% | NÃO           |
| 19/02/2024 | FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO | ICATU VA | GUIDE CT  | NTN-B  | 15/05/2027 | Compra | 5,4690%   | 5,4998%      | 5,2568%  | 5,6829%  | -0,0308% | NÃO           |
| 19/02/2024 | FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO | ICATU VA | GUIDE CT  | NTN-B  | 15/08/2028 | Compra | 5,4690%   | 5,4900%      | 5,2643%  | 5,6954%  | -0,0210% | NÃO           |









# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – FEVEREIRO 2024

## RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE FEVEREIRO DE 2024 À 29 DE FEVEREIRO 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 |
| 14-02-24 | FIA RVA EMB III           | Venda         | RECV3  | 21,70 | 800,00     | 17.357,00      | 21,60            | 21,73       | 22,06        | 5.953,00                |
| 14-02-24 | FIA RVA EMB III           | Compra        | RENT3  | 51,71 | 500,00     | 25.855,93      | 51,36            | 51,77       | 52,22        | 21.508,00               |
| 14-02-24 | FIA RVA EMB III           | Compra        | RENT3  | 51,50 | 1.800,00   | 92.700,00      | 51,36            | 51,77       | 52,22        | 21.508,00               |
| 14-02-24 | FIA RVA EMB III           | Venda         | SMFT3  | 24,32 | 500,00     | 12.161,00      | 24,18            | 24,39       | 25,06        | 4.273,00                |
| 14-02-24 | FIA RVA EMB III           | Venda         | SOMA3  | 7,08  | 2.100,00   | 14.862,00      | 7,04             | 7,10        | 7,20         | 9.568,00                |
| 14-02-24 | FIA RVA EMB III           | Venda         | SUZB3  | 52,21 | 900,00     | 46.988,00      | 52,08            | 52,30       | 52,94        | 9.909,00                |
| 14-02-24 | FIA RVA EMB III           | Venda         | YDUQ3  | 18,68 | 800,00     | 14.947,00      | 18,43            | 18,68       | 18,80        | 12.178,00               |
| 14-02-24 | FIA RVA EMB IV            | Venda         | HAPV3  | 3,43  | 3.020,00   | 10.345,04      | 3,40             | 3,46        | 3,55         | 95.910,00               |
| 14-02-24 | FIA RVA EMB IV            | Venda         | HAPV3  | 3,42  | 23.797,00  | 81.385,74      | 3,40             | 3,46        | 3,55         | 95.910,00               |
| 14-02-24 | FIA RVA EMB IV            | Venda         | HAPV3  | 3,46  | 29.747,00  | 102.924,62     | 3,40             | 3,46        | 3,55         | 95.910,00               |
| 14-02-24 | FIA RVA EMB IV            | Compra        | PRI03  | 42,26 | 2.002,00   | 84.604,52      | 41,90            | 42,35       | 42,66        | 16.383,00               |
| 14-02-24 | FIA RVA EMB IV            | Compra        | PRI03  | 42,26 | 1.000,00   | 42.262,84      | 41,90            | 42,35       | 42,66        | 16.383,00               |
| 14-02-24 | FIA RVA EMB IV            | Compra        | PRI03  | 42,33 | 540,00     | 22.857,68      | 41,90            | 42,35       | 42,66        | 16.383,00               |
| 14-02-24 | FIA RVA EMB IV            | Compra        | UGPA3  | 29,18 | 23,00      | 671,17         | 29,01            | 29,21       | 29,58        | 11.373,00               |
| 15-02-24 | FIA RVA EMB II            | Venda         | B3SA3  | 12,76 | 15.800,00  | 201.601,14     | 12,66            | 12,74       | 12,97        | 34.830,00               |
| 15-02-24 | FIA RVA EMB II            | Venda         | ENGI11 | 50,43 | 2.100,00   | 105.903,89     | 50,22            | 50,60       | 50,97        | 10.881,00               |
| 15-02-24 | FIA RVA EMB II            | Venda         | HAPV3  | 3,45  | 66.300,00  | 228.735,00     | 3,38             | 3,41        | 3,47         | 45.041,00               |
| 15-02-24 | FIA RVA EMB II            | Venda         | JBSS3  | 22,52 | 5.000,00   | 112.587,00     | 22,48            | 22,65       | 22,90        | 18.865,00               |
| 15-02-24 | FIA RVA EMB II            | Compra        | MRFQ3  | 9,11  | 18.800,00  | 171.268,00     | 8,84             | 9,12        | 9,29         | 11.603,00               |
| 15-02-24 | FIA RVA EMB II            | Compra        | PETRA  | 42,30 | 7.200,00   | 304.560,00     | 40,85            | 41,61       | 42,30        | 57.772,00               |
| 15-02-24 | FIA RVA EMB II            | Compra        | PRI03  | 44,57 | 3.000,00   | 133.710,00     | 41,88            | 43,76       | 44,72        | 32.785,00               |
| 15-02-24 | FIA RVA EMB II            | Compra        | RDOR3  | 26,59 | 13.300,00  | 353.655,36     | 26,11            | 26,55       | 26,99        | 10.897,00               |
| 15-02-24 | FIA RVA EMB II            | Venda         | RENT3  | 51,88 | 5.000,00   | 259.420,36     | 51,66            | 52,01       | 52,54        | 19.299,00               |
| 15-02-24 | FIA RVA EMB II            | Compra        | SBS53  | 81,39 | 3.300,00   | 268.603,26     | 79,36            | 81,00       | 83,70        | 28.912,00               |
| 15-02-24 | FIA RVA EMB II            | Venda         | VALE3  | 65,51 | 3.500,00   | 229.285,00     | 65,04            | 65,49       | 65,87        | 45.583,00               |
| 15-02-24 | FIA RVA EMB III           | Venda         | ALPA4  | 9,18  | 15.300,00  | 140.493,90     | 8,91             | 9,22        | 9,53         | 19.382,00               |
| 15-02-24 | FIA RVA EMB III           | Venda         | ALPA4  | 9,25  | 9.800,00   | 90.648,47      | 8,91             | 9,22        | 9,53         | 19.382,00               |
| 15-02-24 | FIA RVA EMB III           | Venda         | ALPA4  | 9,38  | 6.900,00   | 64.717,08      | 8,91             | 9,22        | 9,53         | 19.382,00               |
| 15-02-24 | FIA RVA EMB III           | Compra        | BBAS3  | 58,26 | 200,00     | 11.651,00      | 58,01            | 58,30       | 58,59        | 29.921,00               |
| 15-02-24 | FIA RVA EMB III           | Compra        | BBSE3  | 33,00 | 500,00     | 16.499,00      | 32,71            | 32,85       | 33,37        | 14.210,00               |
| 15-02-24 | FIA RVA EMB III           | Compra        | ELET3  | 43,03 | 1.000,00   | 43.033,00      | 42,71            | 43,11       | 43,47        | 16.870,00               |
| 15-02-24 | FIA RVA EMB III           | Compra        | ENEV3  | 12,01 | 10.500,00  | 126.150,89     | 11,91            | 12,12       | 12,35        | 21.746,00               |
| 15-02-24 | FIA RVA EMB III           | Compra        | ENEV3  | 12,01 | 3.600,00   | 43.218,00      | 11,91            | 12,12       | 12,35        | 21.746,00               |
| 15-02-24 | FIA RVA EMB III           | Compra        | EQLT3  | 34,39 | 1.200,00   | 41.269,00      | 33,68            | 34,30       | 34,60        | 18.551,00               |
| 15-02-24 | FIA RVA EMB III           | Compra        | FLRY3  | 15,82 | 100,00     | 1.582,00       | 15,74            | 15,85       | 15,98        | 8.370,00                |
| 15-02-24 | FIA RVA EMB III           | Compra        | FLRY3  | 15,82 | 6.700,00   | 106.022,15     | 15,74            | 15,85       | 15,98        | 8.370,00                |
| 15-02-24 | FIA RVA EMB III           | Compra        | IGT11  | 23,29 | 1.500,00   | 34.940,00      | 23,14            | 23,29       | 23,82        | 12.064,00               |
| 15-02-24 | FIA RVA EMB III           | Compra        | ITSA4  | 10,37 | 38.600,00  | 400.365,83     | 10,35            | 10,40       | 10,46        | 18.167,00               |
| 15-02-24 | FIA RVA EMB III           | Venda         | ITUB4  | 34,38 | 11.503,00  | 395.516,16     | 34,14            | 34,48       | 34,63        | 36.454,00               |
| 15-02-24 | FIA RVA EMB III           | Compra        | MGLU3  | 2,04  | 7.100,00   | 14.512,00      | 1,98             | 2,03        | 2,08         | 44.646,00               |
| 15-02-24 | FIA RVA EMB III           | Compra        | NTCO3  | 16,53 | 900,00     | 14.873,00      | 16,27            | 16,56       | 16,98        | 17.429,00               |
| 15-02-24 | FIA RVA EMB III           | Compra        | PRI03  | 43,71 | 600,00     | 26.227,00      | 41,88            | 43,76       | 44,72        | 32.785,00               |
| 15-02-24 | FIA RVA EMB III           | Compra        | RAI13  | 23,73 | 1.500,00   | 35.599,00      | 23,57            | 23,77       | 24,00        | 15.401,00               |
| 15-02-24 | FIA RVA EMB III           | Compra        | RECV3  | 22,32 | 900,00     | 20.085,00      | 21,68            | 22,32       | 22,74        | 7.963,00                |
| 15-02-24 | FIA RVA EMB III           | Venda         | SBS53  | 82,35 | 2.100,00   | 172.932,50     | 79,36            | 81,00       | 83,70        | 28.912,00               |
| 15-02-24 | FIA RVA EMB III           | Venda         | SBS53  | 81,83 | 1.700,00   | 139.119,35     | 79,36            | 81,00       | 83,70        | 28.912,00               |
| 15-02-24 | FIA RVA EMB III           | Compra        | SMFT3  | 24,72 | 500,00     | 12.359,00      | 24,23            | 24,64       | 24,84        | 4.393,00                |
| 15-02-24 | FIA RVA EMB III           | Compra        | SOMA3  | 7,04  | 1.900,00   | 13.380,00      | 6,90             | 7,03        | 7,20         | 14.376,00               |
| 15-02-24 | FIA RVA EMB III           | Compra        | SUZB3  | 52,08 | 800,00     | 41.667,00      | 51,77            | 52,15       | 52,44        | 10.909,00               |
| 15-02-24 | FIA RVA EMB III           | Compra        | YDUQ3  | 18,64 | 700,00     | 13.050,00      | 18,51            | 18,67       | 18,95        | 12.121,00               |
| 15-02-24 | FIA RVA EMB IV            | Venda         | HAPV3  | 3,41  | 7.937,00   | 27.056,89      | 3,38             | 3,41        | 3,47         | 45.041,00               |
| 15-02-24 | FIA RVA EMB IV            | Venda         | HAPV3  | 3,42  | 23.633,00  | 80.824,86      | 3,38             | 3,41        | 3,47         | 45.041,00               |
| 15-02-24 | FIA RVA EMB IV            | Compra        | PRI03  | 43,30 | 2.410,00   | 104.353,43     | 41,88            | 43,76       | 44,72        | 32.785,00               |
| 15-02-24 | FIA RVA EMB IV            | Compra        | PRI03  | 44,60 | 301,00     | 13.424,60      | 41,88            | 43,76       | 44,72        | 32.785,00               |
| 15-02-24 | FIA RVA EMB IV            | Compra        | PRI03  | 44,55 | 300,00     | 13.366,11      | 41,88            | 43,76       | 44,72        | 32.785,00               |
| 15-02-24 | FIA RVA EMB IV            | Compra        | VBRR3  | 23,65 | 1.510,00   | 35.711,25      | 23,52            | 23,72       | 24,09        | 19.772,00               |
| 15-02-24 | FIA RVA EMB IV            | Compra        | VBRR3  | 23,82 | 289,00     | 6.883,00       | 23,52            | 23,77       | 24,09        | 19.772,00               |
| 16-02-24 | FIA RVA EMB II            | Venda         | B3SA3  | 12,68 | 16.300,00  | 206.653,44     | 12,60            | 12,79       | 13,29        | 35.369,00               |
| 16-02-24 | FIA RVA EMB II            | Venda         | BBDC4  | 13,43 | 12.200,00  | 163.876,15     | 13,35            | 13,45       | 13,62        | 43.348,00               |
| 16-02-24 | FIA RVA EMB II            | Venda         | GMAT3  | 7,26  | 18.600,00  | 135.073,14     | 7,21             | 7,30        | 7,46         | 8.013,00                |
| 16-02-24 | FIA RVA EMB II            | Compra        | VALE3  | 67,78 | 5.300,00   | 359.215,76     | 66,34            | 67,51       | 68,32        | 62.651,00               |
| 16-02-24 | FIA RVA EMB III           | Compra        | ALOS3  | 23,35 | 1.800,00   | 42.030,00      | 23,10            | 23,33       | 23,74        | 9.521,00                |
| 16-02-24 | FIA RVA EMB III           | Compra        | ALOS3  | 23,25 | 7.200,00   | 167.432,10     | 23,10            | 23,33       | 23,74        | 9.521,00                |
| 16-02-24 | FIA RVA EMB III           | Compra        | ALOS3  | 23,37 | 1.400,00   | 32.721,91      | 23,10            | 23,33       | 23,74        | 9.521,00                |
| 16-02-24 | FIA RVA EMB III           | Venda         | ALPA4  | 9,34  | 6.700,00   | 62.550,86      | 8,98             | 9,31        | 9,52         | 10.902,00               |
| 16-02-24 | FIA RVA EMB III           | Compra        | ENEV3  | 12,26 | 3.500,00   | 42.913,32      | 12,08            | 12,28       | 12,50        | 16.119,00               |
| 16-02-24 | FIA RVA EMB III           | Compra        | LREN3  | 14,55 | 2.000,00   | 29.100,00      | 14,32            | 14,46       | 14,69        | 15.285,00               |
| 16-02-24 | FIA RVA EMB III           | Compra        | LREN3  | 14,40 | 1.400,00   | 20.160,00      | 14,32            | 14,46       | 14,69        | 15.285,00               |
| 16-02-24 | FIA RVA EMB III           | Compra        | LREN3  | 14,50 | 6.700,00   | 97.128,76      | 14,32            | 14,46       | 14,69        | 15.285,00               |
| 16-02-24 | FIA RVA EMB IV            | Compra        | UGPA3  | 29,91 | 18.300,00  | 547.351,00     | 29,22            | 29,77       | 30,00        | 16.042,00               |
| 16-02-24 | FIA RVA EMB IV            | Compra        | VBRR3  | 24,44 | 1.908,00   | 46.622,84      | 23,69            | 24,30       | 24,57        | 24.517,00               |
| 16-02-24 | FIA RVA EMB IV            | Compra        | VBRR3  | 24,26 | 2.378,00   | 57.696,48      | 23,69            | 24,30       | 24,57        | 24.517,00               |
| 16-02-24 | FIA RVA EMB IV            | Compra        | VBRR3  | 24,51 | 1.954,00   | 47.889,21      | 23,69            | 24,30       | 24,57        | 24.517,00               |
| 16-02-24 | FIA RVA EMB IV            | Compra        | VBRR3  | 24,47 | 1.303,00   | 31.887,98      | 23,69            | 24,30       | 24,57        | 24.517,00               |
| 16-02-24 | FIA RVA EMB IV            | Compra        | VBRR3  | 24,14 | 3.909,00   | 94.374,21      | 23,69            | 24,30       | 24,57        | 24.517,00               |
| 16-02-24 | FIA RVA EMB IV            | Compra        | VBRR3  | 24,39 | 18.889,00  | 460.654,92     | 23,69            | 24,30       | 24,57        | 24.517,00               |
| 16-02-24 | FIM EMB III A IMOBILIÁRIO | Compra        | AIEC11 | 52,29 | 1.000,00   | 52.290,00      | 52,20            | 52,53       | 53,00        | 1.082,00                |
| 16-02-24 | FIM EMB III A IMOBILIÁRIO | Compra        | BPML11 | 90,52 | 194,00     | 17.560,49      | 90,31            | 90,51       | 93,00        | 10,00                   |
| 19-02-24 | FIA RVA EMB II            | Venda         | AZUL4  | 11,96 | 8.100,00   | 96.850,65      | 11,91            | 11,98       | 12,17        | 8.874,00                |
| 19-02-24 | FIA RVA EMB II            | Venda         | B3SA3  | 12,67 | 16.800,00  | 212.821,02     | 12,57            | 12,66       | 12,77        | 19.691,00               |
| 19-02-24 | FIA RVA EMB II            | Compra        | PETRA  | 42,89 | 5.200,00   | 223.009,16     | 42,56            | 42,80       | 42,94        | 24.902,00               |
| 19-02-24 | FIA RVA EMB III           | Compra        | ALOS3  | 23,48 | 2.200,00   | 51.647,89      | 23,25            | 23,46       | 23,78        | 7.547,00                |
| 19-02-24 | FIA RVA EMB III           | Compra        | ALOS3  | 23,35 | 5.900,00   | 137.765,00     | 23,25            | 23,46       | 23,78        | 7.547,00                |
| 19-02-24 | FIA RVA EMB III           | Venda         | BBAS3  | 58,51 | 300,00     | 17.554,02      | 57,60            | 58,48       | 59,05        | 27.529,00               |
| 19-02-24 | FIA RVA EMB III           | Venda         | BBSE3  | 32,85 | 800,00     | 26.277,89      | 32,42            | 32,77       | 33,09        | 7.597,00                |
| 19-02-24 | FIA RVA EMB III           | Venda         | ELET3  | 42,90 | 1.500,00   | 64.354,80      | 42,32            | 42,85       | 43,07        | 14.191,00               |
| 19-02-24 | FIA RVA EMB III           | Venda         | ENAT3  | 21,98 | 3.000,00   | 65.951,98      | 21,63            | 22,12       | 23,52        | 9.460,00                |

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – FEVEREIRO 2024

## RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE FEVEREIRO DE 2024 À 29 DE FEVEREIRO DE 2024



|          |   |               |        |       |            |                |              | DADOS BM&FBOVESPA |              |                         |  |
|----------|---|---------------|--------|-------|------------|----------------|--------------|-------------------|--------------|-------------------------|--|
| DATA     | FUNDO                                     | TIPO OPERAÇÃO | PAPEL  | PREÇO | QT OPERADA | FINANCEIRO R\$ | PREÇO MÍNIMO | PREÇO MÉDIO       | PREÇO MÁXIMO | VOLUME TOTAL NEG. BOLSA |  |
| 19-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Compra        | ENEV3  | 12,35 | 1.000,00   | 12.347,90      | 12,18        | 12,31             | 12,42        | 8.313,00                |  |
| 19-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Compra        | ENEV3  | 12,22 | 200,00     | 2.444,00       | 12,18        | 12,31             | 12,42        | 8.313,00                |  |
| 19-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Venda         | EQLT3  | 33,98 | 1.900,00   | 64.561,48      | 33,84        | 34,00             | 34,21        | 10.360,00               |  |
| 19-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Venda         | FLRY3  | 15,77 | 800,00     | 12.614,30      | 15,73        | 15,76             | 15,88        | 10.461,00               |  |
| 19-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Compra        | HAPV3  | 3,45  | 13.100,00  | 45.228,59      | 3,43         | 3,46              | 3,51         | 20.255,00               |  |
| 19-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Venda         | IGTI11 | 22,97 | 1.000,00   | 22.971,60      | 22,82        | 23,09             | 23,35        | 9.560,00                |  |
| 19-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Venda         | ITSA4  | 10,52 | 4.600,00   | 48.411,95      | 10,44        | 10,52             | 10,57        | 23.508,00               |  |
| 19-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Compra        | LREN3  | 14,42 | 7.300,00   | 105.249,09     | 14,22        | 14,45             | 14,67        | 12.563,00               |  |
| 19-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Venda         | MGLU3  | 2,07  | 11.000,00  | 22.741,04      | 2,02         | 2,07              | 2,10         | 13.242,00               |  |
| 19-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Venda         | NTCO3  | 16,23 | 1.500,00   | 24.342,90      | 16,11        | 16,22             | 16,31        | 8.922,00                |  |
| 19-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Venda         | PRI03  | 45,38 | 1.000,00   | 45.382,97      | 44,86        | 45,44             | 45,96        | 15.026,00               |  |
| 19-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Venda         | RAI13  | 23,20 | 2.400,00   | 55.689,07      | 23,12        | 23,23             | 23,45        | 11.421,00               |  |
| 19-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Venda         | RECV3  | 23,32 | 1.300,00   | 30.314,56      | 22,98        | 23,24             | 23,52        | 7.375,00                |  |
| 19-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Venda         | RENT3  | 52,07 | 1.100,00   | 57.281,05      | 51,43        | 52,12             | 52,57        | 14.952,00               |  |
| 19-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Venda         | SMFT3  | 24,41 | 800,00     | 19.531,08      | 24,12        | 24,37             | 24,76        | 4.216,00                |  |
| 19-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Venda         | SOMA3  | 7,03  | 3.000,00   | 21.087,55      | 7,00         | 7,03              | 7,11         | 5.387,00                |  |
| 19-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Venda         | SUZB3  | 53,06 | 1.200,00   | 63.671,72      | 52,23        | 52,94             | 53,29        | 6.596,00                |  |
| 19-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Venda         | YDUQ3  | 19,28 | 1.100,00   | 21.211,28      | 19,00        | 19,35             | 19,60        | 8.983,00                |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | ABEV3  | 12,81 | 6.057,00   | 77.590,17      | 12,65        | 12,72             | 12,81        | 10.999,00               |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | ALOS3  | 23,67 | 734,00     | 17.370,50      | 23,25        | 23,46             | 23,78        | 7.547,00                |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | ALPA4  | 9,40  | 244,00     | 2.293,42       | 9,10         | 9,28              | 9,41         | 9.616,00                |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | ARZ3   | 58,99 | 86,00      | 5.073,37       | 58,40        | 58,87             | 59,52        | 5.573,00                |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | ASAI3  | 13,54 | 1.860,00   | 25.185,52      | 13,28        | 13,50             | 13,67        | 8.316,00                |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | AZUL4  | 11,97 | 452,00     | 5.410,29       | 11,91        | 11,98             | 12,17        | 8.874,00                |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | B3SA3  | 12,69 | 7.723,00   | 98.004,87      | 12,57        | 12,66             | 12,77        | 19.691,00               |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | BBA53  | 58,92 | 1.959,00   | 115.424,28     | 57,60        | 58,48             | 59,05        | 27.529,00               |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | BBDC3  | 12,31 | 2.069,00   | 25.469,71      | 12,17        | 12,29             | 12,38        | 9.012,00                |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | BBDC4  | 13,65 | 7.095,00   | 96.847,15      | 13,39        | 13,60             | 13,70        | 32.661,00               |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | BBSE3  | 32,77 | 926,00     | 30.345,47      | 32,42        | 32,77             | 33,09        | 7.597,00                |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | BEEF3  | 6,54  | 360,00     | 2.354,34       | 6,48         | 6,51              | 6,61         | 8.339,00                |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | BHIA3  | 8,41  | 130,00     | 1.092,90       | 8,20         | 8,42              | 8,61         | 8.568,00                |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | BPAC11 | 36,89 | 1.587,00   | 58.544,26      | 36,01        | 36,66             | 36,96        | 12.852,00               |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | BRAP4  | 22,15 | 346,00     | 7.664,14       | 21,97        | 22,08             | 22,23        | 5.536,00                |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | BRF53  | 14,15 | 2.312,00   | 32.715,05      | 14,01        | 14,11             | 14,30        | 7.844,00                |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | BRKM5  | 19,06 | 366,00     | 6.975,82       | 18,83        | 19,04             | 19,42        | 5.499,00                |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | CCRO3  | 13,19 | 1.372,00   | 18.097,76      | 13,04        | 13,15             | 13,25        | 7.036,00                |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | CIEL3  | 5,26  | 1.510,00   | 7.942,87       | 5,24         | 5,28              | 5,33         | 7.106,00                |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | CMIG4  | 11,89 | 1.982,00   | 23.566,83      | 11,66        | 11,83             | 11,92        | 11.250,00               |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | CMIN3  | 6,33  | 1.531,00   | 9.691,25       | 6,33         | 6,40              | 6,50         | 6.136,00                |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | COGN3  | 2,48  | 2.502,00   | 6.204,82       | 2,41         | 2,47              | 2,51         | 19.638,00               |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | CPEE3  | 35,86 | 258,00     | 9.251,36       | 35,79        | 35,92             | 36,16        | 3.457,00                |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | CPL6   | 10,33 | 2.314,00   | 23.903,57      | 10,21        | 10,31             | 10,36        | 11.920,00               |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | CRFB3  | 10,84 | 736,00     | 7.978,32       | 10,76        | 10,87             | 11,08        | 16.357,00               |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | CSAN3  | 18,81 | 1.610,00   | 30.283,94      | 18,62        | 18,85             | 19,08        | 12.270,00               |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | CSNA3  | 18,92 | 828,00     | 15.665,40      | 18,56        | 18,79             | 19,01        | 9.397,00                |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | CVCB3  | 3,30  | 725,00     | 2.392,22       | 3,12         | 3,21              | 3,30         | 4.808,00                |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | CYRE3  | 21,85 | 367,00     | 8.019,10       | 21,62        | 21,81             | 22,00        | 8.789,00                |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | DXCO3  | 7,36  | 418,00     | 3.076,42       | 7,23         | 7,30              | 7,44         | 8.460,00                |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | EGIE3  | 41,24 | 351,00     | 14.475,30      | 40,70        | 41,15             | 41,36        | 4.503,00                |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | ELET3  | 42,85 | 2.730,00   | 116.980,05     | 42,32        | 42,85             | 43,07        | 14.191,00               |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | ELET6  | 47,45 | 370,00     | 17.556,50      | 46,66        | 47,27             | 47,45        | 5.928,00                |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | EMBR3  | 22,68 | 1.013,00   | 22.974,57      | 22,19        | 22,55             | 22,73        | 5.233,00                |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | ENEV3  | 12,34 | 2.177,00   | 26.865,16      | 12,18        | 12,31             | 12,42        | 8.313,00                |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | ENGI11 | 50,45 | 2.292,00   | 115.631,15     | 50,35        | 50,52             | 50,79        | 6.074,00                |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | EQLT3  | 33,99 | 1.510,00   | 51.326,66      | 33,84        | 34,00             | 34,21        | 10.360,00               |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | EZTC3  | 15,06 | 126,00     | 1.898,12       | 14,96        | 15,05             | 15,29        | 5.338,00                |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | FLRY3  | 15,75 | 332,00     | 5.228,62       | 15,73        | 15,76             | 15,88        | 10.461,00               |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | GGBR4  | 21,26 | 1.542,00   | 32.782,66      | 20,94        | 21,17             | 21,32        | 11.745,00               |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | GOAU4  | 9,98  | 910,00     | 9.081,90       | 9,90         | 9,96              | 10,02        | 5.911,00                |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | HAPV3  | 3,49  | 6.057,00   | 21.138,84      | 3,43         | 3,46              | 3,51         | 20.255,00               |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | HYPE3  | 32,53 | 564,00     | 18.347,90      | 32,40        | 32,83             | 33,32        | 10.463,00               |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | IGTI11 | 23,35 | 300,00     | 7.004,35       | 22,82        | 23,09             | 23,35        | 9.560,00                |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | IRBR3  | 41,16 | 113,00     | 4.651,01       | 40,15        | 41,09             | 41,68        | 3.374,00                |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | ITSA4  | 10,54 | 7.406,00   | 78.059,24      | 10,44        | 10,52             | 10,57        | 23.508,00               |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | ITUB4  | 34,92 | 6.619,00   | 231.136,28     | 34,55        | 34,77             | 34,94        | 32.952,00               |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | JBSS3  | 22,21 | 1.565,00   | 34.760,05      | 21,91        | 22,08             | 22,39        | 9.008,00                |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | KLBN11 | 21,53 | 974,00     | 20.971,18      | 21,36        | 21,49             | 21,69        | 5.606,00                |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | LREN3  | 14,59 | 1.312,00   | 19.143,04      | 14,22        | 14,45             | 14,67        | 12.563,00               |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | LWSA3  | 5,66  | 542,00     | 3.068,44       | 5,28         | 5,43              | 5,78         | 12.492,00               |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | MGLU3  | 2,09  | 18.334,00  | 38.318,06      | 2,02         | 2,07              | 2,10         | 13.242,00               |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | MRFG3  | 8,68  | 458,00     | 3.975,88       | 8,58         | 8,70              | 9,06         | 13.188,00               |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | MVVE3  | 7,32  | 519,00     | 3.799,56       | 7,21         | 7,31              | 7,39         | 11.105,00               |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | MULT3  | 25,82 | 370,00     | 9.554,17       | 25,62        | 25,79             | 25,96        | 19.021,00               |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | NTCO3  | 16,25 | 1.166,00   | 18.949,12      | 16,11        | 16,22             | 16,31        | 8.922,00                |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | PCAR3  | 3,90  | 220,00     | 857,88         | 3,88         | 3,91              | 3,98         | 4.923,00                |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | PETR3  | 44,49 | 3.281,00   | 145.971,37     | 44,13        | 44,36             | 44,50        | 9.052,00                |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | PETRA  | 42,90 | 6.294,00   | 270.011,70     | 42,56        | 42,80             | 42,94        | 24.902,00               |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | PETZ3  | 3,49  | 427,00     | 1.490,23       | 3,48         | 3,49              | 3,54         | 4.504,00                |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | PRI03  | 45,89 | 1.103,00   | 50.616,52      | 44,86        | 45,44             | 45,96        | 15.026,00               |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | RADL3  | 24,90 | 1.759,00   | 43.803,10      | 24,81        | 24,98             | 25,30        | 10.971,00               |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | RAI13  | 23,24 | 1.679,00   | 39.022,13      | 23,12        | 23,23             | 23,45        | 11.421,00               |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | RAIZ4  | 3,85  | 1.645,00   | 6.333,06       | 3,82         | 3,84              | 3,93         | 12.242,00               |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | RDO3   | 25,32 | 1.609,00   | 40.739,74      | 25,22        | 25,55             | 26,46        | 10.658,00               |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | RECV3  | 23,05 | 379,00     | 8.734,38       | 22,98        | 23,24             | 23,52        | 7.375,00                |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | RENT3  | 52,56 | 1.177,00   | 61.862,10      | 51,43        | 52,12             | 52,57        | 14.952,00               |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | RRRP3  | 29,18 | 325,00     | 9.483,14       | 28,74        | 29,28             | 29,28        | 5.507,00                |  |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | SANB11 | 29,10 | 473,00     | 13.762,45      | 28,83        | 29,12             | 29,36        | 5.033,00                |  |

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – FEVEREIRO 2024



## RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE FEVEREIRO DE 2024 À 29 DE FEVEREIRO 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 |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | SBSF3  | 81,88 | 469,00     | 38.403,27      | 81,10            | 81,75       | 82,16        | 5.422,00                |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | SLCE3  | 19,18 | 270,00     | 5.178,72       | 18,98            | 19,17       | 19,62        | 6.945,00                |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | SMT03  | 25,79 | 196,00     | 5.054,46       | 25,43            | 25,67       | 25,96        | 5.436,00                |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | SOMA3  | 7,03  | 684,00     | 4.807,98       | 7,00             | 7,03        | 7,11         | 5.387,00                |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | SUZB3  | 53,04 | 942,00     | 49.965,92      | 52,23            | 52,94       | 53,29        | 6.596,00                |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | TAE11  | 35,40 | 302,00     | 10.691,32      | 35,36            | 35,49       | 35,72        | 8.263,00                |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | TIMS3  | 17,48 | 1.114,00   | 19.472,75      | 17,21            | 17,48       | 17,73        | 10.039,00               |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | TOTS3  | 30,87 | 709,00     | 21.887,25      | 30,33            | 30,62       | 30,93        | 12.021,00               |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | TRPL4  | 26,46 | 545,00     | 14.421,42      | 26,21            | 26,37       | 26,49        | 6.095,00                |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | UGPA3  | 29,82 | 1.498,00   | 44.671,32      | 29,39            | 29,67       | 29,91        | 6.542,00                |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | USIM5  | 10,16 | 710,00     | 7.214,20       | 9,82             | 10,03       | 10,21        | 10.274,00               |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | VALE3  | 67,49 | 5.785,00   | 390.429,81     | 66,64            | 67,18       | 67,59        | 25.565,00               |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | VAMD3  | 8,10  | 581,00     | 4.705,92       | 7,95             | 8,02        | 8,24         | 13.777,00               |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | VBBR3  | 24,00 | 1.537,00   | 36.888,60      | 23,86            | 24,01       | 24,37        | 8.343,00                |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | VIVT3  | 52,86 | 583,00     | 30.817,65      | 52,20            | 52,89       | 53,37        | 7.465,00                |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | WEGE3  | 33,49 | 2.042,00   | 68.386,76      | 33,05            | 33,29       | 33,49        | 9.380,00                |
| 19-02-24 | FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI | Compra        | YDUQ3  | 19,27 | 399,00     | 7.688,55       | 19,00            | 19,35       | 19,60        | 8.983,00                |
| 20-02-24 | FIA RVA EMB II                            | Compra        | CMIG4  | 12,08 | 8.500,00   | 102.646,31     | 11,67            | 11,96       | 12,14        | 23.286,00               |
| 20-02-24 | FIA RVA EMB II                            | Venda         | CRFB3  | 11,82 | 3.000,00   | 35.456,00      | 11,09            | 11,80       | 12,07        | 17.677,00               |
| 20-02-24 | FIA RVA EMB II                            | Compra        | ITSA4  | 10,73 | 9.200,00   | 98.738,59      | 10,63            | 10,85       | 10,94        | 32.445,00               |
| 20-02-24 | FIA RVA EMB II                            | Compra        | LREN3  | 14,68 | 9.400,00   | 137.988,43     | 14,38            | 14,70       | 14,83        | 17.249,00               |
| 20-02-24 | FIA RVA EMB II                            | Compra        | LWSA3  | 5,53  | 19.600,00  | 108.473,92     | 5,43             | 5,52        | 5,62         | 9.197,00                |
| 20-02-24 | FIA RVA EMB II                            | Compra        | LWSA3  | 5,54  | 19.500,00  | 108.108,00     | 5,43             | 5,52        | 5,62         | 9.197,00                |
| 20-02-24 | FIA RVA EMB II                            | Venda         | PETR3  | 44,07 | 4.600,00   | 202.716,76     | 43,32            | 43,74       | 44,46        | 25.018,00               |
| 20-02-24 | FIA RVA EMB II                            | Venda         | VALE3  | 65,39 | 4.500,00   | 294.260,53     | 65,19            | 65,74       | 66,36        | 77.087,00               |
| 20-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Compra        | ALOS3  | 24,00 | 900,00     | 21.599,94      | 23,46            | 24,00       | 24,15        | 6.994,00                |
| 20-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Venda         | CIEL3  | 5,29  | 17.700,00  | 93.588,52      | 5,24             | 5,30        | 5,34         | 16.603,00               |
| 20-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Venda         | CIEL3  | 5,29  | 6.800,00   | 35.972,00      | 5,24             | 5,30        | 5,34         | 16.603,00               |
| 20-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Venda         | ELET3  | 44,39 | 2.400,00   | 106.527,74     | 42,35            | 44,19       | 44,91        | 36.125,00               |
| 20-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Venda         | ELET3  | 44,52 | 5.400,00   | 240.389,81     | 42,35            | 44,19       | 44,91        | 36.125,00               |
| 20-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Venda         | ELET3  | 44,51 | 1.800,00   | 80.122,56      | 42,35            | 44,19       | 44,91        | 36.125,00               |
| 20-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Venda         | ENAT3  | 22,47 | 3.200,00   | 71.894,41      | 21,62            | 22,23       | 22,80        | 8.824,00                |
| 20-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Venda         | ENAT3  | 22,10 | 600,00     | 13.260,00      | 21,62            | 22,23       | 22,80        | 8.824,00                |
| 20-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Compra        | ENEV3  | 12,48 | 10.400,00  | 129.785,21     | 12,43            | 12,55       | 12,65        | 9.523,00                |
| 20-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Compra        | IGTI11 | 23,46 | 1.800,00   | 42.222,61      | 23,15            | 23,44       | 23,69        | 16.923,00               |
| 20-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Venda         | ITSA4  | 10,88 | 22.400,00  | 243.776,72     | 10,63            | 10,85       | 10,94        | 32.445,00               |
| 20-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Venda         | ITSA4  | 10,88 | 16.700,00  | 181.682,12     | 10,63            | 10,85       | 10,94        | 32.445,00               |
| 20-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Compra        | LREN3  | 14,69 | 2.900,00   | 42.598,95      | 14,38            | 14,70       | 14,83        | 17.249,00               |
| 20-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Compra        | PRI03  | 46,33 | 2.300,00   | 106.569,08     | 45,32            | 46,30       | 46,87        | 26.135,00               |
| 20-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Venda         | RECV3  | 23,58 | 4.500,00   | 106.120,20     | 22,67            | 23,50       | 23,83        | 7.558,00                |
| 20-02-24 | FIA RVA EMB IV                            | Compra        | VBBR3  | 24,61 | 2.232,00   | 54.936,75      | 23,74            | 24,68       | 24,94        | 21.327,00               |
| 20-02-24 | FIA RVA EMB IV                            | Compra        | VBBR3  | 24,80 | 1.116,00   | 27.675,14      | 23,74            | 24,68       | 24,94        | 21.327,00               |
| 20-02-24 | FIA RVA EMB IV                            | Compra        | VBBR3  | 24,80 | 837,00     | 20.754,81      | 23,74            | 24,68       | 24,94        | 21.327,00               |
| 20-02-24 | FIA RVA EMB IV                            | Compra        | VBBR3  | 24,71 | 584,00     | 14.431,24      | 23,74            | 24,68       | 24,94        | 21.327,00               |
| 21-02-24 | FIA RVA EMB II                            | Compra        | DIRR3  | 23,57 | 8.300,00   | 195.633,96     | 23,03            | 23,39       | 23,83        | 9.994,00                |
| 21-02-24 | FIA RVA EMB II                            | Venda         | MULT3  | 25,71 | 9.500,00   | 244.234,95     | 25,51            | 25,69       | 26,18        | 29.697,00               |
| 21-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Compra        | ENEV3  | 12,38 | 3.800,00   | 47.058,61      | 12,26            | 12,38       | 12,51        | 13.204,00               |
| 21-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Compra        | EQT13  | 33,71 | 2.000,00   | 67.427,64      | 33,46            | 33,81       | 34,37        | 16.325,00               |
| 21-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Compra        | EQT13  | 33,60 | 3.200,00   | 107.520,00     | 33,46            | 33,81       | 34,37        | 16.325,00               |
| 21-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Compra        | HAPV3  | 3,38  | 24.800,00  | 83.754,13      | 3,31             | 3,37        | 3,56         | 35.365,00               |
| 21-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Compra        | HAPV3  | 3,34  | 83.000,00  | 276.813,84     | 3,31             | 3,37        | 3,56         | 35.365,00               |
| 21-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Compra        | HAPV3  | 3,40  | 6.400,00   | 21.737,58      | 3,31             | 3,37        | 3,56         | 35.365,00               |
| 21-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Compra        | MGLU3  | 1,97  | 54.800,00  | 107.774,73     | 1,95             | 1,97        | 2,03         | 37.047,00               |
| 21-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Compra        | NTCO3  | 16,60 | 2.000,00   | 33.190,07      | 16,39            | 16,58       | 16,82        | 13.892,00               |
| 21-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Compra        | PRI03  | 46,21 | 600,00     | 27.728,90      | 45,65            | 46,98       | 47,38        | 28.349,00               |
| 21-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Compra        | RAIL3  | 22,87 | 3.800,00   | 86.923,54      | 22,78            | 22,94       | 23,35        | 20.167,00               |
| 21-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Venda         | RECV3  | 24,01 | 2.600,00   | 62.426,36      | 23,72            | 23,98       | 24,41        | 9.924,00                |
| 21-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Compra        | SOMA3  | 7,01  | 4.200,00   | 29.447,11      | 6,92             | 7,04        | 7,19         | 14.595,00               |
| 21-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Venda         | SUZB3  | 54,95 | 3.400,00   | 186.819,10     | 53,02            | 54,75       | 55,36        | 20.955,00               |
| 21-02-24 | FIA RVA EMB IV                            | Venda         | PRI03  | 47,08 | 10.793,00  | 508.109,87     | 45,65            | 46,98       | 47,38        | 28.349,00               |
| 21-02-24 | FIA RVA EMB IV                            | Venda         | PRI03  | 46,96 | 7.195,00   | 337.880,64     | 45,65            | 46,98       | 47,38        | 28.349,00               |
| 21-02-24 | FIA RVA EMB IV                            | Venda         | PRI03  | 47,00 | 8.994,00   | 422.718,00     | 45,65            | 46,98       | 47,38        | 28.349,00               |
| 22-02-24 | FIA RVA EMB II                            | Venda         | BBSE3  | 33,38 | 16.100,00  | 537.425,46     | 32,86            | 33,30       | 33,50        | 12.661,00               |
| 22-02-24 | FIA RVA EMB II                            | Venda         | CPFE3  | 35,55 | 5.700,00   | 202.659,24     | 35,21            | 35,60       | 35,86        | 8.077,00                |
| 22-02-24 | FIA RVA EMB II                            | Compra        | ONCO3  | 10,15 | 16.900,00  | 171.450,50     | 9,86             | 10,13       | 10,27        | 3.715,00                |
| 22-02-24 | FIA RVA EMB II                            | Venda         | RDR03  | 25,55 | 6.800,00   | 173.740,00     | 25,46            | 25,69       | 26,05        | 15.432,00               |
| 22-02-24 | FIA RVA EMB II                            | Compra        | VIVT3  | 55,83 | 12.500,00  | 697.930,61     | 53,77            | 55,40       | 56,18        | 12.778,00               |
| 22-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Compra        | ALOS3  | 24,08 | 1.500,00   | 36.118,62      | 23,87            | 24,08       | 24,25        | 8.740,00                |
| 22-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Compra        | ALOS3  | 24,06 | 3.600,00   | 86.616,09      | 23,87            | 24,08       | 24,25        | 8.740,00                |
| 22-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Venda         | ALPA4  | 10,03 | 900,00     | 9.027,00       | 9,72             | 9,91        | 10,07        | 12.020,00               |
| 22-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Venda         | ALPA4  | 9,97  | 2.000,00   | 19.940,00      | 9,72             | 9,91        | 10,07        | 12.020,00               |
| 22-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Venda         | ALPA4  | 9,95  | 13.100,00  | 130.352,14     | 9,72             | 9,91        | 10,07        | 12.020,00               |
| 22-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Compra        | BBA53  | 58,17 | 300,00     | 17.450,00      | 57,92            | 58,27       | 58,76        | 29.350,00               |
| 22-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Compra        | BBSE3  | 33,42 | 800,00     | 26.732,19      | 32,86            | 33,30       | 33,50        | 12.661,00               |
| 22-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Compra        | CPL3   | 9,31  | 10.600,00  | 98.686,00      | 9,22             | 9,28        | 9,36         | 6.106,00                |
| 22-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Compra        | CPL3   | 9,29  | 7.100,00   | 65.969,92      | 9,22             | 9,28        | 9,36         | 6.106,00                |
| 22-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Venda         | CPL6   | 10,24 | 3.200,00   | 32.768,00      | 10,18            | 10,26       | 10,31        | 16.799,00               |
| 22-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Venda         | CPL6   | 10,29 | 12.300,00  | 126.527,38     | 10,18            | 10,26       | 10,31        | 16.799,00               |
| 22-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Compra        | ELET3  | 43,52 | 1.700,00   | 73.991,95      | 43,24            | 43,56       | 44,12        | 24.047,00               |
| 22-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Venda         | ENAT3  | 24,01 | 3.600,00   | 86.434,05      | 23,12            | 23,93       | 24,45        | 11.326,00               |
| 22-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Compra        | ENEV3  | 12,48 | 3.600,00   | 44.941,40      | 12,35            | 12,45       | 12,65        | 12.742,00               |
| 22-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Compra        | ENEV3  | 12,50 | 900,00     | 11.250,00      | 12,35            | 12,45       | 12,65        | 12.742,00               |
| 22-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Compra        | ENEV3  | 12,50 | 4.300,00   | 53.767,24      | 12,35            | 12,45       | 12,65        | 12.742,00               |
| 22-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Compra        | ENEV3  | 12,38 | 1.800,00   | 22.284,00      | 12,35            | 12,45       | 12,65        | 12.742,00               |
| 22-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Compra        | EQT13  | 33,63 | 1.900,00   | 63.903,59      | 33,34            | 33,53       | 33,85        | 17.067,00               |
| 22-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Compra        | EQT13  | 33,62 | 3.200,00   | 107.597,78     | 33,34            | 33,53       | 33,85        | 17.067,00               |
| 22-02-24 | FIA RVA EMB III                           | Venda         | HAPV3  | 3,50  | 90.500,00  | 317.074,66     | 3,37             | 3,50        | 3,58         | 28.621,00               |

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – FEVEREIRO 2024

## RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE FEVEREIRO DE 2024 À 29 DE FEVEREIRO DE 2024

| DATA     | FUNDO           | TIPO OPERAÇÃO | PAPEL  | PREÇO | QT OPERADA | FINANCEIRO R\$ | DADOS BM&FBovespa |             |              |                         |
|----------|-----------------|---------------|--------|-------|------------|----------------|-------------------|-------------|--------------|-------------------------|
|          |                 |               |        |       |            |                | PREÇO MÍNIMO      | PREÇO MÉDIO | PREÇO MÁXIMO | VOLUME TOTAL NEG. BOLSA |
| 22-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | IGTI11 | 24,00 | 700,00     | 16.802,69      | 23,60             | 23,82       | 24,18        | 20.381,00               |
| 22-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | ITSA4  | 10,78 | 5.000,00   | 53.884,31      | 10,66             | 10,77       | 10,84        | 25.777,00               |
| 22-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | LREN3  | 14,98 | 900,00     | 13.480,00      | 14,75             | 14,99       | 15,16        | 19.190,00               |
| 22-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | MGLU3  | 2,09  | 12.500,00  | 26.169,06      | 1,98              | 2,05        | 2,11         | 27.826,00               |
| 22-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | NTCO3  | 16,94 | 3.800,00   | 64.358,45      | 16,64             | 16,88       | 17,15        | 15.905,00               |
| 22-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | NTCO3  | 16,95 | 1.500,00   | 25.420,16      | 16,64             | 16,88       | 17,15        | 15.905,00               |
| 22-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | PRI03  | 46,83 | 4.600,00   | 215.439,65     | 46,61             | 46,92       | 47,78        | 22.280,00               |
| 22-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | RAIL3  | 22,94 | 2.500,00   | 57.359,27      | 22,75             | 22,94       | 23,20        | 19.462,00               |
| 22-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | RECV3  | 24,12 | 5.000,00   | 120.578,00     | 23,89             | 24,14       | 24,39        | 10.079,00               |
| 22-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | RENT3  | 53,92 | 900,00     | 48.528,84      | 53,37             | 53,96       | 54,75        | 23.539,00               |
| 22-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | SMFT3  | 25,28 | 800,00     | 20.225,00      | 24,73             | 25,25       | 25,48        | 5.203,00                |
| 22-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | SOMA3  | 7,09  | 3.200,00   | 22.675,75      | 7,04              | 7,09        | 7,15         | 7.632,00                |
| 22-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | SUZB3  | 55,79 | 2.700,00   | 150.644,52     | 55,12             | 55,83       | 56,48        | 19.417,00               |
| 22-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | YDUQ3  | 19,87 | 1.100,00   | 21.853,07      | 19,54             | 19,81       | 20,01        | 11.681,00               |
| 22-02-24 | FIA RVA EMB IV  | Compra        | ENGI11 | 50,21 | 92,00      | 4.619,42       | 49,70             | 50,21       | 50,56        | 5.675,00                |
| 22-02-24 | FIA RVA EMB IV  | Compra        | ENGI11 | 50,25 | 2.692,00   | 135.260,74     | 49,70             | 50,21       | 50,56        | 5.675,00                |
| 22-02-24 | FIA RVA EMB IV  | Compra        | HAPV3  | 3,51  | 96.134,00  | 337.460,57     | 3,37              | 3,50        | 3,58         | 28.621,00               |
| 22-02-24 | FIA RVA EMB IV  | Venda         | PRI03  | 46,73 | 1.140,00   | 53.276,62      | 46,61             | 46,92       | 47,78        | 22.280,00               |
| 22-02-24 | FIA RVA EMB IV  | Venda         | PRI03  | 46,83 | 1.711,00   | 80.122,49      | 46,61             | 46,92       | 47,78        | 22.280,00               |
| 22-02-24 | FIA RVA EMB IV  | Venda         | PRI03  | 46,75 | 1.140,00   | 53.295,12      | 46,61             | 46,92       | 47,78        | 22.280,00               |
| 22-02-24 | FIA RVA EMB IV  | Venda         | PRI03  | 46,74 | 684,00     | 31.970,73      | 46,61             | 46,92       | 47,78        | 22.280,00               |
| 23-02-24 | FIA RVA EMB II  | Compra        | ITSA4  | 10,32 | 18.700,00  | 192.984,00     | 10,19             | 10,27       | 10,44        | 27.622,00               |
| 23-02-24 | FIA RVA EMB II  | Venda         | RDOR3  | 25,10 | 6.600,00   | 165.660,00     | 24,92             | 25,08       | 25,64        | 17.340,00               |
| 23-02-24 | FIA RVA EMB II  | Venda         | VALE3  | 67,38 | 2.000,00   | 134.760,00     | 67,24             | 68,08       | 69,07        | 69.103,00               |
| 23-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | ALPA4  | 10,00 | 4.500,00   | 45.007,94      | 9,79              | 9,95        | 10,09        | 13.436,00               |
| 23-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | ALPA4  | 10,03 | 2.600,00   | 26.080,44      | 9,79              | 9,95        | 10,09        | 13.436,00               |
| 23-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | ENAT3  | 24,34 | 7.000,00   | 170.358,02     | 23,83             | 24,23       | 24,72        | 9.821,00                |
| 23-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | ENEV3  | 12,43 | 5.200,00   | 64.636,00      | 12,17             | 12,28       | 12,47        | 18.544,00               |
| 23-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | FLRY3  | 15,63 | 1.800,00   | 28.133,02      | 15,58             | 15,69       | 15,85        | 9.340,00                |
| 23-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | FLRY3  | 15,67 | 11.400,00  | 178.688,90     | 15,58             | 15,69       | 15,85        | 9.340,00                |
| 23-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | IGTI11 | 23,48 | 1.200,00   | 28.177,41      | 23,28             | 23,48       | 24,03        | 10.956,00               |
| 23-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | IGTI11 | 23,47 | 1.900,00   | 44.600,34      | 23,28             | 23,48       | 24,03        | 10.956,00               |
| 23-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | LREN3  | 15,47 | 9.800,00   | 151.634,26     | 14,98             | 15,31       | 15,73        | 24.582,00               |
| 23-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | RAIL3  | 22,94 | 5.000,00   | 114.687,08     | 22,80             | 22,91       | 23,12        | 15.863,00               |
| 23-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | RAIL3  | 22,95 | 4.500,00   | 103.260,00     | 22,80             | 22,91       | 23,12        | 15.863,00               |
| 23-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | YDUQ3  | 19,39 | 1.100,00   | 21.324,57      | 19,08             | 19,47       | 19,92        | 14.695,00               |
| 23-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | YDUQ3  | 19,44 | 5.100,00   | 99.167,48      | 19,08             | 19,47       | 19,92        | 14.695,00               |
| 23-02-24 | FIA RVA EMB IV  | Compra        | ENGI11 | 50,26 | 323,00     | 16.232,55      | 49,91             | 50,30       | 50,59        | 7.384,00                |
| 23-02-24 | FIA RVA EMB IV  | Compra        | ENGI11 | 50,19 | 230,00     | 11.543,33      | 49,91             | 50,30       | 50,59        | 7.384,00                |
| 23-02-24 | FIA RVA EMB IV  | Venda         | GMAT3  | 8,00  | 64.673,00  | 517.179,81     | 7,88              | 7,98        | 8,06         | 12.011,00               |
| 23-02-24 | FIA RVA EMB IV  | Compra        | HAPV3  | 3,57  | 23.894,00  | 85.391,19      | 3,51              | 3,58        | 3,63         | 30.243,00               |
| 23-02-24 | FIA RVA EMB IV  | Compra        | HAPV3  | 3,59  | 46.713,00  | 167.827,35     | 3,51              | 3,58        | 3,63         | 30.243,00               |
| 26-02-24 | FIA RVA EMB II  | Compra        | SUZB3  | 55,27 | 5.100,00   | 281.873,01     | 54,93             | 55,65       | 56,15        | 11.113,00               |
| 26-02-24 | FIA RVA EMB II  | Venda         | VALE3  | 65,71 | 2.700,00   | 177.429,10     | 65,45             | 65,79       | 66,55        | 57.448,00               |
| 26-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | ALPA4  | 10,08 | 7.700,00   | 77.617,99      | 9,78              | 10,02       | 10,27        | 7.609,00                |
| 26-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | ALPA4  | 9,94  | 2.200,00   | 21.878,68      | 9,78              | 10,02       | 10,27        | 7.609,00                |
| 26-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | ALPA4  | 10,05 | 3.100,00   | 31.155,00      | 9,78              | 10,02       | 10,27        | 7.609,00                |
| 26-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | CPLÉ3  | 9,20  | 12.300,00  | 113.160,00     | 9,13              | 9,19        | 9,28         | 6.066,00                |
| 26-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | CPLÉ6  | 10,19 | 5.800,00   | 59.075,65      | 10,13             | 10,21       | 10,33        | 12.356,00               |
| 26-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | CPLÉ6  | 10,23 | 5.900,00   | 60.357,00      | 10,13             | 10,21       | 10,33        | 12.356,00               |
| 26-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | ENAT3  | 24,68 | 700,00     | 17.273,10      | 23,80             | 24,52       | 24,82        | 5.731,00                |
| 26-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | ENAT3  | 24,65 | 900,00     | 22.185,00      | 23,80             | 24,52       | 24,82        | 5.731,00                |
| 26-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | FLRY3  | 15,74 | 3.400,00   | 53.522,14      | 15,64             | 15,75       | 15,86        | 5.751,00                |
| 26-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | FLRY3  | 15,75 | 3.000,00   | 47.261,62      | 15,64             | 15,75       | 15,86        | 5.751,00                |
| 26-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | FLRY3  | 15,79 | 300,00     | 4.735,55       | 15,64             | 15,75       | 15,86        | 5.751,00                |
| 26-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | MGLU3  | 2,13  | 73.500,00  | 156.826,98     | 2,09              | 2,13        | 2,20         | 24.394,00               |
| 26-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | MGLU3  | 2,14  | 26.900,00  | 57.566,00      | 2,09              | 2,13        | 2,20         | 24.394,00               |
| 26-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | NTCO3  | 16,41 | 1.200,00   | 19.692,66      | 16,25             | 16,48       | 16,77        | 13.513,00               |
| 26-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | PRI03  | 46,10 | 2.800,00   | 129.086,87     | 45,32             | 45,96       | 46,50        | 12.621,00               |
| 26-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | RAIL3  | 22,68 | 9.900,00   | 224.509,03     | 22,60             | 22,72       | 22,95        | 9.277,00                |
| 26-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | RAIL3  | 22,68 | 1.500,00   | 34.023,82      | 22,60             | 22,72       | 22,95        | 9.277,00                |
| 26-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | RENT3  | 52,09 | 900,00     | 46.881,00      | 52,09             | 52,75       | 53,73        | 20.943,00               |
| 26-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | SOMA3  | 6,90  | 12.400,00  | 85.585,59      | 6,81              | 6,89        | 7,13         | 14.404,00               |
| 26-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | SUZB3  | 55,66 | 600,00     | 33.398,50      | 54,93             | 55,65       | 56,15        | 11.113,00               |
| 26-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | SUZB3  | 55,27 | 1.100,00   | 60.793,46      | 54,93             | 55,65       | 56,15        | 11.113,00               |
| 26-02-24 | FIA RVA EMB IV  | Compra        | ENGI11 | 51,14 | 40,00      | 2.045,68       | 50,23             | 51,04       | 51,60        | 8.448,00                |
| 26-02-24 | FIA RVA EMB IV  | Compra        | ENGI11 | 51,34 | 715,00     | 36.709,88      | 50,23             | 51,04       | 51,60        | 8.448,00                |
| 26-02-24 | FIA RVA EMB IV  | Compra        | ENGI11 | 50,95 | 458,00     | 23.336,74      | 50,23             | 51,04       | 51,60        | 8.448,00                |
| 26-02-24 | FIA RVA EMB IV  | Compra        | ENGI11 | 51,36 | 965,00     | 49.557,73      | 50,23             | 51,04       | 51,60        | 8.448,00                |
| 27-02-24 | FIA RVA EMB II  | Compra        | B3SA3  | 12,78 | 11.400,00  | 145.692,00     | 12,57             | 12,73       | 12,81        | 38.060,00               |
| 27-02-24 | FIA RVA EMB II  | Compra        | ITUB4  | 34,78 | 4.500,00   | 156.510,00     | 34,40             | 34,69       | 34,85        | 35.309,00               |
| 27-02-24 | FIA RVA EMB II  | Compra        | LREN3  | 16,15 | 27.300,00  | 440.895,00     | 15,34             | 15,98       | 16,22        | 26.165,00               |
| 27-02-24 | FIA RVA EMB II  | Compra        | MRFG3  | 9,29  | 14.800,00  | 137.564,34     | 9,05              | 9,28        | 9,42         | 20.002,00               |
| 27-02-24 | FIA RVA EMB II  | Venda         | PETR4  | 42,57 | 7.900,00   | 336.285,92     | 42,38             | 42,60       | 42,82        | 44.383,00               |
| 27-02-24 | FIA RVA EMB II  | Venda         | RDOR3  | 26,03 | 15.500,00  | 403.465,00     | 25,21             | 25,87       | 26,13        | 18.555,00               |
| 27-02-24 | FIA RVA EMB II  | Venda         | RDOR3  | 25,75 | 4.200,00   | 108.152,07     | 25,21             | 25,87       | 26,13        | 18.555,00               |
| 27-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | YDUQ3  | 20,67 | 6.100,00   | 126.087,00     | 19,71             | 20,36       | 20,77        | 13.522,00               |
| 27-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | ALPA4  | 10,28 | 3.400,00   | 34.937,49      | 10,13             | 10,30       | 10,50        | 10.542,00               |
| 27-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | ALPA4  | 10,29 | 7.200,00   | 74.088,00      | 10,13             | 10,30       | 10,50        | 10.542,00               |
| 27-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | CPLÉ3  | 9,25  | 3.500,00   | 32.375,00      | 9,17              | 9,23        | 9,27         | 7.792,00                |
| 27-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | CPLÉ3  | 9,25  | 8.800,00   | 81.396,46      | 9,17              | 9,23        | 9,27         | 7.792,00                |
| 27-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | CPLÉ3  | 9,25  | 1.100,00   | 10.171,44      | 9,17              | 9,23        | 9,27         | 7.792,00                |
| 27-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | CPLÉ6  | 10,32 | 8.300,00   | 85.651,20      | 10,18             | 10,29       | 10,35        | 18.192,00               |
| 27-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | CPLÉ6  | 10,34 | 1.500,00   | 15.510,00      | 10,18             | 10,29       | 10,35        | 18.192,00               |
| 27-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | CPLÉ6  | 10,31 | 1.600,00   | 16.496,00      | 10,18             | 10,29       | 10,35        | 18.192,00               |
| 27-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | CPLÉ6  | 10,29 | 700,00     | 7.200,92       | 10,18             | 10,29       | 10,35        | 18.192,00               |
| 27-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | ENAT3  | 25,10 | 1.200,00   | 30.122,16      | 24,75             | 25,30       | 25,75        | 10.016,00               |

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – FEVEREIRO 2024

## RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE FEVEREIRO DE 2024 À 29 DE FEVEREIRO 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 |
| 27-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | ENAT3  | 25,46 | 3.000,00   | 76.370,20      | 24,75             | 25,30       | 25,75        | 10.016,00               |
| 27-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | FLRY3  | 16,17 | 3.100,00   | 50.123,15      | 15,83             | 16,17       | 16,32        | 7.297,00                |
| 27-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | HAPV3  | 3,72  | 8.000,00   | 29.760,00      | 3,63              | 3,73        | 3,77         | 31.628,00               |
| 27-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | HAPV3  | 3,71  | 14.800,00  | 54.952,40      | 3,63              | 3,73        | 3,77         | 31.628,00               |
| 27-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | HAPV3  | 3,71  | 17.700,00  | 65.667,00      | 3,63              | 3,73        | 3,77         | 31.628,00               |
| 27-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | LREN3  | 15,85 | 9.400,00   | 149.019,24     | 15,34             | 15,98       | 16,22        | 26.165,00               |
| 27-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | LREN3  | 15,90 | 3.000,00   | 47.711,77      | 15,34             | 15,98       | 16,22        | 26.165,00               |
| 27-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | MGLU1  | 0,16  | 114.900,00 | 18.213,89      | 0,12              | 0,16        | 0,20         | 3.140,00                |
| 27-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | MGLU3  | 2,17  | 114.900,00 | 249.067,85     | 2,13              | 2,17        | 2,20         | 25.150,00               |
| 27-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | NTCO3  | 16,76 | 6.000,00   | 100.538,28     | 16,54             | 16,76       | 16,99        | 18.775,00               |
| 27-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | NTCO3  | 16,69 | 5.700,00   | 95.123,51      | 16,54             | 16,76       | 16,99        | 18.775,00               |
| 27-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | RAIL3  | 22,85 | 3.600,00   | 82.268,74      | 22,72             | 22,91       | 23,05        | 18.183,00               |
| 27-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | RAIL3  | 22,83 | 11.500,00  | 262.579,99     | 22,72             | 22,91       | 23,05        | 18.183,00               |
| 27-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | RENT9  | 45,35 | 27,00      | 1.224,45       | 52,54             | 54,00       | 54,50        | 29.697,00               |
| 27-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | SMFT3  | 24,65 | 5.800,00   | 142.975,26     | 24,37             | 24,93       | 25,28        | 8.256,00                |
| 27-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | SMFT3  | 24,80 | 500,00     | 12.399,49      | 24,37             | 24,93       | 25,28        | 8.256,00                |
| 27-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | SOMA3  | 7,04  | 3.500,00   | 24.639,48      | 6,91              | 7,05        | 7,14         | 15.277,00               |
| 27-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | SOMA3  | 7,03  | 2.700,00   | 18.972,00      | 6,91              | 7,05        | 7,14         | 15.277,00               |
| 27-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | SUZB3  | 57,20 | 1.900,00   | 108.680,13     | 55,86             | 57,06       | 57,66        | 24.972,00               |
| 27-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | SUZB3  | 57,15 | 4.200,00   | 240.019,89     | 55,86             | 57,06       | 57,66        | 24.972,00               |
| 27-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | SUZB3  | 57,25 | 200,00     | 11.450,00      | 55,86             | 57,06       | 57,66        | 24.972,00               |
| 27-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | SUZB3  | 57,00 | 1.300,00   | 74.100,00      | 55,86             | 57,06       | 57,66        | 24.972,00               |
| 27-02-24 | FIA RVA EMB IV  | Venda         | GMAT3  | 8,22  | 1.923,00   | 15.808,40      | 8,01              | 8,15        | 8,28         | 7.839,00                |
| 27-02-24 | FIA RVA EMB IV  | Compra        | HAPV3  | 3,74  | 29.890,00  | 111.669,04     | 3,63              | 3,73        | 3,77         | 31.628,00               |
| 27-02-24 | FIA RVA EMB IV  | Compra        | HAPV3  | 3,74  | 4.916,00   | 18.404,08      | 3,63              | 3,73        | 3,77         | 31.628,00               |
| 27-02-24 | FIA RVA EMB IV  | Compra        | HAPV3  | 3,75  | 6.305,00   | 23.643,75      | 3,63              | 3,73        | 3,77         | 31.628,00               |
| 27-02-24 | FIA RVA EMB IV  | Compra        | HAPV3  | 3,74  | 18.280,00  | 68.293,15      | 3,63              | 3,73        | 3,77         | 31.628,00               |
| 27-02-24 | FIA RVA EMB IV  | Venda         | RENT9  | 45,35 | 15,00      | 680,25         | 52,54             | 54,00       | 54,50        | 29.697,00               |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB II  | Venda         | B3SA3  | 12,47 | 6.400,00   | 79.791,97      | 12,37             | 12,53       | 12,65        | 37.185,00               |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB II  | Venda         | GGBR4  | 21,31 | 10.000,00  | 213.059,84     | 21,25             | 21,47       | 21,66        | 13.157,00               |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB II  | Compra        | MRFG3  | 9,59  | 22.100,00  | 211.950,90     | 9,40              | 9,57        | 9,72         | 25.108,00               |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB II  | Venda         | PETRA  | 40,38 | 2.900,00   | 117.102,00     | 39,83             | 41,14       | 42,94        | 109.514,00              |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB II  | Venda         | PRI03  | 44,61 | 4.600,00   | 205.208,78     | 44,02             | 44,39       | 45,17        | 30.852,00               |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB II  | Venda         | RAIL3  | 22,85 | 15.400,00  | 351.899,76     | 22,77             | 22,88       | 23,07        | 13.070,00               |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB II  | Compra        | SUZB3  | 57,35 | 8.000,00   | 458.812,86     | 56,55             | 57,39       | 58,04        | 22.921,00               |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB II  | Venda         | VALE3  | 66,63 | 1.400,00   | 93.280,35      | 66,33             | 66,72       | 67,22        | 42.920,00               |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB II  | Compra        | VIVT3  | 56,07 | 7.400,00   | 414.895,76     | 55,50             | 55,91       | 56,39        | 8.213,00                |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | ALOS3  | 24,44 | 1.100,00   | 26.884,91      | 24,23             | 24,49       | 24,71        | 14.219,00               |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | ALOS3  | 24,43 | 2.100,00   | 51.301,93      | 24,23             | 24,49       | 24,71        | 14.219,00               |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | ALPA4  | 10,33 | 10.800,00  | 111.589,27     | 10,14             | 10,29       | 10,43        | 7.547,00                |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | BBSF3  | 33,55 | 500,00     | 16.774,37      | 33,20             | 33,50       | 33,69        | 8.278,00                |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | BPAC11 | 36,37 | 700,00     | 25.456,58      | 36,04             | 36,33       | 36,65        | 18.273,00               |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | CPLF3  | 9,18  | 900,00     | 8.262,00       | 9,15              | 9,21        | 9,27         | 8.881,00                |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | CPLF3  | 9,18  | 2.700,00   | 24.786,00      | 9,15              | 9,21        | 9,27         | 8.881,00                |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | CPLF3  | 9,17  | 3.600,00   | 33.024,38      | 9,15              | 9,21        | 9,27         | 8.881,00                |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | CPLF3  | 9,23  | 1.900,00   | 17.536,00      | 9,15              | 9,21        | 9,27         | 8.881,00                |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | CPLF6  | 10,25 | 3.100,00   | 31.762,96      | 10,18             | 10,26       | 10,33        | 18.125,00               |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | CPLF6  | 10,25 | 2.300,00   | 23.575,00      | 10,18             | 10,26       | 10,33        | 18.125,00               |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | CPLF6  | 10,27 | 800,00     | 8.212,76       | 10,18             | 10,26       | 10,33        | 18.125,00               |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | ELET3  | 43,82 | 1.000,00   | 43.815,30      | 43,39             | 43,79       | 44,05        | 22.952,00               |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | ENAT3  | 25,60 | 600,00     | 15.360,00      | 25,15             | 25,33       | 25,64        | 8.185,00                |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | ENAT3  | 25,29 | 1.900,00   | 48.042,67      | 25,15             | 25,33       | 25,64        | 8.185,00                |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | ENEV3  | 12,86 | 2.200,00   | 28.286,60      | 12,60             | 12,78       | 12,97        | 10.430,00               |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | EQLT3  | 33,98 | 2.600,00   | 88.340,74      | 33,34             | 33,94       | 34,25        | 18.160,00               |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | EQLT3  | 34,03 | 1.500,00   | 51.047,57      | 33,34             | 33,94       | 34,25        | 18.160,00               |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | FLRY3  | 15,94 | 11.200,00  | 178.496,07     | 15,79             | 15,97       | 16,29        | 11.137,00               |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | FLRY3  | 15,92 | 1.600,00   | 25.470,82      | 15,79             | 15,97       | 16,29        | 11.137,00               |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | FLRY3  | 16,26 | 2.400,00   | 39.024,00      | 15,79             | 15,97       | 16,29        | 11.137,00               |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | HAPV3  | 3,76  | 4.900,00   | 18.424,09      | 3,66              | 3,74        | 3,84         | 26.738,00               |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | IGTI11 | 23,37 | 1.600,00   | 37.384,17      | 23,01             | 23,39       | 23,75        | 20.744,00               |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | IGTI11 | 23,20 | 1.700,00   | 39.440,00      | 23,01             | 23,39       | 23,75        | 20.744,00               |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | IGTI11 | 23,31 | 1.700,00   | 39.633,73      | 23,01             | 23,39       | 23,75        | 20.744,00               |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | ITSA4  | 10,54 | 3.400,00   | 35.851,13      | 10,42             | 10,53       | 10,58        | 15.185,00               |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | LREN3  | 15,84 | 5.500,00   | 87.135,23      | 15,70             | 15,95       | 16,33        | 19.044,00               |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | MGLU3  | 2,17  | 6.300,00   | 13.662,87      | 2,13              | 2,17        | 2,22         | 20.842,00               |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | NTCO3  | 16,62 | 3.400,00   | 56.511,56      | 16,50             | 16,63       | 16,85        | 13.207,00               |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | NTCO3  | 16,74 | 1.300,00   | 21.762,00      | 16,50             | 16,63       | 16,85        | 13.207,00               |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | NTCO3  | 16,76 | 3.100,00   | 51.949,51      | 16,50             | 16,63       | 16,85        | 13.207,00               |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | PRI03  | 44,24 | 700,00     | 30.970,68      | 44,02             | 44,39       | 45,17        | 30.852,00               |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | RAIL3  | 22,86 | 2.000,00   | 45.719,51      | 22,77             | 22,88       | 23,07        | 13.070,00               |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | RAIL3  | 22,85 | 2.900,00   | 66.260,40      | 22,77             | 22,88       | 23,07        | 13.070,00               |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | RECV3  | 23,02 | 1.000,00   | 23.020,13      | 22,76             | 23,05       | 23,30        | 8.985,00                |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | RENT9  | 53,86 | 500,00     | 26.932,46      | 53,37             | 53,84       | 54,45        | 19.213,00               |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | SBSF3  | 79,09 | 1.100,00   | 87.003,55      | 78,43             | 79,20       | 79,95        | 11.610,00               |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | SMFT3  | 24,55 | 2.200,00   | 54.016,51      | 24,19             | 24,52       | 24,91        | 11.114,00               |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | SMFT3  | 24,68 | 2.200,00   | 54.295,89      | 24,19             | 24,52       | 24,91        | 11.114,00               |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | SMFT3  | 24,57 | 600,00     | 14.739,77      | 24,19             | 24,52       | 24,91        | 11.114,00               |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | SOMA3  | 7,03  | 4.900,00   | 34.430,67      | 7,00              | 7,05        | 7,13         | 17.075,00               |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | SOMA3  | 7,06  | 4.900,00   | 34.594,00      | 7,00              | 7,05        | 7,13         | 17.075,00               |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | SOMA3  | 7,06  | 9.800,00   | 69.146,38      | 7,00              | 7,05        | 7,13         | 17.075,00               |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | SUZB3  | 57,42 | 2.100,00   | 120.574,93     | 56,55             | 57,39       | 58,04        | 22.921,00               |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | YDUQ3  | 20,48 | 800,00     | 16.382,47      | 20,19             | 20,51       | 20,82        | 12.287,00               |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB IV  | Compra        | ENGI11 | 50,27 | 1.017,00   | 51.129,29      | 50,03             | 50,50       | 51,02        | 13.969,00               |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB IV  | Venda         | GMAT3  | 7,95  | 14.391,00  | 114.400,85     | 7,79              | 7,92        | 8,12         | 13.401,00               |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB IV  | Venda         | GMAT3  | 7,91  | 761,00     | 6.019,33       | 7,79              | 7,92        | 8,12         | 13.401,00               |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB IV  | Compra        | HAPV3  | 3,75  | 29.521,00  | 110.648,84     | 3,66              | 3,74        | 3,84         | 26.738,00               |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB IV  | Compra        | VBBR3  | 25,96 | 7.183,00   | 186.470,68     | 25,58             | 25,90       | 26,09        | 16.583,00               |

## RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE FEVEREIRO DE 2024 À 29 DE FEVEREIRO 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 |
| 28-02-24 | FIA RVA EMB IV  | Compra        | VBBR3  | 25,87 | 1.322,00   | 34.203,74      | 25,58            | 25,90       | 26,09        | 16.583,00               |
| 29-02-24 | FIA RVA EMB II  | Compra        | ABEV3  | 12,63 | 10.000,00  | 126.345,16     | 12,40            | 12,61       | 12,99        | 56.982,00               |
| 29-02-24 | FIA RVA EMB II  | Compra        | MRF33  | 9,89  | 6.700,00   | 66.290,45      | 9,49             | 9,77        | 9,90         | 12.107,00               |
| 29-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | ALPA4  | 10,10 | 5.600,00   | 56.547,81      | 9,94             | 10,09       | 10,20        | 8.064,00                |
| 29-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | ALPA4  | 10,10 | 1.100,00   | 11.110,00      | 9,94             | 10,09       | 10,20        | 8.064,00                |
| 29-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | ENAT3  | 25,25 | 400,00     | 10.098,85      | 24,98            | 25,36       | 25,66        | 6.404,00                |
| 29-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | ENAT3  | 25,35 | 1.400,00   | 35.490,00      | 24,98            | 25,36       | 25,66        | 6.404,00                |
| 29-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | ENEV3  | 12,81 | 13.500,00  | 172.976,54     | 12,58            | 12,80       | 12,88        | 17.586,00               |
| 29-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | ENEV3  | 12,75 | 10.500,00  | 133.875,00     | 12,58            | 12,80       | 12,88        | 17.586,00               |
| 29-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | EQTL3  | 33,70 | 2.000,00   | 67.400,00      | 33,64            | 34,05       | 34,23        | 14.107,00               |
| 29-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | EQTL3  | 33,99 | 2.900,00   | 98.570,25      | 33,64            | 34,05       | 34,23        | 14.107,00               |
| 29-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | FLRY3  | 15,82 | 5.300,00   | 83.822,83      | 15,68            | 15,84       | 15,94        | 6.463,00                |
| 29-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | HAPV3  | 3,68  | 25.300,00  | 93.203,87      | 3,64             | 3,68        | 3,77         | 29.443,00               |
| 29-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | LREN3  | 15,82 | 6.700,00   | 105.976,36     | 15,54            | 15,81       | 16,02        | 17.784,00               |
| 29-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | LREN3  | 15,80 | 200,00     | 3.159,17       | 15,54            | 15,81       | 16,02        | 17.784,00               |
| 29-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | LREN3  | 15,79 | 1.800,00   | 28.422,00      | 15,54            | 15,81       | 16,02        | 17.784,00               |
| 29-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | MGLU9  | 1,95  | 253.404,00 | 494.137,80     | 2,13             | 2,15        | 2,19         | 31.104,00               |
| 29-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | NTCO3  | 16,13 | 4.200,00   | 67.761,06      | 16,04            | 16,30       | 16,55        | 34.718,00               |
| 29-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | PRI03  | 43,82 | 1.000,00   | 43.819,92      | 43,70            | 43,86       | 44,45        | 20.551,00               |
| 29-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | PRI03  | 43,75 | 900,00     | 39.374,98      | 43,70            | 43,86       | 44,45        | 20.551,00               |
| 29-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | PRI03  | 43,75 | 1.800,00   | 78.750,00      | 43,70            | 43,86       | 44,45        | 20.551,00               |
| 29-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | RAIL3  | 22,62 | 4.800,00   | 108.578,53     | 22,43            | 22,67       | 22,75        | 14.728,00               |
| 29-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | SMFT3  | 24,30 | 1.800,00   | 43.740,00      | 24,11            | 24,36       | 24,57        | 7.105,00                |
| 29-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | SMFT3  | 24,52 | 200,00     | 4.904,88       | 24,11            | 24,36       | 24,57        | 7.105,00                |
| 29-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | SMFT3  | 24,33 | 800,00     | 19.460,03      | 24,11            | 24,36       | 24,57        | 7.105,00                |
| 29-02-24 | FIA RVA EMB III | Compra        | SMFT3  | 24,31 | 3.000,00   | 72.923,98      | 24,11            | 24,36       | 24,57        | 7.105,00                |
| 29-02-24 | FIA RVA EMB III | Venda         | SUZB3  | 56,81 | 4.000,00   | 227.225,94     | 56,24            | 56,67       | 57,80        | 24.247,00               |
| 29-02-24 | FIA RVA EMB IV  | Compra        | ENGI11 | 49,99 | 1.522,00   | 76.082,29      | 49,72            | 50,54       | 50,84        | 8.440,00                |
| 29-02-24 | FIA RVA EMB IV  | Venda         | GMAT3  | 7,91  | 3.314,00   | 26.227,72      | 7,85             | 7,96        | 8,07         | 5.520,00                |
| 29-02-24 | FIA RVA EMB IV  | Venda         | GMAT3  | 7,89  | 7.768,00   | 61.290,14      | 7,85             | 7,96        | 8,07         | 5.520,00                |

## 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.