



# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO

Dezembro/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 - DEZEMBRO 2024



Data: 31/12/2024

## Relatório de Risco de Mercado

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

Dados Gerais		Limite Fundo:		0,00%		Dutacion DC:	
PL:	4.965.242.070,57	VAR / PL:	1,8200%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	2.148,67
VAR:	90.367.619,52	ETL / PL:	2,2824%	Benchmark:			1.473,38
ETL:	113.324.640,64	VAR / CDI:	0,0202%				

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	123.667.764,43	Cenário Baixa - 10000 (-):	140.297.854,32	CENARIO BRADESCO 1 (+):	316.858.830,95	CENARIO BRADESCO 2 (+):	656.943.299,05
Cenário Alta - 09999 (-):	-181.333.895,92	Cenário Baixa - 10000 (-):	-118.080.969,98	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-70.251.186,76	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-924.920.910,82
Cenário Alta - 09999:	-57.666.131,49	Cenário Baixa - 10000:	22.216.884,34	CENARIO BRADESCO 1:	246.607.644,19	CENARIO BRADESCO 2:	-267.977.611,77

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
17H0164854	5.816.313,29	124.300,78	83.285,67	0,09%	0,00	0,00	0,00	0,00
AEGP23	7.612.181,30	54.950,30	43.312,50	0,05%	-113.949,38	77.515,68	88.591,66	-117.404,22
CMDDT33	750.183,12	1.884,68	1.046,11	0,00%	713.652,76	-1.529.255,92	747.296,39	-753.413,42
CSMG33	5.677.343,17	20.369,52	15.817,61	0,02%	-21.351,16	97.924,91	39.260,38	-52.955,68
ELE142	14.193.973,49	394.244,01	346.936,13	0,38%	-3.672,05	3.010,37	6.929,08	-9.437,96
ENJG21	1.131.684,34	26.230,48	16.857,50	0,02%	1.426.762,81	-1.426.762,81	418.326,86	-421.751,09
ENMR21	756.515,93	17.662,29	11.323,15	0,01%	0,00	0,00	736.402,13	-742.429,98
ENTV12	29.454.198,81	877.585,13	808.915,83	0,90%	321.957,34	-321.857,34	188.737,14	-190.282,06
ERDV17_VENCIMENTO	6.677.865,10	40.896,26	31.868,38	0,04%	0,00	0,00	0,00	0,00
GASP17	62.463.929,75	573.641,94	-67.005,08	-0,07%	-206.136,17	-17.620,50	97.676,99	-125.145,89
GRRB24_VENCIMENTO	15.897.116,24	440.042,01	395.339,96	0,44%	-145,48	117,66	282,22	-404,79
IGSN15	2.489.362,01	83.371,45	79.073,82	0,09%	-488,16	398,39	977,57	-1.412,11
LFSN16000GM	16.228.669,35	37.284,15	989,11	0,00%	-211.465,74	-21.473,41	98.527,79	-125.597,18
LFSN18000DC5	5.207.913,22	41.005,33	33.192,07	0,04%	392.476,31	-364.442,29	205.489,38	-207.171,42
NEOIE16	7.354.522,59	205.300,73	183.235,94	0,20%	-320.843,67	30.263,05	209.981,06	-248.580,46
NTNB20260815 - 760199_VENCIMENTO	43.575.802,08	555.433,04	467.679,63	0,52%	147.830,63	-152.763,93	72.239,90	-72.831,22
NTNB20300815 - 760199_VENCIMENTO	25.586.405,54	552.532,28	533.069,19	0,59%	13.294,12	-4.754,90	3.248,20	-3.274,78
NTNB20350515 - 760199_VENCIMENTO	217.155.671,19	6.762.831,95	6.698.810,70	7,41%	0,00	0,00	0,00	0,00
NTNB20400815 - 760199_VENCIMENTO	27.298.279,03	997.929,49	975.635,17	1,08%	751.848,12	-751.848,12	440.883,74	-444.492,61
NTNB20450515 - 760199_VENCIMENTO	200.181.935,09	8.223.497,34	7.960.829,19	8,81%	-219.801,30	13.296,06	138.583,91	-165.025,41
NTNB20500815 - 760199_VENCIMENTO	631.611.249,83	30.341.249,83	29.868.989,20	33,05%	2.150.253,84	-2.150.253,84	1.280.908,85	-1.271.220,07
NTNB20550515 - 760199_VENCIMENTO	193.683.192,76	10.423.966,02	10.308.866,86	11,41%	125.748,84	-125.748,84	73.733,12	-74.342,71
DMG3E1	13.118.823,28	242.597,57	144.854,22	0,16%	678.378,37	-678.378,37	397.801,08	-401.057,29
SBSPC2	9.175.214,16	23.050,81	12.794,54	0,01%	517.554,98	-517.562,14	379.373,05	-382.478,42
020913	461.407,59	42.121,71	2.680,89	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ABEV3	5.097.519,74	429.265,96	-71.872,93	-0,08%	-2,43	2,49	7,48	-11,29
AEGP11	1.893.786,51	2.032,56	1.898,93	0,00%	-51,02	48,85	134,46	-201,93
AIEC11	2.853.525,62	316.825,56	-195.162,84	-0,22%	17.041,32	-17.041,32	9.993,03	-10.074,83
ALOS3	5.023.206,92	595.352,43	469.815,82	0,52%	3.607.207,88	-3.607.207,88	928.816,68	-533.145,33
ALPA4	1.287.429,36	138.401,77	13.948,61	0,02%	1.952.883,84	-2.278.364,48	554.309,24	-962.120,77
AMOB3	10.317,30	37.537,25	-35.430,99	-0,04%	4.747.580,16	-4.747.580,16	695.995,25	-701.692,35
APPSA2	2.252.668,04	72.838,55	69.917,50	0,08%	50.195,95	-50.195,95	29.434,91	-29.675,85
APRB28	886.295,32	81,94	75,30	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ARTR11	2.602.928,77	275,16	253,72	0,00%	6.483,36	-6.483,36	3.055,62	-3.895,54
ASAB11	2.347.975,61	76.883,98	72.880,22	0,08%	275.973,86	-275.973,86	161.931,07	-163.155,75
ASA3	1.401.701,10	261.682,51	198.728,47	0,22%	37.545,26	-20.479,23	10.007,52	-10.089,43
ASER12	2.283.434,22	120.075,46	117.771,09	0,13%	-588.398,29	-33.874,92	306.891,69	-382.832,42
AURE3	492.768,76	46.624,83	39.268,71	0,04%	-2.052,85	1.660,07	3.996,86	-5.719,53
AZUL4	22.156,86	7.542,57	6.214,15	0,01%	-94,75	83,37	222,18	-330,52
AZZA3	3.083.626,26	677.333,87	616.681,86	0,68%	-230.792,27	-1.031,89	111.823,49	-146.563,28
B3SA3	3.007.392,48	423.832,93	-317.902,98	-0,35%	0,00	0,00	0,00	0,00
BARU11	1.428.216,56	80.021,57	78.684,27	0,09%	-543.929,03	15.025,76	303.803,83	-381.481,24
BBAS3	8.601.015,35	239.176,18	27.184,72	0,03%	-191.531,42	158.290,63	346.620,37	-449.192,33
BBD3C	502.995,36	37.683,75	13.763,10	0,02%	8.088,96	-8.088,96	2.371,68	-2.391,10
BBD4C	2.713.513,48	290.612,63	185.047,00	0,20%	28.765,85	-28.765,85	16.868,29	-17.006,37
BBSE3	2.597.810,68	278.437,61	-232.873,75	-0,26%	0,00	0,00	0,00	0,00
BISTOPIND	252.975.746,22	6.176.636,36	6.114.405,66	6,77%	-1.653,90	847,24	2.009,60	-2.852,36
BCBF11	87.908,64	1,31	1,23	0,00%	-447,17	365,10	898,32	-1.305,82
BCBF15	1.001.672,76	29,63	27,16	0,00%	255.436,35	-255.436,35	74.893,94	-75.506,99
BEF3	68.165,28	10.000,13	-363,01	0,00%	-5.170,82	4.246,83	9.798,86	-13.380,35
BMLC11	3.607.207,88	114.522,94	-21.957,27	-0,02%	-333.397,27	23.487,46	195.309,10	-244.460,03
BPAC11	6.509.612,80	858.469,31	790.398,04	0,87%	-10.612,09	8.902,43	20.044,34	-26.132,06
BPML11	4.747.580,16	443.540,72	226.294,11	0,25%	-6.587,76	-3.769,64	402,98	-546,53
BRAP4	200.783,80	15.063,20	10.798,14	0,01%	355.725,54	-426.883,45	208.597,45	-210.304,94
BRAV3	323.070,72	94.323,30	-34.637,65	-0,04%	85.530,43	-85.530,43	85.825,03	-36.118,28
BRCR11	24.936,00	1.034,12	130,05	0,00%	97.892,30	-97.892,30	28.702,02	-28.936,96
BRFS3	1.103.895,44	132.401,02	-51.142,79	-0,06%	-621.857,85	62.588,10	382.846,38	-475.661,84
BRKM5	68.264,10	12.811,80	8.493,53	0,01%	6.702,96	-9.384,14	3.930,61	-3.962,79
BRKP28	4.862.473,91	219.575,95	212.445,36	0,24%	0,00	0,00	0,00	0,00
BRKPA0	2.830.801,41	1.162,59	1.070,67	0,00%	133.132,90	-133.132,90	97.586,41	-98.385,21
CBAC11	1.617.628,21	52,72	48,67	0,00%	960.185,72	-960.185,72	593.851,03	-604.761,14
CAEC21	4.078.788,89	113.923,50	93.270,45	0,10%	1.526.268,81	-1.526.268,81	1.017.063,36	-1.025.388,57
CAKA	57.000,00	0,00	0,00	0,00%	-0,04	0,21	0,21	-0,79
CART13	5.961.534,47	221.938,03	211.363,36	0,23%	-2.948,12	2.457,02	5.552,50	-7.326,80
CBAN22	9.645.370,91	106.125,70	98.970,19	0,11%	0,00	0,00	0,00	0,00
CBOP11	16.177,92	1.805,99	254,95	0,00%	20.594,63	-20.594,63	12.076,69	-12.175,55
CCRO3	115.063,38	12.218,19	10.089,71	0,01%	-167.768,72	10.013,04	90.310,57	-116.558,54
CDB323R5I11	7.042.717,08	0,00	0,00	0,00%	-337.562,46	31.355,28	216.179,70	-259.778,97
CEAB13	1.559.903,76	590,28	544,45	0,00%	-3.648,87	3.064,52	6.873,28	-8.921,41
CEEB3	1.877.973,80	254,35	232,84	0,00%	28.988,40	-28.988,40	16.998,80	-17.137,94
CEOC11	510.872,70	25.282,71	11.862,65	0,01%	-182.360,47	-9.060,86	86.294,49	-112.108,61
CGBP13	4.290.234,60	2.867,67	2.677,07	0,00%	-295.034,04	-11.179,53	151.849,49	-192.091,41
CJEN13	3.830.963,41	142.393,93	135.058,40	0,15%	-16.836,55	29.604,14	13.777,29	-18.580,19
CL112	2.448.797,94	5.773,84	5.434,54	0,01%	83.256,84	-62.446,74	30.514,49	-30.764,27
CM64	1.422.902,14	98.019,21	83.540,65	0,08%	5.338,53	-5.338,53	1.565,26	-1.578,07
CMN3	244.372,65	35.118,82	-5.993,94	-0,01%	123.919,35	-123.923,70	90.837,07	-91.579,61
CNES11	195.784,80	17.872,60	-7.310,00	-0,01%	28.177,68	-25.536,02	12.908,90	-13.014,57
CNRD11	6.525.367,12	271.656,56	259.026,30	0,29%	-76.476,86	85.748,77	43.815,32	-43.852,56
COGN3	26.811,82	7.228,16	6.103,07	0,01%	-938.761,81	883.713,23	1.128.176,07	-1.100.326,55
CONTAS_A PAGAR_RECEBER	4.391.788,48	0,00	0,00	0,00%	-357.574,76	326.749,47	454.855,83	-432.169,19
CPFE3	665.664,48	25.720,45	17.299,96	0,02%	107.457,03	-101.272,08	-148.911,41	131.364,30
CPLE3	4.091.753,28	231.394,34	-48.861,94	-0,05%	-636.971,48	618.378,01	678.989,76	-668.987,99
CPLE6	6.937.676,40	368.105,20	15.195,47	0,02%	-1.957.936,49	1.822.427,00	2.460.166,32	-2.359.456,99
CPMF25C101000	201,95	312,95	-210,49	0,00%	296.477,58	-269.044,26	-380.904,85	356.526,96
CPT1E2	1.846.858,24	1.609,32	1.512,01	0,00%	336.485,05	-312.011,72	-448.897,96	409.561,42
CPUR11	6.011.743,50	426.308,63	202.701,57	0,22%	-8.825,30	7.509,15	16.694,69	-21.116,68

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO - DEZEMBRO 2024

## Relatório de Risco de Mercado



Data: 31/12/2024

FUNDO: EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS  
 CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais		Limite Fundo:		0,00%		Dutacion DC:	
PL:	4.965.242.070,57	VAR / PL:	1,8200%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	2.148,67
VAR:	90.367.619,52	ETL / PL:	2,2824%	Benchmark:			1.473,38
ETL:	113.324.640,64	VAR / CDI:	0,0202%				

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	123.667.764,43	Cenário Baixa - 10000 (-):	140.297.854,32	CENARIO BRADESCO 1 (+):	316.858.830,95	CENARIO BRADESCO 2 (+):	656.943.239,05
Cenário Alta - 09999 (-):	-181.333.895,92	Cenário Baixa - 10000 (-):	-118.008.969,98	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-70.251.186,76	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-924.920.910,82
Cenário Alta - 09999:	-57.666.131,49	Cenário Baixa - 10000:	22.216.884,34	CENARIO BRADESCO 1:	246.607.644,19	CENARIO BRADESCO 2:	-267.977.611,77

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
CRFB3	82.378,53	8.969,81	3.522,72	0,00%	428,53	-437,03	-1.768,91	2.692,32
CRMG15	2.726.470,21	74.544,29	67.343,40	0,07%	20.016,27	-16.920,39	-39.130,25	56.853,33
CRTR12	2.702.833,38	131.313,58	128.236,19	0,14%	394.635,84	-326.509,70	-741.548,73	1.026.561,46
CSAN23	1.129.318,24	1.982,54	1.867,58	0,00%	-357.705,40	303.257,28	668.714,63	-883.474,13
CSAN3	115.953,60	21.976,41	18.262,67	0,02%	57.113,34	-49.264,47	-107.623,97	135.959,07
CSMG88	2.656.110,90	76.902,49	67.458,16	0,07%	32.364,90	-28.966,17	-62.425,84	72.265,42
CSMG89	3.147.096,03	112.408,76	107.606,26	0,12%	141.205,16	-130.470,40	-281.539,86	299.297,61
CSNA3	208.147,98	44.249,80	36.240,71	0,04%	-137.468,11	208.596,65	516.332,89	-778.180,82
CVCB3	10.677,06	6.332,31	6.060,53	0,01%	813.191,88	-677.181,69	-1.575.623,86	2.234.380,72
CXSE3	619.618,50	64.023,64	-16.491,37	-0,02%	296.058,00	-296.058,00	144.673,68	-145.857,91
CYRE3	88.055,25	14.669,14	10.423,20	0,01%	-696.642,77	692.584,42	-896.073,71	900.569,83
DAPK25	-2.781,61	51.234,77	33.870,88	0,04%	28.620,81	-28.620,81	23.310,06	-23.500,87
DAPK27	-6.544,65	638.903,56	555.685,26	0,61%	-274,97	233,97	593,34	-877,15
DAPK29	-1.438,83	191.629,19	179.935,84	0,20%	-6.248,98	2.134,95	4.976,65	-6.900,09
DAPK35	201,01	45.333,74	-43.383,36	-0,05%	3.593.877,22	-3.049.590,10	1.583.324,27	-1.596.284,63
DAPQ26	-5.806,42	438.213,26	366.098,54	0,41%	-1.068.671,49	-190.541,13	418.290,83	-547.235,42
DAPQ28	-9.304,82	1.190.341,29	1.093.131,35	1,21%	74.502,46	-54.733,62	30.127,63	-30.374,24
DAPQ30	953,09	133.799,20	-128.226,66	-0,14%	291.696,34	-291.696,34	171.050,73	-172.450,88
DAPQ32	824,08	144.731,88	-139.618,61	-0,15%	858.139,40	-1.162.840,80	340.008,75	-342.791,90
DASAC5	1.946.584,96	4.739,77	4.476,74	0,00%	-23.200,97	701,30	13.465,16	-16.716,32
DHF25	-6,80	425,91	-349,44	0,00%	2.619.630,26	-3.390.109,75	2.259.045,86	-2.277.537,37
DHF26	1.010,12	11.768,22	-10.544,36	-0,10%	10,64	-10,64	1,95	-1,97
DHF27	33.311,36	227.947,38	-208.940,33	-0,23%	-22.075,64	16.804,44	17.760,19	-23.564,31
DHF28	-33.053,18	201.849,85	187.462,80	0,21%	-14.891,48	11.217,32	11.937,13	-15.837,50
DHF29	5.414,52	31.613,02	-29.711,44	-0,03%	-2.230.687,23	-96.350,84	1.083.579,97	-1.400.604,19
DHF31	2.683,96	15.925,30	-15.928,25	-0,02%	4.778.072,28	-4.778.072,28	3.502.326,98	-3.530.995,42
DHF33	10.094,60	70.338,43	-66.339,91	-0,07%	-12.676,94	52.401,34	18.962,39	-25.614,66
DHF25	-27.016,66	107.308,85	93.657,01	0,10%	-17.456,00	72.156,06	26.111,00	-35.271,10
DHF26	64.433,02	488.553,48	-445.620,24	-0,49%	-25.470,39	98.584,85	50.559,07	-67.472,34
DIRR3	986.860,00	126.909,80	103.360,06	0,11%	11.488,46	-17.232,70	8.421,04	-8.489,98
DOLG25	8.072,04	326.886,66	181.768,08	0,20%	308.054,88	-308.054,88	90.321,69	-91.061,02
EGIE3	159.004,50	5.565,77	1.834,94	0,00%	290.092,79	-290.092,79	212.638,02	-214.378,58
ELET13	2.028.539,21	156,22	141,93	0,00%	1.599,04	-799,52	117,21	-118,17
ELET24	2.706.410,63	1.462,86	1.360,49	0,00%	221.656,40	-221.656,40	64.989,66	-65.521,63
ELET3	10.800.301,98	733.945,27	-462.807,19	-0,51%	0,00	0,00	204.752,92	-206.428,93
ELET6	205.509,04	11.626,18	-7.050,52	-0,01%	-2.618.766,73	45.613,01	1.208.171,81	-1.598.407,30
EMBR3	1.166.785,35	144.138,81	102.874,62	0,11%	-458.146,50	31.947,19	292.356,73	-345.646,65
ENEV3	2.319.295,68	211.728,53	208.490,07	0,03%	591.354,93	-591.354,93	346.770,53	-349.609,04
ENEVA0	205.181,84	9.401,21	9.407,40	0,01%	2.436.768,52	-2.436.768,52	793.845,03	-800.343,08
ENGH1	15.409.589,76	900.667,48	753.684,85	0,83%	942.287,55	-837.588,93	767.440,86	-773.722,78
ENGM4	13,30	0,62	0,36	0,00%	75.242,18	-62.701,81	36.768,34	-37.069,31
EQLT3	23.890.361,40	2.592.082,24	2.423.479,05	2,68%	-53,51	43,62	107,88	-158,15
ERDV17	4.849.614,03	29.699,78	23.143,53	0,03%	-617.795,20	-85.623,99	257.794,14	-336.812,78
ERDV38	6.005.791,72	81.205,97	51.949,42	0,06%	-1.170.760,05	-162.262,74	488.535,80	-638.281,00
EZTC3	57.442,32	14.031,74	12.045,58	0,01%	-352,53	286,92	694,42	-998,74
FIGS11	616.109,76	31.722,19	21.197,79	0,02%	-822,19	673,92	1.549,47	-2.112,72
FLRY3	1.450.463,97	77.193,36	27.787,75	0,03%	3.003.130,12	-3.003.526,20	1.294.879,05	-1.306.478,33
FMOF11	799,57	118,89	41,39	0,00%	0,00	0,00	72.325,17	-72.918,20
FVPO11	443.312,80	46.536,66	5.014,51	0,01%	4.884.740,02	-4.884.740,02	716.102,89	-721.964,58
GARE11	1.336.677,50	128.072,08	89.455,95	0,10%	-340.865,96	12.475,95	194.530,00	-232.325,44
GBSP11	3.370.035,60	166.667,13	163.492,41	0,18%	81.086,05	-64.712,91	47.863,19	-48.254,97
GGBR4	2.365.419,72	328.758,78	249.485,61	0,28%	-194.277,72	12.604,88	113.017,38	-141.649,65
GGPS3	5.415.041,16	898.300,34	822.728,33	0,91%	0,00	0,00	0,00	155.672.780,74
GMAT3	5.234.930,82	334.552,81	185.089,32	0,20%	0,00	0,00	0,00	-155.933.815,65
GOAU4	250.807,25	31.516,65	19.853,58	0,02%	0,00	0,00	0,00	-61.674.087,91
GRRB14	1.092.723,99	29,29	26,67	0,00%	0,00	0,00	0,00	61.773.824,83
GRRB24	8.388.706,29	232.204,58	208.615,87	0,23%	-1.763,90	2.095,39	-8.634,75	24.598.825,32
GUAR15	1.036.956,43	199,67	183,50	0,00%	7.933,87	-8.429,13	68.884,55	-49.224.985,65
HAPV22	570.279,09	456,45	425,94	0,00%	-4.659,03	4.768,04	-71.913,51	24.614.496,63
HAPV3	8.832.735,64	1.346.681,44	791.744,00	0,88%	-0,81	1.358,46	-0,81	51.429.320,84
HOFV11	493.857,26	51.860,21	9.326,40	0,01%	3,48	-4.432,56	3,48	-103.038.293,77
HSRE11	4.884.740,02	304.530,50	-242.638,14	-0,27%	3.533,79	-3,66	0,00	51.608.971,94
HVRD15	3.451.989,11	140.256,53	133.549,06	0,15%	-70.063,17	296.491,48	-71.981,79	19.207.613,27
HYPE3	326.488,87	37.876,33	-13.929,62	-0,02%	85.424,58	-311.901,08	88.348,74	-19.223.457,49
HZTC14	2.247.086,87	82.598,35	78.380,34	0,09%	3.802.854,06	-2.576.269,86	65.349.928,77	-2.752.340,29
IDIF25P419600	0,00	0,00	0,00	0,00%	-3.803.335,14	2.494.813,41	-65.347.695,77	2.641.076,27
IDIF25P419700	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,02	0,00	35.052.955,74
IDIF25P421800	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	-0,04	0,00	-35.124.061,49
IDIF25P421900	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	-0,07	0,00	-35.195.167,23
IDIF25P422300	8.634,75	10.196,81	-1.633,32	0,00%	0,00	0,12	0,00	35.266.272,98
IDIF25P422400	-68.884,55	43.373,99	6.947,62	0,01%	0,00	2.722,13	0,00	37.682.721,20
IDIF25P422500	71.913,51	24.973,85	-4.000,30	0,00%	0,00	-3.761,83	0,00	-37.755.472,06
IDU25P432500	0,81	3,88	3,61	0,00%	-0,01	7.714,29	-0,01	56.742.334,39
IDU25P432600	-3,48	16,24	-15,08	0,00%	0,03	-27.816,34	0,03	-151.556.280,85
IDU25P432700	3,66	16,54	15,36	0,00%	0,04	23.275,90	-0,04	94.934.311,61
IDU25P435100	71.981,79	94.849,83	88.058,77	0,10%	-205.668,78	2.330,42	111.803,17	-141.032,29
IDU25P435200	-88.348,74	108.052,75	-100.316,39	-0,11%	1.318.854,64	-1.318.854,64	966.720,45	-974.633,58
IDIN25C447900	2.752.340,29	2.094.591,80	-1.897.503,01	-2,10%	-2.510,86	148,26	1.427,02	-1.797,37
IDIN25C448000	-2.641.076,27	2.092.697,63	1.895.787,08	2,10%	-181.276,61	210.634,21	180.308,15	-239.586,36
IDIN25P442900	0,00	0,00	0,00	0,00%	51.432,42	-43.519,74	11.599,99	-11.694,94
IDIN25P443000	0,00	0,00	0,00	0,00%	-418.822,03	37.317,00	271.327,90	-322.531,05
IDIN25P443100	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
IDIN25P443200	0,00	0,00	0,00	0,00%	1.654.249,11	-1.654.249,11	1.276.383,79	-1.286.831,68
IDIN25P445400	0,00	0,01	0,01	0,00%	3.340.203,50	-3.173.193,32	2.448.369,16	-2.468.410,38
IDIN25P445500	0,00	0,03	-0,03	0,00%	-67.603,10	2.679,84	39.688,23	-49.218,06
IDIN25P445600	0,01	0,08	0,07	0,00%	1.164.896,04	-1.164.896,04	487.925,03	-491.918,96

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO - DEZEMBRO 2024



Data: 31/12/2024

## Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS  
 CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais		Limite Fundo:		0,00%		Dutacion DC:	
PL:	4.965.242.070,57	VAR / PL:	1,8200%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	2.148,67
VAR:	90.367.619,52	ETL / PL:	2,2824%	Benchmark:			1.473,38
ETL:	113.324.640,64	VAR / CDI:	0,0202%				

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	123.667.764,43	Cenário Baixa - 10000 (-):	140.297.854,32	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	316.858.830,95	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	656.943.239,05
Cenário Alta - 09999 (-):	-181.333.895,92	Cenário Baixa - 10000 (-):	-118.080.969,98	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	-70.251.186,76	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	-924.920.910,82
Cenário Alta - 09999:	-57.666.131,49	Cenário Baixa - 10000:	22.216.884,34	CENÁRIO BRADESCO 1:	246.607.644,19	CENÁRIO BRADESCO 2:	-267.977.611,77

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
IDIN25P445700	-0,03	0,39	-0,36	0,00%	-295,027,23	-23,189,79	142,163,19	-181,555,64
IDIN25P445800	0,04	0,45	0,41	0,00%	23,027,57	-23,027,57	12,984,01	-13,090,29
IGTI11	6.594.273,18	633.696,57	507.269,15	0,56%	221.270,00	-177.016,00	129.752,73	-130.814,82
IPILL11	31.875,82	1.074,00	1.009,79	0,00%	-1.685,08	1.362,66	3.280,81	-4.694,87
IRBR12	11.128.463,09	256.743,32	160.940,21	0,18%	-1.665.552,50	-137.413,07	801.037,23	-1.022.308,05
IRBR3	79.126,80	7.783,37	-5.130,79	-0,11%	-322.045,07	-8.359,32	158.512,71	-206.606,21
IRJ514	3.019.844,21	157.612,36	154.401,84	0,17%	0,00	0,00	0,00	0,00
ISA4	496.647,84	25.820,16	19.364,86	0,02%	0,00	0,00	0,00	0,00
ITSA4	8.706.574,26	676.049,97	432.568,88	0,48%	0,00	0,00	0,00	0,00
ITUB4	16.701.017,48	1.086.630,39	786.092,59	0,87%	0,00	0,00	0,00	0,00
JALL15	596.228,90	27.615,37	26.660,49	0,03%	0,00	0,00	0,00	0,00
JBS3	3.328.274,40	354.791,15	-111.055,27	-0,12%	0,00	0,00	0,00	0,00
JSMILB5	3.118.132,41	105.485,35	101.408,66	0,11%	0,00	0,00	0,00	0,00
JSRE11	88.567,59	4.019,20	959,05	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
KLBN11	885.080,00	108.242,81	-71.078,71	-0,08%	0,00	0,00	0,00	0,00
LCAMC3	2.976.529,61	954,31	878,86	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LCAMD1	17.122.907,58	590.470,41	568.988,99	0,63%	-272.242,34	218.297,52	503.667,79	-697.383,80
LF001800FAU	4.550.796,35	124.991,84	118.662,49	0,13%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002100HDQ	3.123.110,97	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002200USM	11.250.573,42	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002200USN	11.795.618,26	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306J15	11.697.315,54	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306US5	7.028.683,68	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306Z8P	5.789.454,79	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306ZK1	5.807.777,48	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024000XE	11.250.196,85	0,00	0,00	0,00%	1.054,52	-946,98	-2.444,04	3.730,93
LF0024000XG	11.230.084,35	0,00	0,00	0,00%	1.622,43	-1.452,92	-3.741,28	5.711,41
LF0024000XN	11.205.526,89	0,00	0,00	0,00%	1.156,64	-1.022,55	-2.605,29	3.977,84
LF0024002C7	6.434.724,95	152.294,78	140.799,88	0,16%	-4.327,29	3.486,21	8.292,74	-11.809,03
LF0024002SX	4.818.397,79	0,00	0,00	0,00%	-56.286,42	-22.351,75	5.344,72	-7.250,33
LF0024002TZ	11.191.315,37	0,00	0,00	0,00%	-5.725,20	83.648,79	32.598,43	-43.912,88
LF00240033U	7.167.594,63	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024003QF	11.792.233,12	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024006I2	11.638.153,63	0,00	0,00	0,00%	-822,59	900,25	24,21	-36,87
LF0024007F1	7.221.412,94	0,00	0,00	0,00%	-55.461,36	65.223,74	1.799,69	-2.739,78
LF0024009LF	7.106.663,78	0,00	0,00	0,00%	-46.087,54	61.314,75	1.558,37	-2.372,23
LF002400DDA	3.574.890,67	0,00	0,00	0,00%	-50.434,01	70.389,37	1.661,51	-2.529,09
LFSC190054B	1.016.970,95	0,00	0,00	0,00%	-40.499,42	70.107,39	2.900,41	-4.413,58
LFSC190059S	1.540.421,18	0,00	0,00	0,00%	-929,23	1.717,56	79,29	-120,63
LFSC19005L1	1.019.209,81	0,00	0,00	0,00%	-36.842,31	96.201,24	6.620,52	-10.060,97
LFSC22002X	4.604.914,10	2.451,82	2.258,59	0,00%	-654,17	1.248,55	86,35	-131,16
LFNS210029N	4.920.015,60	0,00	0,00	0,00%	-29.209,36	23.954,70	54.007,73	-72.489,58
LFNS2301ERT	4.780.557,78	0,00	0,00	0,00%	-588,94	489,21	1.216,05	-1.790,35
LFT20250301 - 210100	2.245.381,59	167,66	137,00	0,00%	-554.228,10	4.600,52	299.393,35	-381.617,02
LFT20250901 - 210100	33.801.615,60	9.678,40	8.186,22	0,01%	263.590,19	-233.231,62	179.862,88	-181.335,15
LFT20260301 - 210100	13.688.151,50	5.483,50	4.575,98	0,01%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20260901 - 210100	10.414.412,90	5.841,13	4.823,70	0,01%	-735.012,89	614.652,39	1.427.142,28	-2.023.783,22
LFT20260301 - 210100	7.357.616,51	5.605,90	4.607,95	0,00%	138.098,72	40.617,33	-1.027,48	-51.027,48
LFT20270901 - 210100	142.008,81	138,76	110,71	0,00%	1.358.040,68	-1.358.040,68	765.726,02	-771.993,90
LFT20290301 - 210100	4.528.278,67	5.411,71	4.433,20	0,00%	165.540,65	-165.540,65	80.894,20	-81.556,36
LFT20300301 - 210100	47.101,31	57,75	46,16	0,00%	28.848,30	-24.964,88	8.133,00	-8.199,58
LIGT11	512.367,09	16.162,04	15.088,91	0,02%	-2.686,51	2.204,16	5.070,77	-6.900,89
LMPT17	2.686.092,04	333,46	302,32	0,00%	-58.965,08	-4.685,43	28.401,23	-36.265,63
LORTA7	6.084.599,59	213.860,54	206.551,52	0,23%	844.926,42	-633.694,82	309.665,53	-312.200,31
LRNS3	1.226.895,48	200.955,51	103.928,93	0,12%	-104.460,99	171.773,83	-57.716,48	78.340,70
LRN81	695.916,10	0,00	0,00	0,00%	5.035,47	-5.035,47	2.460,67	-2.480,81
LTN20260701 - 100000	24.633.280,06	450.361,80	413.272,89	0,46%	-367.051,23	-11.875,00	180.343,79	-232.350,41
LWSA3	345.246,80	62.558,57	50.080,54	0,06%	1.737.702,40	-1.448.085,33	849.157,24	-856.108,05
MALL11	5.223.233,40	206.751,54	68.381,00	0,08%	-580.557,77	-114.942,77	221.421,10	-289.471,32
MATD3	551.802,16	60.330,09	54.895,08	0,06%	2.939.033,60	-2.939.033,60	861.724,65	-868.776,33
MGLU3	55.477,90	14.852,71	13.455,92	0,01%	2.076.321,59	-2.076.321,59	304.388,75	-306.880,33
MOVIZ7	1.163.055,79	1.487,34	1.399,67	0,00%	728.328,04	-728.328,04	427.091,56	-430.587,54
MOV37	619.456,37	21.043,11	20.240,53	0,02%	-160.012,31	-2.039,14	76.956,95	-100.292,40
MRF33	2.112.316,05	358.950,54	58.228,55	0,06%	-68.461,14	74.267,49	33.271,03	-45.016,92
MRFMG200	115.774,57	81.551,59	-13.189,36	-0,01%	-763.129,90	764.942,35	717.522,68	-952.673,89
MRVE3	16.784,91	3.690,40	598,68	0,00%	-829.218,62	831.188,04	779.661,72	-1.035.177,54
MTRJ19	5.098.156,87	148.591,70	136.433,54	0,15%	-493.964,11	442.082,16	497.629,04	-654.310,38
MULT3	5.792.341,32	767.599,60	706.746,38	0,78%	-929.321,36	993.911,59	1.086.918,68	-1.405.740,70
NEWU11	5.878.067,20	303.458,23	98.616,67	0,11%	-64.778,54	52.318,15	66.674,27	-85.575,28
NEWU11	2.076.321,59	265.398,93	-176.916,67	-0,20%	-1.295.465,88	1.093.206,47	1.383.486,72	-1.751.726,42
NTCO3	2.913.312,16	328.113,61	253.309,17	0,28%	-16.177.152,49	15.329.191,31	19.279.191,31	-23.224.122,00
NTEN11	2.814.257,15	70.359,49	61.614,69	0,07%	-3.008.304,76	1.933.270,89	3.046.656,07	-3.524.338,45
NTNB20250515 - 760199 - NEGOCIACAO	13.217.426,15	53.903,00	46.492,20	0,05%	-23.366.357,50	18.868.887,62	26.561.130,41	-29.570.004,36
NTNB20260815 - 760199 - NEGOCIACAO	40.102.810,65	511.165,03	430.405,57	0,48%	-207.367,63	182.526,97	250.264,30	-268.949,25
NTNB20270515 - 760199 - NEGOCIACAO	19.146.328,90	320.892,45	280.345,91	0,01%	-75.834.837,11	66.898.566,89	91.642.937,08	-96.485.078,17
NTNB20280815 - 760199 - NEGOCIACAO	28.331.612,79	586.238,32	539.181,90	0,60%	-24.895.738,79	21.745.744,82	30.358.694,83	-31.844.278,71
NTNB20290515 - 760199 - NEGOCIACAO	1.489.141,75	31.839,07	29.852,00	0,03%	-13.790,70	11.904,28	28.308,82	-32.205,79
NTNB20250815 - 760199 - NEGOCIACAO	1.724.843,76	82.858,16	81.562,60	0,09%	-4.977,79	4.074,38	9.425,47	-12.921,35
NTSD36	2.894.464,24	7.271,86	6.879,85	0,01%	-89.021,97	236.308,46	140.724,50	-187.554,72
OMGE13	4.087.587,45	2.762,03	2.576,97	0,00%	532.970,88	-532.970,88	156.267,06	-157.546,19
OULG11	1.065.941,76	45.059,97	28.333,98	0,03%	0,00	0,00	0,00	0,00
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-231,93	189,53	464,19	-681,30
OVSA10	1.742.718,31	129,32	117,11	0,00%	-1.618,49	1.327,57	3.039,67	-4.131,09
OVSA48	664.080,70	896,97	837,30	0,00%	-209,65	4,31	104,35	-135,94
PASN12	4.233,72	95,89	83,25	0,00%	2.099.928,06	-2.099.928,06	615.698,91	-620.738,74
PATC11	4.199.856,12	315.718,14	-133.342,63	-0,15%	8.487,90	-8.487,90	3.437,37	-3.465,50

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2024



Data: 31/12/2024

## Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: EMBRAERPREV - CONSOL FUNDOS  
 CNPJ: 10679245000140

Dados Gerais		Limite Fundo:		ENQUADRADO		0,00% Dutation DC:		2,148,67	
PL:	4.965.242.070,57	VAR / PL:	1,8200%	Status:		Dutation DC:			
VAR:	90.367.619,52	ETL / PL:	2,2824%	Benchmark:		Dutation DU:			1.473,38
ETL:	113.324.640,64	VAR / CDI:	0,0202%						

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	123.667.764,43	Cenário Baixa - 10000 (+):	140.297.854,32	CENARIO BRADESCO 1 (+):	316.858.830,95	CENARIO BRADESCO 2 (+):	656.943.239,05
Cenário Alta - 09999 (-):	-181.333.895,92	Cenário Baixa - 10000 (-):	-118.080.969,98	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-70.251.186,76	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-924.920.910,82
Cenário Alta - 09999:	-57.666.131,49	Cenário Baixa - 10000:	22.216.884,34	CENARIO BRADESCO 1:	246.607.644,19	CENARIO BRADESCO 2:	-267.977.611,77

Parâmetros do Cálculo			
Modelo:	Volatilidade:	EWMA	
Int. Confiança:	Lâmbda:	0,94	
Horizonte:			

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
PCAR3	23.447,25	3.965,16	511,63	0,00%	690.847,45	-829.016,94	405.112,94	-408.429,01
PETR3	2.763.389,79	271.265,21	50.239,94	0,06%	3.913.116,13	-4.695.782,61	2.294.651,30	-2.313.434,26
PETR4	15.652.464,52	1.473.409,47	201.459,16	0,22%	12.513,54	-16.794,49	4.827,59	-4.867,11
PETZ3	32.930,37	5.171,35	2.029,00	0,00%	8.715.593,77	-5.426.690,46	2.410.766,13	-2.430.499,55
PRIO3	16.444.516,55	1.337.877,93	-725.150,46	-0,80%	2.481.109,09	-2.481.109,09	727.461,18	-733.415,85
QAQR11	4.962.218,17	66.148,82	8.923,07	0,01%	353.971,20	-353.971,20	259.460,69	-261.584,72
RADL3	1.769.856,00	198.467,22	154.972,82	0,17%	-890.927,36	97.792,52	569.899,60	-682.111,29
RAHD11	8.533.087,77	361.092,07	349.215,51	0,39%	6.045.260,62	-4.433.266,42	1.969.411,57	-1.965.532,27
RAIL3	13.433.912,48	1.301.335,55	1.027.681,55	1,14%	20.799,83	-20.799,83	8.712,16	-8.783,47
RAIZ4	59.428,08	7.367,87	4.550,47	0,01%	0,00	0,00	0,00	0,00
RBCAPMZ	462.808,34	8.503,92	1.715,07	0,00%	898.825,28	-898.825,28	263.535,57	-265.692,75
RBRP11	1.797.650,55	125.476,94	37.954,83	0,04%	0,00	0,00	0,00	0,00
RRCR11	5.102.662,51	494.425,68	198.409,98	0,22%	-772,25	630,97	1.538,18	-2.233,06
RDCO10	2.460.934,28	437,00	400,21	0,00%	982.678,73	-982.678,73	480.202,34	-484.133,06
RDR03	3.275.595,78	192.703,53	129.213,34	0,14%	-3.468,73	2.913,35	6.534,73	-8.479,65
RDR09	1.120.293,07	1.884,48	1.775,31	0,00%	-4.960,29	4.166,09	9.344,66	-12.125,90
RDORC9	1.602.019,09	2.694,80	2.538,69	0,00%	-253.488,70	30.637,46	158.210,79	-195.733,28
RDVE11	2.975.735,48	110.103,02	105.134,60	0,12%	186.748,93	-186.748,93	45.628,99	-46.002,49
RECV3	311.248,21	29.252,54	11.151,51	0,01%	3.981.700,34	-3.137.097,24	1.768.840,21	-1.783.319,12
RENT3	12.065.758,60	3.419.905,37	2.832.947,71	3,13%	-265.733,04	-12.880,90	136.665,52	-172.279,83
RIS412	2.629.514,45	98.883,59	95.887,69	0,11%	-997.109,95	93.333,10	646.658,32	-770.083,08
RMSA12	7.445.653,04	380.440,15	372.392,48	0,41%	-13.077,10	10.880,73	24.611,23	-32.594,19
RODB11	2.765.697,14	7.179,97	6.742,71	0,01%	-105,82	91,21	237,32	-352,83
RSAN24	1.864.102,69	58,40	53,67	0,00%	43.004,63	-43.004,63	31.522,39	-31.780,42
SANB11	215.023,14	10.980,99	1.548,49	0,00%	698.252,97	-698.252,97	204.727,77	-206.403,58
SARE11	1.196.505,94	72.354,03	-16.182,19	-0,02%	2.106.034,50	-2.106.034,50	1.234.978,63	-1.245.087,60
SBSPC7	8.424.138,00	854.316,13	758.649,86	0,84%	-80.572,53	-46.105,11	4.928,74	-6.684,42
SBSPC3	2.316.265,51	1.098,93	1.014,92	0,00%	-1.957,12	1.580,20	3.737,19	-5.286,63
SCAR3	118.160,00	8.537,37	-1.719,41	0,00%	70.896,00	-70.896,00	17.322,26	-17.464,05
SLCE3	44.747,50	4.109,47	-2.230,04	0,00%	13.424,25	-13.424,25	6.559,98	-6.613,68
SMFT1	7.018,96	36.060,94	-34.029,02	-0,04%	0,00	0,00	0,00	0,00
SMFT3	4.686.048,00	461.358,40	151.551,57	0,17%	1.874.419,20	-1.874.419,20	686.974,64	-692.597,89
SMFT03	26.097,72	1.807,42	-268,11	0,00%	7.829,32	-7.829,32	3.825,93	-3.857,24
SNCO18	766.278,73	17,74	16,33	0,00%	-32,23	28,88	77,16	-115,17
SRIA13	436.150,00	68.292,06	34.084,03	0,04%	0,00	0,00	63.939,59	-64.462,97
STBP3	586.425,19	48.081,88	-13.809,10	-0,02%	207.660,62	-204.087,58	85.969,93	-86.673,64
SUZB3	11.534.511,34	606.223,36	-33.456,87	-0,04%	2.883.627,84	-2.306.902,27	1.690.959,36	-1.704.800,78
TAE11	237.972,12	9.072,72	6.980,97	0,01%	59.493,03	-59.493,03	34.886,71	-35.172,28
TBSP11	2.334.646,63	862,20	799,40	0,00%	-1.544,93	1.256,14	2.966,10	-4.168,45
TCH11	3.960.274,76	167.322,78	162.468,82	0,18%	-427.798,25	37.305,45	268.611,65	-324.324,80
TIMS3	1.154.142,88	71.236,48	45.446,92	0,05%	369.325,72	-265.452,86	169.197,35	-170.582,32
TOTS3	904.096,50	111.840,09	55.142,14	0,06%	180.819,30	-180.819,30	132.540,55	-133.625,46
UGPA3	9.075.848,76	896.674,66	372.289,38	0,41%	2.268.962,19	-1.815.169,75	1.330.519,43	-1.341.410,45
UNEG11	7.079.115,63	341.923,73	332.568,54	0,37%	-797.635,76	141.998,06	551.164,12	-665.353,20
USIM5	77.203,84	11.473,32	9.742,16	0,01%	30.109,50	-16.984,85	11.318,08	-11.410,73
VALE3	17.211.288,70	1.329.070,18	588.023,44	0,65%	4.302.822,18	-4.302.822,18	2.523.174,92	-2.543.828,47
VAMO22	725.805,31	58,78	54,18	0,00%	-106,06	87,28	220,52	-322,90
VAMO3	63.213,00	9.795,10	5.111,28	0,01%	22.124,55	-25.285,20	9.267,03	-9.342,88
VAMO33	2.653.714,17	89.411,28	86.052,59	0,10%	-263.982,21	-31.458,99	120.035,25	-153.584,62
VAMO34	768.842,69	26.557,19	25.555,14	0,03%	-74.480,75	-6.129,76	35.828,39	-45.727,13
VBBR3	3.595.063,28	366.956,27	343.493,95	0,38%	898.765,82	-898.765,82	527.036,28	-531.350,35
VECS11	3.616.152,86	8,74	6,90	0,00%	-17,85	16,69	53,34	-80,39
VERDECS2	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
VERO12	3.372.380,02	93.603,81	82.986,82	0,09%	-229.416,78	-16.419,25	105.105,39	-136.748,98
VIMT13	565.448,90	23.201,90	22.340,71	0,02%	-55.335,09	5.010,41	33.765,38	-41.823,07
VIVA3	25.814,25	3.490,75	2.738,59	0,00%	7.744,28	-7.744,28	3.784,37	-3.815,35
VIVT3	2.157.546,87	117.685,87	68.321,16	0,08%	357.049,33	-298.928,88	316.296,37	-318.885,43
VIXL18	2.316.580,90	2.919,79	2.736,13	0,00%	-5.303,26	4.389,03	9.958,44	-13.304,54
VSHO11	24.620,96	1.159,82	455,80	0,00%	12.310,48	-12.310,48	3.609,43	-3.638,98
VVMR11	3.991.110,50	204.279,63	-9.593,02	-0,01%	0,00	0,00	585.096,80	-589.886,13
WRT11	2.347.992,31	445,91	411,40	0,00%	-794,73	646,63	1.550,17	-2.207,59
WDOF25	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
WDOG25	-3.470,98	140.561,27	-78.160,27	-0,09%	299.556,39	-297.811,30	385.311,70	-387.245,03
WEGE3	5.373.569,10	308.568,92	-137.893,33	-0,15%	1.343.392,28	-1.343.392,28	787.765,23	-794.213,51
WING25	-163,86	140.939,96	113.593,40	0,13%	660.606,22	-659.425,30	519.646,05	-521.971,64
XPIN11	2.752.134,00	179.369,29	135.066,12	0,15%	1.376.067,00	-1.376.067,00	403.462,84	-406.765,41
XPPR11	2.005.361,10	109.129,88	19.444,94	0,02%	1.002.680,55	-1.002.680,55	293.985,94	-296.392,37
YDUQ3	1.222.325,10	270.512,81	185.726,52	0,21%	476.706,79	-305.581,28	179.192,86	-180.659,65
Total Var:	2.826.068.684,02	120.838.965,46	90.367.619,52	99,99%	-57.666.131,49	22.216.884,34	246.607.644,19	-267.977.611,79

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2024

## Relatório de Risco de Mercado



FUNDO: EMBRAERPREV RENDA FIXA  
CNPJ: 10679245000140

Data: 31/12/2024

Dados Gerais									
PL:	4.382.118.240,45	VAR / PL:	1,6348%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	1.439,48		
VAR:	71.639.180,29	ETL / PL:	2,0501%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	986,94		
ETL:	89.838.422,26	VAR / CDI:	0,0182%	Benchmark:					

Cenários de STRESS									
Cenário Alta - 09999 (+):	0,00	Cenário Baixa - 10000 (+):	132.968.693,95	CENARIO BRADESCO 1 (+):	187.612.646,23	CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00		
Cenário Alta - 09999 (-):	-167.944.339,72	Cenário Baixa - 10000 (-):	0,00	CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-207.246.177,50		
Cenário Alta - 09999:	-167.944.339,72	Cenário Baixa - 10000:	132.968.693,95	CENARIO BRADESCO 1:	187.612.646,23	CENARIO BRADESCO 2:	-207.246.177,50		

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
CAIXA	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
FI RF EMB II	3.577.691.306,13	64.639.040,89	64.552.539,05	90,11%	-151.292.353,58	127.475.324,52	175.567.729,85	-192.792.863,30
FI RF EMB V CREDITO PRIVADO	106.986.885,74	1.454.417,14	1.169.916,24	1,63%	-3.268.995,44	340.353,21	1.676.225,35	-2.195.397,43
FIM EMB II A	247.416.238,10	976.583,95	871.924,41	1,22%	-1.614.570,59	1.611.208,73	1.395.704,88	-1.804.688,05
FIM EMB VI A CRED PRIV	145.766.897,10	3.458.975,05	3.142.020,62	4,39%	-6.779.926,78	3.256.687,90	6.087.723,80	-6.865.916,82
FIM EMB VII A CRED PRIV	65.630.841,27	2.048.793,03	1.902.779,96	2,66%	-4.988.493,34	285.119,59	2.885.262,35	-3.587.311,91
<b>Total Var:</b>	<b>4.143.492.168,35</b>	<b>72.577.810,06</b>	<b>71.639.180,29</b>	<b>100,01%</b>	<b>-167.944.339,72</b>	<b>132.968.693,95</b>	<b>187.612.646,23</b>	<b>-207.246.177,50</b>

## Relatório de Risco de Mercado



FUNDO: EMBRAERPREV RENDA VARIÁVEL  
CNPJ: 10679245000140

Data: 31/12/2024

Dados Gerais									
PL:	465.027.942,07	VAR / PL:	4,8734%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	2,49		
VAR:	22.662.518,34	ETL / PL:	6,1114%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1,33		
ETL:	28.419.712,29	VAR / CDI:	0,0541%	Benchmark:					

Cenários de STRESS									
Cenário Alta - 09999 (+):	105.646.320,38	Cenário Baixa - 10000 (+):	0,00	CENARIO BRADESCO 1 (+):	59.144.438,46	CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00		
Cenário Alta - 09999 (-):	0,00	Cenário Baixa - 10000 (-):	-99.911.305,23	CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-59.608.394,05		
Cenário Alta - 09999:	105.646.320,38	Cenário Baixa - 10000:	-99.911.305,23	CENARIO BRADESCO 1:	59.144.438,46	CENARIO BRADESCO 2:	-59.608.394,05		

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	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
CAIXA	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
FIA EMB VIII ETF	82.874.456,56	3.168.106,49	3.047.210,75	13,45%	7.431.346,23	-7.431.379,73	6.052.468,76	-6.102.021,24
FIA RVA EMB II	89.600.073,34	3.226.785,26	3.111.941,03	13,73%	21.727.614,78	-21.490.529,81	12.486.308,73	-12.568.512,18
FIA RVA EMB III	95.539.566,02	7.223.223,88	6.973.973,07	30,77%	24.298.168,41	-22.179.561,75	12.658.987,11	-12.763.958,16
FIA RVA EMB IV	86.311.907,92	5.730.031,25	5.622.071,63	24,81%	24.387.049,28	-20.976.152,89	12.054.912,72	-12.153.841,92
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA I	110.788.535,71	4.086.704,36	3.907.321,87	17,24%	27.802.141,69	-27.833.681,06	15.891.761,14	-16.020.060,56
<b>Total Var:</b>	<b>465.114.539,55</b>	<b>23.434.851,24</b>	<b>22.662.518,34</b>	<b>100,00%</b>	<b>105.646.320,38</b>	<b>-99.911.305,23</b>	<b>59.144.438,46</b>	<b>-59.608.394,05</b>

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2024



Data: 31/12/2024

## Relatório de Risco de Mercado

FUNDO:		FI RF EMB II							
CNPJ:		11005764000196							
<b>Dados Gerais</b>									
PL:	3.712.460.725,79	VAR / PL:	1,7412%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	1.542,91		
VAR:	64.643.053,30	ETL / PL:	2,1836%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1.057,84		
ETL:	81.064.996,77	VAR / CDI:	0,0193%	Benchmark:					
<b>Cenários de STRESS</b>									
Cenário Alta - 09999 (+):	0,00	Cenário Baixa - 10000 (+):	127.856.450,81	CENARIO BRADESCO 1 (+):	175.578.628,05	CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00		
Cenário Alta - 09999 (-):	-151.301.744,91	Cenário Baixa - 10000 (-):	-373.213,38	CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-192.804.830,73		
Cenário Alta - 09999:	-151.301.744,91	Cenário Baixa - 10000:	127.483.237,43	CENARIO BRADESCO 1:	175.578.628,05	CENARIO BRADESCO 2:	-192.804.830,73		
<b>Parâmetros do Cálculo</b>									
Modelo:	95	Modelo Volatilidade:	Lambda:	EWMA	0,94				
Int. Confiança:	21								
Horizonte:									
<b>Produto</b>	<b>MM</b>	<b>VAR Tot.</b>	<b>Comp. VAR</b>	<b>Comp. VAR (%)</b>	<b>Cenário Alta - 09999</b>	<b>Cenário Baixa - 10000</b>	<b>CENARIO BRADESCO 1</b>	<b>CENARIO BRADESCO 2</b>	
CSMG3	5.677.343,17	20.369,52	14.756,24	0,02%	0,00	0,00	0,00	0,00	
ELET42	14.193.973,49	394.244,01	325.255,77	0,50%	0,00	0,00	0,00	0,00	
ENTV12	12.725.486,43	379.154,69	331.749,08	0,51%	-52.190,62	53.225,20	215.433,39	-327.894,52	
GASP17	51.755.827,51	475.303,32	-74.286,33	-0,11%	0,00	0,00	0,00	0,00	
IGSN15	2.489.362,01	83.371,45	75.720,43	0,12%	-16.836,55	29.604,14	13.777,29	-18.580,19	
NEOE16	7.354.522,59	205.300,73	172.400,88	0,27%	0,00	0,00	0,00	0,00	
NTNB20260815 - 760199_VENCIMENTO	43.575.802,08	555.433,04	440.000,71	0,68%	-1.068.671,49	-190.541,13	418.290,83	-547.235,42	
NTNB20300815 - 760199_VENCIMENTO	25.586.405,54	552.532,28	523.199,08	0,81%	-963.753,26	-41.627,73	468.153,36	-605.121,52	
NTNB20350815 - 760199_VENCIMENTO	217.156.671,19	6.762.831,95	6.733.971,80	10,42%	-2.169.835,29	37.793,64	1.001.056,64	-1.324.394,62	
NTNB20400815 - 760199_VENCIMENTO	27.298.279,03	997.929,49	994.943,34	1,54%	-205.688,78	2.330,42	111.803,17	-141.032,29	
NTNB20450815 - 760199_VENCIMENTO	200.181.935,09	8.223.497,34	8.163.795,29	12,63%	-691.540,99	1.095.112,40	74.143,80	-112.590,91	
NTNB20500815 - 760199_VENCIMENTO	631.611.249,93	30.341.381,80	30.315.342,00	46,90%	-580.557,77	-114.942,77	221.421,10	-289.471,32	
NTNB20550815 - 760199_VENCIMENTO	193.663.192,76	10.423.786,02	10.414.226,30	16,11%	-829.218,62	831.188,04	779.661,72	-1.035.177,54	
SBSPC2	5.194.417,39	13.049,89	6.817,82	0,01%	-1.295.465,88	1.093.206,47	1.383.486,72	-1.751.726,42	
BBOTPIND	252.975.746,22	6.178.636,36	6.129.193,10	9,48%	-16.177.152,49	15.327.520,29	19.279.191,31	-23.224.122,00	
CAIXA	5.000,00	0,00	0,00	0,00%	-3.008.304,76	1.933.270,89	3.046.656,07	-3.524.338,45	
COMPROMISSADA_PRE	1.850.345.320,58	51.870,70	40.246,32	0,06%	-23.366.357,50	18.868.887,62	26.561.130,41	-29.570.004,36	
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-114.067,63	0,00	0,00	0,00%	-75.934.837,11	66.838.566,89	91.642.937,08	-98.485.078,17	
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-24.895.738,79	21.745.744,82	30.358.694,83	-31.844.278,71	
LFT20301201 - 210100	36.237.920,51	52.537,98	35.721,46	0,06%	0,00	0,00	0,00	0,00	
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-45.614,99	-26.101,76	2.790,34	-3.784,29	
<b>Total Var:</b>	<b>3.577.913.387,88</b>	<b>65.711.230,57</b>	<b>64.643.053,30</b>	<b>100,01%</b>	<b>-151.301.744,91</b>	<b>127.483.237,43</b>	<b>175.578.628,05</b>	<b>-192.804.830,73</b>	

## Relatório de Risco de Mercado

FUNDO:		FI RF EMB V CREDITO PRIVADO							
CNPJ:		20726178000121							
<b>Dados Gerais</b>									
PL:	107.903.814,60	VAR / PL:	1,3479%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	583,37		
VAR:	1.454.417,14	ETL / PL:	1,6903%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	399,59		
ETL:	1.823.897,77	VAR / CDI:	0,015%	Benchmark:					
<b>Cenários de STRESS</b>									
Cenário Alta - 09999 (+):	0,00	Cenário Baixa - 10000 (+):	603.463,82	CENARIO BRADESCO 1 (+):	1.676.225,35	CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00		
Cenário Alta - 09999 (-):	-3.268.995,43	Cenário Baixa - 10000 (-):	-263.110,61	CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-2.195.397,43		
Cenário Alta - 09999:	-3.268.995,43	Cenário Baixa - 10000:	340.353,21	CENARIO BRADESCO 1:	1.676.225,35	CENARIO BRADESCO 2:	-2.195.397,43		
<b>Parâmetros do Cálculo</b>									
Modelo:	95	Modelo Volatilidade:	Lambda:	EWMA	0,94				
Int. Confiança:	21								
Horizonte:									
<b>Produto</b>	<b>MM</b>	<b>VAR Tot.</b>	<b>Comp. VAR</b>	<b>Comp. VAR (%)</b>	<b>Cenário Alta - 09999</b>	<b>Cenário Baixa - 10000</b>	<b>CENARIO BRADESCO 1</b>	<b>CENARIO BRADESCO 2</b>	
17H0164854	5.816.313,29	124.300,78	118.833,62	8,17%	-113.949,38	77.515,68	88.591,66	-117.404,22	
AEGP23	7.612.181,30	54.950,30	51.866,56	3,57%	-21.351,16	97.924,91	39.260,38	-52.955,68	
CMDT33	750.183,12	1.884,68	1.259,38	0,09%	0,00	0,00	0,00	0,00	
ENJG21	1.131.684,34	26.290,48	24.817,47	1,71%	-6.587,76	-3.769,64	402,98	-546,53	
ENMZ1	756.515,93	17.662,29	16.671,86	1,15%	-67,44	68,78	278,38	-423,69	
ENTV12	16.728.712,37	498.430,44	487.734,88	33,53%	0,00	0,00	0,00	0,00	
ERDV17_VENCIMENTO	6.677.865,10	40.896,26	38.373,20	2,64%	0,00	0,00	0,00	0,00	
GASP17	10.708.102,24	98.338,62	10.136,28	0,70%	-22.075,64	16.804,44	17.760,19	-23.564,31	
GRRB24_VENCIMENTO	15.897.116,24	440.042,01	434.574,11	29,88%	-14.891,48	11.217,32	11.937,13	-15.837,50	
LFSN16000GM	16.229.669,35	37.284,15	2.668,03	0,18%	-1.266.933,97	-54.723,11	615.426,61	-795.482,67	
LFSN18000DC5	5.207.913,22	41.005,33	38.840,56	2,67%	-17.456,00	72.156,06	26.111,00	-35.271,10	
OMGE31	13.118.823,28	242.597,57	221.904,51	15,26%	-448.931,44	7.819,37	207.115,17	-274.012,68	
SBSPC2	3.980.796,77	10.000,92	6.682,81	0,46%	-1.170.760,05	-162.262,74	488.535,80	-638.281,00	
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	-56.286,42	-22.351,75	5.344,72	-7.250,33	
COMPROMISSADA_PRE	2.390.947,70	67,03	53,87	0,00%	-5.725,20	83.648,79	32.598,43	-43.912,88	
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-20.938,53	0,00	0,00	0,00%	-89.021,97	236.308,46	140.724,50	-187.554,72	
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00	
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	-34.857,53	-20.003,36	2.138,41	-2.900,13	
<b>Total Var:</b>	<b>106.986.885,72</b>	<b>1.633.750,85</b>	<b>1.454.417,14</b>	<b>100,01%</b>	<b>-3.268.995,43</b>	<b>340.353,21</b>	<b>1.676.225,35</b>	<b>-2.195.397,43</b>	



# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2024



Data: 31/12/2024

## Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO  
CNPJ: 4183766000109

Dados Gerais		Limite Fundo:	
PL:	191.535.695,34	VAR / PL:	2,5223%
VAR:	4.831.023,96	ETL / PL:	3,1630%
ETL:	6.058.298,94	VAR / CDI:	0,028%
		Status:	ENQUADRADO
		Benchmark:	0,00% Dutation DC: 945,40 Dutation DU: 648,32

Cenários de STRESS			
Cenário Alta - 09999 (+):	744.253,25	Cenário Baixa - 10000 (+):	5.432.592,19
Cenário Alta - 09999 (-):	-10.213.529,04	Cenário Baixa - 10000 (-):	-884.095,29
Cenário Alta - 09999:	-9.469.275,80	Cenário Baixa - 10000:	4.548.496,90
		CENARIO BRADESCO 1 (+):	9.490.006,03
		CENARIO BRADESCO 2 (+):	62.684.697,69
		CENARIO BRADESCO 1 (-):	-987.504,82
		CENARIO BRADESCO 2 (-):	-72.274.072,63
		CENARIO BRADESCO 1:	8.502.501,21
		CENARIO BRADESCO 2:	-9.589.374,94

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
020913	461.407,69	42.121,71	7.267,77	0,15%	0,00	0,00	0,00	0,00
AECPA1	1.893.786,51	2.032,56	1.992,34	0,04%	-3.672,05	3.010,37	6.929,08	-9.437,96
APRB28	886.295,32	81,94	80,55	0,00%	-145,48	117,66	282,22	-404,79
ARTRA1	2.602.928,77	275,16	270,25	0,01%	-488,16	398,39	977,57	-1.412,11
BARU11	1.428.216,56	80.021,57	75.899,00	1,57%	-219.801,30	13.296,06	138.583,91	-165.025,41
BCBF15	1.001.672,76	29,63	28,61	0,00%	-51,02	48,85	134,46	-201,93
BRKPA0	2.830.801,41	1.162,59	1.143,05	0,02%	-2.052,85	1.660,07	3.996,86	-5.719,53
CAEC11	1.917.628,21	52,72	51,17	0,00%	-94,75	83,37	222,18	-330,52
CAIXA	10.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CART13	898.313,41	33.442,72	32.612,42	0,68%	-81.961,91	2.264,16	45.778,66	-57.483,47
CBAN22	5.784.915,50	63.650,03	61.361,34	1,27%	-114.873,04	94.936,52	207.889,32	-269.407,95
CEAB13	1.559.903,76	590,28	580,24	0,01%	-1.053,80	847,24	2.009,60	-2.852,36
CGBP13	2.399.245,67	1.603,70	1.572,81	0,03%	-2.891,70	2.374,97	5.479,86	-7.482,75
CLH12	2.448.797,94	5.773,84	5.634,19	0,12%	-10.612,09	8.902,43	20.044,34	-26.132,06
COMPROMISSADA_PRE	2.165.782,15	60,71	52,64	0,00%	-61,09	62,30	252,16	-383,79
CONTRAS_A_PAGAR_RECEBER	-387.740,03	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CRTR12	2.702.833,38	131.313,58	126.925,18	2,61%	-337.562,46	31.355,28	216.179,70	-259.778,97
CSAN23	1.129.318,24	1.982,54	1.932,48	0,04%	-3.648,87	3.064,52	6.873,28	-8.921,41
CSMG88	2.656.110,90	76.002,49	74.007,09	1,53%	-182.360,47	-9.060,86	86.294,49	-112.108,61
DAPK25	-2.781,61	51.234,77	42.872,72	0,89%	-76.478,86	85.748,77	43.815,32	-43.852,56
DAPK27	-6.544,65	638.903,56	629.531,76	13,03%	-938.761,81	883.713,23	1.128.176,07	-1.100.326,55
DAPK29	-1.438,83	191.629,19	188.305,48	3,90%	-357.574,76	326.749,47	454.855,83	-432.169,19
DAPK35	201,01	45.333,74	-39.054,78	-0,81%	-101.457,03	-101.272,08	-148.911,41	-131.364,30
DAPQ26	-5.806,42	438.213,26	425.898,95	8,82%	-636.971,48	618.378,01	678.989,76	-668.987,99
DAPQ28	-9.304,82	1.190.341,29	1.180.052,46	24,43%	-1.957.936,49	1.822.427,00	2.460.166,32	-2.359.456,99
DAPQ30	953,09	133.799,20	-127.175,01	-2,63%	296.477,58	-269.044,26	-380.904,85	356.526,96
DAPQ32	824,08	144.731,88	-131.446,27	-2,72%	336.485,05	-312.011,72	-448.897,96	409.561,42
DASACS	1.946.584,96	4.739,77	4.607,31	0,10%	-8.825,30	7.509,15	16.694,69	-21.116,68
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DHF27	-1.311,47	8.974,31	8.816,55	0,18%	-15.536,84	12.854,71	29.194,83	-40.415,81
DHF28	-33.053,18	201.849,85	197.262,62	4,08%	-357.705,40	303.257,28	668.714,63	-883.474,13
DHF31	-3.131,28	19.662,18	18.969,44	0,39%	-37.758,93	33.793,87	72.830,15	-84.309,65
ELET24	2.706.410,83	1.462,86	1.436,30	0,03%	-2.624,98	2.134,95	4.976,65	-6.900,09
GUAR15	1.036.356,43	199,67	196,24	0,00%	-352,53	296,92	694,42	-998,74
HAVR22	570.279,09	456,45	447,46	0,01%	-822,19	673,92	1.549,47	-2.112,72
HZTC14	2.247.086,87	82.598,35	80.530,63	1,67%	-194.277,72	12.604,88	113.017,38	-141.649,65
IDF25P421800	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	-61.674.087,91
IDF25P421900	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	61.773.824,83
IRJS14	3.019.844,21	157.612,38	150.945,65	3,12%	-418.822,03	37.317,00	271.327,90	-322.531,05
JSMIL85	3.118.132,41	105.485,35	103.468,51	2,14%	-295.027,23	-23.189,79	142.163,19	-181.555,64
LCAM01	7.145.914,62	246.421,41	241.468,37	5,00%	-695.086,15	-57.346,69	334.297,41	-426.640,51
LF001800FAU	4.550.796,35	124.991,84	123.112,94	2,55%	-322.045,07	-8.359,32	158.512,71	-206.608,21
LF00230628P	5.789.454,79	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0023062K1	5.807.777,48	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFSC190054B	1.016.970,95	0,00	0,00	0,00%	1.054,52	-946,98	-2.444,04	3.730,93
LFSC190059S	1.540.421,18	0,00	0,00	0,00%	1.622,43	-1.452,92	-3.741,28	5.711,41
LFSC19005L1	1.019.209,81	0,00	0,00	0,00%	1.156,64	-1.022,55	-2.605,29	3.977,84
LFSC22002X	4.604.914,10	2.451,82	2.410,99	0,05%	-4.327,29	3.486,21	8.292,74	-11.809,03
LFSN210029N	4.920.015,60	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFSN2301ERT	4.780.557,78	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20250901 - 210100	22.023.222,88	6.305,90	4.284,83	0,09%	-36.135,49	42.496,10	1.172,57	-1.785,09
LIGHB4	1.261.984,15	49.221,15	47.944,36	0,99%	-152.523,61	-42.078,99	47.549,21	-49.292,33
LIGHC3	459.685,12	16.196,90	15.841,25	0,33%	-47.702,43	-6.188,68	21.646,37	-27.619,23
LIGHC4	400.386,43	21.505,95	20.529,19	0,42%	-49.391,83	8.810,31	34.131,77	-41.407,07
LIGHD3	194.235,32	6.127,90	6.014,57	0,12%	-14.425,33	445,52	7.850,16	-9.940,67
LIGT11	1.024.734,18	32.324,09	31.548,07	0,65%	-58.418,71	47.909,40	108.015,46	-144.979,17
LIMP17	2.606.092,04	333,46	325,86	0,01%	-588,94	489,21	1.216,05	-1.790,35
LRENB1	695.916,10	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
MOVIZ7	1.163.058,79	1.487,34	1.457,84	0,03%	-2.686,51	2.204,16	5.070,77	-6.900,89
MTRJ19	2.464.790,27	71.839,18	70.395,26	1,46%	-177.457,13	-5.741,43	87.190,26	-112.333,74
NTEN11	2.814.257,15	70.359,49	68.087,61	1,41%	-160.012,31	-2.039,14	76.956,95	-100.292,40
NTNB20250515 - 760199 NEGOCIACAO	621.787,52	2.507,53	2.412,39	0,05%	-3.220,62	3.493,77	1.565,17	-2.117,73
NTNB20260815 - 760199 NEGOCIACAO	21.583.094,77	275.105,98	268.058,90	5,55%	-410.711,98	411.687,43	386.166,45	-512.723,44
NTNB20270515 - 760199 NEGOCIACAO	4.937.157,03	82.695,17	81.849,12	1,69%	-127.375,77	113.997,26	128.320,82	-168.723,37
NTNB20280815 - 760199 NEGOCIACAO	8.023.148,86	166.015,16	164.867,59	3,41%	-263.171,87	281.463,00	307.801,41	-398.087,71
NTNB20250815 - 760199 NEGOCIACAO	416.995,20	20.031,64	17.409,08	0,36%	-50.132,83	44.127,40	60.503,46	-65.020,70
NTSD36	2.894.464,24	7.271,86	7.049,81	0,15%	-13.790,70	11.904,28	26.308,82	-32.205,79
OMGE13	3.161.006,53	2.135,93	2.095,18	0,04%	-3.849,42	3.150,80	7.288,89	-9.992,31
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
OVS410	1.742.718,31	129,32	126,46	0,00%	-231,93	189,53	464,19	-681,30
OVSAA8	664.080,70	896,97	879,08	0,02%	-1.618,49	1.327,57	3.039,67	-4.131,09
RAHD11	3.114.753,11	131.806,06	127.657,52	2,64%	-321.556,66	35.696,29	204.739,93	-248.984,70
RBCAPMZ	462.808,34	8.503,92	2.552,96	0,05%	0,00	0,00	0,00	0,00
RDCO10	2.460.934,28	437,00	428,94	0,01%	-772,25	630,97	1.538,18	-2.233,06
RDR0B9	1.120.293,07	1.884,48	1.836,82	0,04%	-3.468,73	2.913,35	6.534,73	-8.479,65
RDR0C9	1.602.019,09	2.694,80	2.626,66	0,05%	-4.960,29	4.166,09	9.344,66	-12.125,90
RIS412	2.629.514,45	99.683,59	96.990,85	2,01%	-265.733,04	-12.880,90	136.665,52	-172.279,19
RODB11	2.765.697,14	7.179,97	7.015,88	0,15%	-13.077,10	10.880,73	24.611,23	-32.594,19
RSAN24	1.864.102,69	58,40	56,59	0,00%	-105,82	91,21	237,32	-352,83
SNGO18	766.278,73	17,74	17,13	0,00%	-32,23	28,88	77,16	-115,17
TBSP11	2.334.646,63	862,20	847,39	0,02%	-1.544,93	1.256,14	2.966,10	-4.168,45
UNEG11	4.228.729,82	204.249,11	195.774,82	4,05%	-476.469,99	84.822,94	329.239,45	-397.450,62
YAMO33	2.653.714,17	89.411,28	87.772,22	1,82%	-263.982,21	-31.458,99	120.035,25	-153.584,62

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2024

## Relatório de Risco de Mercado



Data: 31/12/2024

FUNDO: FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO  
CNPJ: 4183766000109

Dados Gerais				Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	945,40
PL:	191.535.695,34	VAR / PL:	2,5223%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	648,32
VAR:	4.831.023,96	ETL / PL:	3,1630%	Benchmark:			
ETL:	6.058.298,94	VAR / CDI:	0,028%				

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	744.253,25	Cenário Baixa - 10000 (+):	5.432.592,19	CENARIO BRADESCO 1 (+):	9.490.006,03	CENARIO BRADESCO 2 (+):	62.684.697,69
Cenário Alta - 09999 (-):	-10.213.529,04	Cenário Baixa - 10000 (-):	-884.095,29	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-987.504,82	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-72.274.072,63
Cenário Alta - 09999:	-9.469.275,80	Cenário Baixa - 10000:	4.548.496,90	CENARIO BRADESCO 1:	8.502.501,21	CENARIO BRADESCO 2:	-9.589.374,94

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
VECS11	3.616.152,86	8,74	6,07	0,00%	-17,85	16,69	53,34	-80,39
VERDECS2	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
VIX118	2.316.580,90	2.919,79	2.856,41	0,06%	-5.303,26	4.389,03	9.958,44	-13.304,54
VVRT11	2.347.902,31	445,31	437,78	0,01%	-794,73	646,63	1.550,17	-2.207,59
<b>Total Var:</b>	<b>203.587.294,65</b>	<b>5.613.943,85</b>	<b>4.831.023,96</b>	<b>100,00%</b>	<b>-9.469.275,80</b>	<b>4.548.496,90</b>	<b>8.502.501,22</b>	<b>-9.589.374,94</b>

## Relatório de Risco de Mercado



Data: 31/12/2024

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

Dados Gerais				Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	1.570,83
PL:	137.133.561,04	VAR / PL:	3,4365%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1.076,78
VAR:	4.712.624,62	ETL / PL:	4,3095%	Benchmark:			
ETL:	5.909.821,39	VAR / CDI:	0,0382%				

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	0,00	Cenário Baixa - 10000 (+):	956.671,21	CENARIO BRADESCO 1 (+):	6.636.667,61	CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00
Cenário Alta - 09999 (-):	-11.474.510,18	Cenário Baixa - 10000 (-):	-300.840,41	CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-8.251.518,89
Cenário Alta - 09999:	-11.474.510,18	Cenário Baixa - 10000:	655.830,80	CENARIO BRADESCO 1:	6.636.667,61	CENARIO BRADESCO 2:	-8.251.518,89

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
APPSA2	2.784.028,28	90.019,73	89.812,88	1,91%	-254.759,65	-21.776,82	120.717,08	-154.665,35
ASAB11	2.347.975,61	76.683,98	76.639,14	1,63%	-211.465,74	-21.473,41	98.527,79	-125.597,18
ASER12	4.337.256,44	228.076,67	224.625,95	4,77%	-609.424,73	57.482,98	398.847,36	-472.164,77
BRKP28	4.862.473,91	219.757,95	218.310,51	4,63%	-588.398,29	-33.874,92	306.891,69	-382.832,42
CAEC21	4.078.788,89	113.923,50	107.891,28	2,29%	-230.792,27	-1.031,89	111.823,49	-146.563,28
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CART13	5.063.221,06	188.495,31	188.410,29	4,00%	-461.967,12	12.761,61	258.025,17	-323.997,76
CDES11	3.150.829,63	155.001,49	153.699,36	3,26%	-361.020,02	63.109,03	247.717,89	-299.694,45
CJEN13	3.830.965,41	142.393,93	142.350,84	3,92%	-333.397,27	23.487,46	195.309,10	-244.460,03
CNRD11	6.525.367,12	271.656,56	271.345,86	5,76%	-621.857,85	62.588,10	382.846,38	-475.661,84
COMPROMISSADA_PRE	14.139.449,36	396,37	330,26	0,01%	-398,82	406,72	1.646,24	-2.505,61
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-97.271,45	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CRMG15	2.726.470,21	74.544,29	73.700,92	1,56%	-167.768,72	10.013,04	90.310,57	-116.558,54
CSMG89	3.147.096,03	112.408,76	112.263,34	2,38%	-295.034,04	-11.179,53	151.849,49	-192.091,41
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ENAT24	2.384.379,85	108.369,89	107.767,66	2,29%	-266.214,17	8.803,02	154.635,61	-191.934,63
ENEVA0	205.181,84	9.401,21	9.340,94	0,20%	-23.200,97	701,30	13.465,16	-16.716,32
ERDV17	4.849.614,03	29.699,78	26.555,68	0,56%	-12.676,94	52.401,34	18.962,39	-25.614,66
ERDV38	6.005.791,72	81.205,97	66.020,62	1,40%	-25.470,39	98.584,85	50.559,07	-67.472,34
GBSP11	3.370.035,60	166.667,13	164.234,60	3,48%	-458.146,50	31.947,19	292.356,73	-345.646,65
GRRB24	8.388.706,29	232.204,58	229.197,87	4,86%	-617.795,20	-85.623,99	257.794,14	-336.812,78
HGLB23	2.629.041,07	107.617,79	107.473,00	2,28%	-265.814,35	5.515,61	149.261,40	-187.111,59
HVRD15	5.223.740,15	212.243,90	212.139,51	4,50%	-515.817,15	18.879,30	294.373,52	-368.213,46
IPIL11	31.875,82	1.074,00	1.073,39	0,02%	-2.510,86	148,26	1.427,02	-1.797,37
IRBR12	11.128.463,09	256.743,32	209.133,16	4,44%	-181.276,61	210.634,21	180.308,15	-239.586,36
JALL15	596.228,90	27.615,37	27.435,07	0,58%	-67.603,10	2.679,84	39.688,23	-49.218,06
LCAMB1	9.976.992,96	344.048,99	343.053,60	7,28%	-970.466,35	-80.066,38	466.739,82	-595.667,54
LORTA7	6.084.599,59	213.860,54	213.028,37	4,52%	-554.228,10	4.600,52	299.393,35	-381.617,02
MOVIV37	619.456,37	21.043,11	20.993,96	0,45%	-58.965,08	-4.685,43	28.401,23	-36.265,63
MTRJ19	2.633.366,60	76.752,53	76.308,35	1,62%	-189.594,10	-6.134,11	93.153,53	-120.016,67
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PASN12	4.233,72	95,89	93,35	0,00%	-209,65	4,31	104,35	-135,94
RAHD11	5.418.334,66	229.286,01	228.488,16	4,85%	-559.370,69	62.096,23	356.159,67	-433.126,59
RDVE11	3.593.929,82	132.976,38	132.898,93	2,82%	-306.149,73	37.002,24	191.078,30	-236.395,90
RMSA12	7.445.653,04	380.440,15	375.655,71	7,97%	-997.109,95	93.333,10	645.658,32	-770.093,08
TCH11	3.960.274,76	167.322,78	166.455,36	3,53%	-427.798,25	37.305,45	268.611,65	-324.324,80
UNEG11	2.850.385,81	137.674,62	136.437,55	2,90%	-321.165,78	57.175,11	221.924,67	-267.902,58
VAMO34	768.842,69	26.557,19	26.493,33	0,56%	-74.480,75	-6.129,76	35.828,39	-45.727,13
VBR11	1.959.163,19	58.024,67	57.904,45	1,23%	-157.409,16	-12.444,93	73.399,91	-94.757,13
VERO12	3.372.380,02	93.603,81	91.933,23	1,95%	-229.416,78	-16.419,25	105.105,39	-136.748,98
VMT13	565.448,90	23.201,90	23.128,11	0,49%	-55.335,09	5.010,41	33.765,38	-41.823,07
<b>Total Var:</b>	<b>150.963.768,98</b>	<b>4.811.090,04</b>	<b>4.712.624,62</b>	<b>100,00%</b>	<b>-11.474.510,18</b>	<b>655.830,80</b>	<b>6.636.667,60</b>	<b>-8.251.518,89</b>

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2024



Data: 31/12/2024

## Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: **FIRF EMB II A CRED PRIV**  
CNPJ: **20725957000102**

Dados Gerais		Limite Fundo:		0,00% Dutation DC:	
PL:	233.084.443,68	VAR / PL:	0,3957%	Status:	ENQUADRADO
VAR:	922.263,60	ETL / PL:	0,4962%	Benchmark:	
ETL:	1.156.555,76	VAR / CDI:	0,0044%	Dutation DU:	389,52

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	602.276,47	Cenário Baixa - 10000 (+):	2.035.546,16	CENARIO BRADESCO 1 (+):	2.466.301,29	CENARIO BRADESCO 2 (+):	1.486.067,62
Cenário Alta - 09999 (-):	-2.127.040,08	Cenário Baixa - 10000 (-):	-513.957,40	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-1.148.229,45	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-3.190.373,83
Cenário Alta - 09999:	-1.524.763,62	Cenário Baixa - 10000:	1.521.588,76	CENARIO BRADESCO 1:	1.318.071,84	CENARIO BRADESCO 2:	-1.704.306,21

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
CAIXA	9.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CD3323R5TI	7.042.717,08	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	6.210.744,41	174,11	151,28	0,02%	-175,18	178,65	723,11	-1.100,59
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	9.067,99	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DIF27	34.098,25	233.331,96	-222.103,57	-24,08%	403.957,95	-334.222,53	-759.065,63	1.050.810,94
DIF29	5.414,52	31.613,02	-29.561,35	-3,21%	57.113,34	-49.264,47	-107.623,97	135.959,07
DIF33	10.094,60	70.338,43	-64.906,23	-7,04%	141.205,18	-130.470,40	-281.539,86	299.297,61
LF002200USM	11.250.573,42	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002200USN	11.795.618,26	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306J15	11.697.315,54	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF002306U55	7.028.683,68	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024000XE	11.250.196,85	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024000XG	11.230.084,35	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024000XN	11.205.526,89	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024002C7	6.434.724,95	152.294,78	144.392,01	15,66%	-272.242,34	218.297,52	503.667,79	-697.383,80
LF0024002SX	4.818.397,79	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024002TZ	11.191.315,37	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024003JU	7.167.594,63	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024003CF	11.792.233,12	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024006I2	11.838.153,83	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024007F1	7.221.412,94	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024009LF	7.106.663,78	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LF0024000DA	3.574.890,67	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20250301 - 210100	664.126,95	49,59	30,75	0,00%	-243,30	266,27	7,16	-10,90
LFT20260301 - 210100	284.511,23	113,98	70,14	0,01%	-957,94	1.274,44	32,39	-49,31
LFT20260901 - 210100	976.808,19	558,95	363,85	0,04%	-4.744,93	6.622,37	156,32	-237,94
LFT20270301 - 210100	426.299,67	324,81	189,93	0,02%	-2.346,53	4.062,02	168,05	-255,72
LFT20270901 - 210100	142.008,81	138,76	84,13	0,01%	-929,23	1.717,56	79,29	-120,63
LFT20300301 - 210100	47.101,31	57,75	39,98	0,00%	-654,17	1.248,55	86,35	-131,16
NTNB20250515 - 760199 NEGOCIACAO	12.595.638,63	50.795,47	48.323,98	5,24%	-65.240,52	70.773,72	31.705,86	-42.899,19
NTNB20260815 - 760199 NEGOCIACAO	18.519.715,88	236.059,04	232.596,60	25,22%	-352.417,92	353.254,92	331.356,23	-439.950,46
NTNB20270515 - 760199 NEGOCIACAO	14.548.495,38	243.680,78	242.473,01	26,29%	-375.342,69	335.919,76	378.127,51	-497.183,12
NTNB20280815 - 760199 NEGOCIACAO	20.308.463,93	420.223,16	418.760,18	45,41%	-666.149,48	712.448,59	779.117,27	-1.007.652,99
NTNB20290515 - 760199 NEGOCIACAO	3.143.743,69	67.215,82	66.495,00	7,21%	-136.754,69	110.449,44	140.756,79	-180.658,92
NTNB20500815 - 760199 NEGOCIACAO	2.069.812,52	99.429,79	84.857,89	9,20%	-248.841,16	219.032,36	300.317,16	-322.739,10
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
Total Var:	233.654.249,10	1.606.400,19	922.263,60	100,00%	-1.524.763,62	1.521.588,76	1.318.071,84	-1.704.306,21

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2024

## Relatório de Risco de Mercado



Data: 31/12/2024

FUNDO: FIM EMB I A  
CNPJ: 20725946000122

Dados Gerais		Limite Fundo:		0,00%		Duration DC:	
PL:	134.496.613,13	VAR / PL:	0,1828%	Status:	ENQUADRADO	Duration DU:	458,31
VAR:	245.913,42	ETL / PL:	0,2293%	Benchmark:			314,11
ETL:	308.385,35	VAR / CDI:	0,002%				

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	4.806.191,17	Cenário Baixa - 10000 (+):	4.419.936,75	CENARIO BRADESCO 1 (+):	67.906.137,77	CENARIO BRADESCO 2 (+):	592.062.439,84
Cenário Alta - 09999 (-):	-5.419.060,07	Cenário Baixa - 10000 (-):	-3.695.051,92	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-67.407.059,07	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-593.159.600,95
Cenário Alta - 09999:	-612.868,90	Cenário Baixa - 10000:	724.884,83	CENARIO BRADESCO 1:	499.078,70	CENARIO BRADESCO 2:	-1.097.161,11

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
ECOFI4	87.908,64	1,31	1,27	0,00%	-2,43	2,49	7,48	-11,29
CAIXA	9.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CBAN22	3.860.455,41	42.475,66	40.657,08	16,53%	-76.658,38	63.354,11	138.731,06	-179.784,37
CEEB43	1.877.973,80	254,35	248,81	0,10%	-447,17	365,10	898,32	-1.305,82
CGBP13	1.890.988,92	1.263,97	1.233,18	0,50%	-2.279,12	1.871,86	4.319,00	-5.897,60
COMPROMISSADA PRE	25.270.522,06	708,41	613,44	0,25%	-712,78	726,91	2.942,22	-4.478,12
CONTAS_A PAGAR_RECEBER	58.205,53	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPMF25C101000	201,95	312,95	-260,04	-0,11%	-0,04	0,21	0,52	-0,79
CPT12	1.846.858,24	1.609,32	1.565,95	0,64%	-2.948,12	2.457,02	5.552,50	-7.326,80
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DHF25	-6,80	425,91	-368,81	-0,15%	428,53	-437,03	-1.768,91	2.692,32
DHF26	1.010,12	11.768,22	-11.440,07	-4,65%	20.016,27	-16.920,39	-39.130,25	56.853,33
DHF27	524,59	3.589,72	-3.483,15	-1,42%	6.214,74	-5.141,89	-11.677,93	16.166,32
DHF31	5.815,24	36.515,48	-35.008,14	-14,24%	70.123,72	-62.760,04	-135.255,99	156.575,07
DHJ25	-27.016,66	107.308,85	103.883,15	42,24%	-137.468,11	208.596,65	516.332,89	-778.180,82
DHJ26	64.433,02	488.553,48	-475.841,44	-193,50%	813.191,88	-677.181,69	-1.575.623,86	2.234.380,72
ELET13	2.028.539,21	156,22	152,55	0,06%	-274,97	233,97	593,34	-877,15
GRRB14	1.092.723,99	29,29	28,63	0,01%	-53,51	43,62	107,88	-158,15
IDIF25P419600	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	155.672.780,74
IDIF25P419700	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	-155.933.815,65
IDIF25P422300	8.634,75	10.196,81	-1.356,94	-0,55%	-1.763,90	2.095,39	-8.634,75	24.598.825,32
IDIF25P422400	-68.884,55	43.373,99	5.772,00	2,35%	7.933,87	-8.429,13	68.884,55	-49.224.985,65
IDIF25P422500	71.913,51	24.973,85	-3.323,40	-1,35%	-4.659,03	4.768,04	-71.913,51	24.614.496,63
IDJ25P432500	0,81	3,88	3,79	0,00%	-0,81	1.358,46	-0,81	51.429.320,84
IDJ25P432600	-3,48	16,24	-15,87	-0,01%	3,48	-4.432,56	3,48	-103.038.293,77
IDJ25P432700	3,66	16,54	16,16	0,01%	-3,66	3.533,79	-3,66	51.608.971,94
IDJ25P435100	71.981,79	94.849,83	92.673,01	37,69%	-70.063,17	296.491,48	-71.981,79	19.207.613,27
IDJ25P435200	-88.348,74	108.052,75	-105.572,91	-42,93%	85.424,58	-311.901,08	88.348,74	-19.223.457,49
IDIN25C447900	2.752.340,29	2.094.591,80	-2.043.708,65	-831,07%	3.802.854,06	-2.576.269,86	65.349.928,77	-2.752.340,29
IDIN25C448000	-2.641.076,27	2.092.697,63	2.041.860,50	830,32%	-3.803.335,14	2.494.813,41	-65.349.928,77	2.641.076,27
IDIN25P442900	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,02	0,00	35.052.955,74
IDIN25P443000	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	-0,04	0,00	-35.124.061,49
IDIN25P443100	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	-0,07	0,00	-35.195.167,23
IDIN25P443200	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,12	0,00	35.266.272,98
IDIN25P445400	0,00	0,01	0,01	0,00%	0,00	2.722,13	0,00	37.682.721,20
IDIN25P445500	0,00	0,03	-0,03	0,00%	0,00	-3.761,83	0,00	-37.755.472,06
IDIN25P445600	0,01	0,08	0,08	0,00%	-0,01	7.714,29	-0,01	56.742.334,39
IDIN25P445700	-0,03	0,39	-0,38	0,00%	0,03	-27.816,34	0,03	-151.556.280,85
IDIN25P445800	0,04	0,45	0,44	0,00%	-0,04	23.275,90	-0,04	94.934.311,61
LCAMC3	2.976.529,61	954,31	933,44	0,38%	-1.685,08	1.362,66	3.280,81	-4.694,87
LF002100HDQ	3.123.110,97	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
LFT20250301 - 210100	1.581.254,64	118,07	81,74	0,03%	-579,29	633,98	17,05	-25,96
LFT20250901 - 210100	10.845.607,25	3.105,42	2.298,40	0,93%	-17.795,37	20.927,73	577,45	-879,09
LFT20260301 - 210100	13.403.640,27	5.369,52	4.145,48	1,69%	-45.129,60	60.040,31	1.525,98	-2.322,92
LFT20260901 - 210100	9.434.604,71	5.382,18	4.156,15	1,69%	-45.689,08	63.767,00	1.505,19	-2.291,15
LFT20270301 - 210100	6.931.316,84	5.281,09	3.838,14	1,56%	-38.152,88	66.045,38	2.732,36	-4.157,86
LFT20290301 - 210100	4.528.278,67	5.411,71	4.216,84	1,71%	-36.842,31	96.201,24	6.620,52	-10.060,97
LTN20260701 - 100000	24.633.280,06	450.361,80	439.427,80	178,69%	-735.012,99	614.632,39	1.427.142,28	-2.023.783,22
NTNB20250515 - 760199 NEGOCIACAO	13.190.778,11	53.195,54	50.886,64	20,69%	-68.323,11	74.117,76	33.203,95	-44.926,16
NTNB20260815 - 760199 NEGOCIACAO	2.387.953,95	30.437,73	28.559,85	11,61%	-45.441,18	45.549,10	42.725,46	-56.727,73
NTNB20250815 - 760199 NEGOCIACAO	1.406.411,07	67.561,27	61.065,83	24,83%	-169.084,38	148.829,68	204.061,66	-219.297,08
OMGE13	926.580,92	626,10	610,96	0,25%	-1.128,37	923,59	2.136,58	-2.929,03
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
SBSPC7	2.316.265,51	1.098,93	1.074,56	0,44%	-1.957,12	1.580,20	3.737,19	-5.286,63
VAIMO22	725.805,31	58,78	57,64	0,02%	-106,06	87,28	220,52	-322,90
WDOF25	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
WDOG25	1.291,53	52.301,87	36.229,71	14,73%	-111.462,84	110.813,51	-143.371,79	144.091,17
Total Var:	136.587.408,45	5.845.011,73	245.913,42	99,97%	-612.868,90	724.884,83	499.078,70	-1.097.161,11

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2024



Data: 31/12/2024

## Relatório de Risco de Mercado

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

Dados Gerais		Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	665,52
PL:	64.366.822,40	VAR / PL:	0,1817%	ENQUADRADO	Dutacion DU:
VAR:	116.969,20	ETL / PL:	0,2279%	Status:	456,23
ETL:	146.684,09	VAR / CD:	0,002%	Benchmark:	

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	381.047,34	Cenário Baixa - 10000 (+):	698.824,87	CENARIO BRADESCO 1 (+):	300.037,82	CENARIO BRADESCO 2 (+):	568.003,81
Cenário Alta - 09999 (-):	-781.320,96	Cenário Baixa - 10000 (-):	-587.261,80	CENARIO BRADESCO 1 (-):	-482.258,92	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-337.064,77
Cenário Alta - 09999:	-400.273,62	Cenário Baixa - 10000:	111.563,08	CENARIO BRADESCO 1:	-182.221,10	CENARIO BRADESCO 2:	230.939,04

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

Produto	Mm	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
CAXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CNHG25	-1.606,09	6.637,38	2.658,62	2,27%	55.032,05	-54.777,81	72.796,67	-73.359,34
COMPROMISSADA_PRE	52.510,99	1,47	-0,65	0,00%	-1,48	1,51	6,11	-9,31
CONTAS_A PAGAR_RECEBER	-15.198,03	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DAPK29	141,52	18.848,77	9.844,67	8,42%	35.171,29	-32.139,29	-44.739,92	42.508,45
DAPK35	15,46	3.487,21	1.131,37	0,97%	8.265,93	-7.790,16	-11.454,72	10.104,95
DAPQ28	273,67	35.010,04	19.382,92	16,57%	57.586,37	-53.600,79	-72.357,83	69.395,79
DAPQ32	18,73	3.289,36	1.286,28	1,10%	7.647,39	-7.091,18	-10.202,23	9.308,21
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DHF26	2.188,59	25.497,81	16.259,07	13,90%	43.368,59	-36.660,84	-84.782,20	123.182,22
DHF27	3.147,53	21.538,33	13.152,69	11,24%	37.288,43	-30.851,31	-70.067,60	96.997,93
DHF28	2.279,53	13.920,68	8.055,58	6,89%	24.669,34	-20.914,30	-46.118,25	60.929,25
DHF29	902,42	5.268,84	2.881,29	2,46%	9.518,89	-8.210,74	-17.937,33	22.659,84
DHF30	439,25	2.797,67	1.486,13	1,27%	5.169,74	-4.550,44	-9.843,80	11.901,25
DHNG26	570,20	4.323,48	2.685,52	2,30%	7.196,39	-5.992,76	-13.943,57	19.773,28
DOLG25	-403,60	16.344,33	12.994,14	11,11%	34.832,14	-34.629,22	-44.803,69	-45.028,49
EUPG25	-683,16	5.069,03	-459,11	-0,39%	-304.174,23	-235.041,23	-346,57	328,12
LFT20270301 - 210100	18.551.930,04	14.135,05	182,73	0,16%	-102.117,62	176.772,93	7.313,25	-11.128,66
LFT20270901 - 210100	26.066.506,11	25.469,37	-36,59	-0,03%	-170.565,42	315.266,84	14.554,35	-22.142,94
NTNB20250515 - 760199_NEGOCIACAO	297.569,74	1.200,03	-600,16	-0,51%	-1.541,30	1.672,02	749,05	-1.013,49
NTNB20260815 - 760199_NEGOCIACAO	34.860,64	444,35	-264,42	-0,23%	-663,38	664,95	623,73	-828,14
NTNB20270515 - 760199_NEGOCIACAO	16.966,18	284,18	-168,40	-0,14%	-437,72	391,74	440,97	-579,81
NTNB20280815 - 760199_NEGOCIACAO	1.646.746,04	34.074,50	-18.935,69	-1,19%	-54.015,85	57.770,10	63.176,04	-81.707,24
NTNB20290515 - 760199_NEGOCIACAO	4.136,50	88,44	-47,04	-0,04%	-179,94	145,33	185,21	-237,71
NTNB20300815 - 760199_NEGOCIACAO	4.159,71	89,83	-43,31	-0,04%	-210,61	177,73	224,92	-284,79
NTNB20320815 - 760199_NEGOCIACAO	175.154,61	4.483,20	-1.786,67	-1,53%	-10.608,42	9.862,34	12.199,19	-15.103,72
NTNB20350515 - 760199_NEGOCIACAO	121.990,94	3.799,14	-1.226,31	-1,05%	-9.087,79	8.610,50	10.830,42	-13.046,55
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
SWG25	51,57	4.645,08	-214,59	-0,18%	27.435,10	-27.308,36	36.291,29	-36.571,80
T10H25	0,00	14.047,85	-7.413,50	-6,34%	0,00	0,00	0,00	0,00
UNI_PREV	17.385.891,97	31.156,77	25.662,29	21,94%	0,00	0,00	0,00	0,00
WDOG25	-322,88	13.075,47	10.395,31	8,89%	27.865,71	-27.703,38	35.842,95	-36.022,79
WING25	31,68	27.248,39	13.065,26	11,17%	-127.717,20	127.468,89	-100.464,90	100.914,52
WSPH25	0,00	59.913,97	7.041,78	6,02%	0,00	0,00	0,00	0,00
<b>Total Var:</b>	<b>64.351.269,86</b>	<b>396.190,02</b>	<b>116.989,20</b>	<b>100,01%</b>	<b>-400.273,62</b>	<b>111.563,08</b>	<b>-182.221,10</b>	<b>230.939,04</b>

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2024

## Relatório de Risco de Mercado



Data: 31/12/2024

FUNDO: FIM EMB III A IMOBILIÁRIO  
CNPJ: 32711990000162

Dados Gerais	
PL:	66.473.732,83
VAR:	1.403.312,98
ETL:	1.759.811,09
VAR / PL:	2,1111%
ETL / PL:	2,6474%
VAR / CDI:	0,0235%
Limite Fundo:	
Status:	ENQUADRADO
Benchmark:	
0,00% Dutation DC:	2,00
Dutation DU:	1,00

Cenários de STRESS			
Cenário Alta - 09999 (+):	31.064.069,91	Cenário Baixa - 10000 (-):	17,55
Cenário Alta - 09999 (-):	-17,20	Cenário Baixa - 10000 (-):	-31.063.270,39
Cenário Alta - 09999:	31.064.052,70	Cenário Baixa - 10000:	-31.063.252,84
CENARIO BRADESCO 1 (+):	8.100.112,53	CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00
CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-8.166.452,81
CENARIO BRADESCO 1:	8.100.112,53	CENARIO BRADESCO 2:	-8.166.452,81

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

Produto	IMM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
AIEC11	2.853.525,62	316.825,56	107.508,35	7,66%	1.426.762,81	-1.426.762,81	418.326,86	-421.751,09
BMLC11	3.607.207,88	114.522,94	46.521,53	3,32%	3.607.207,88	-3.607.207,88	528.816,68	-533.145,33
BPML11	4.747.580,16	443.540,72	157.531,56	11,23%	4.747.580,16	-4.747.580,16	695.995,25	-701.692,35
BRCR11	24.936,00	1.034,12	796,13	0,06%	6.483,36	-6.483,36	3.655,62	-3.655,54
CAKA	1.800,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CBOP11	16.177,92	1.805,99	434,38	0,03%	8.088,96	-8.088,96	2.371,68	-2.391,10
CEOC11	510.872,70	25.282,71	8.747,59	0,62%	255.436,35	-255.436,35	74.893,94	-75.506,99
CNES11	195.784,60	17.872,60	-712,26	-0,05%	97.892,30	-97.892,30	28.702,02	-28.936,96
COMPROMISSADA_PRE	609.946,40	17,10	-1,55	0,00%	-17,20	17,55	71,02	-108,09
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-504.290,85	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPUR11	6.011.743,50	426.308,63	251.166,80	17,90%	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
FIGS11	616.109,76	31.722,19	13.196,24	0,94%	308.054,88	-308.054,88	90.321,69	-91.061,02
FMOF11	799,52	118,89	75,62	0,01%	1.599,04	-799,52	117,21	-118,17
FVPQ11	443.312,80	46.536,66	-14.125,96	-1,01%	221.656,40	-221.656,40	64.989,66	-65.521,63
GARE11	1.396.677,50	128.072,08	40.624,67	2,89%	0,00	0,00	204.752,92	-206.428,93
HOFC11	493.357,26	51.960,21	22.629,44	1,61%	0,00	0,00	72.326,17	-72.918,20
HSRE11	4.884.740,02	304.530,50	34.038,81	2,43%	4.884.740,02	-4.884.740,02	716.102,89	-721.964,58
JSRE11	88.567,59	4.019,20	388,66	0,03%	23.027,57	-23.027,57	12.984,01	-13.090,29
MALL11	5.223.233,40	206.751,54	118.336,21	8,43%	1.358.040,68	-1.358.040,68	765.726,02	-771.993,90
NEWL11	5.878.067,20	303.458,23	209.434,04	14,92%	2.939.033,60	-2.939.033,60	861.724,65	-868.778,33
NEWU11	2.076.321,59	265.398,93	44.838,44	3,20%	2.076.321,59	-2.076.321,59	304.388,75	-306.880,33
OUTRAS_DESPESAS	1.065.941,76	45.059,97	-5.357,16	-0,38%	532.970,88	-532.970,88	156.267,06	-157.546,19
PATC11	4.199.856,12	315.718,14	50.963,10	3,63%	2.099.928,06	-2.099.928,06	615.698,91	-620.738,74
QAQR11	4.962.218,17	66.148,82	9.539,63	0,68%	2.481.109,09	-2.481.109,09	727.461,18	-733.415,85
RBRP11	1.797.650,55	125.476,94	75.887,87	5,41%	898.825,28	-898.825,28	263.535,57	-265.692,75
RCRB11	5.102.662,51	494.425,68	81.876,79	5,83%	0,00	0,00	0,00	0,00
SARE11	1.396.505,94	72.354,03	-13.903,47	-0,99%	698.252,97	-698.252,97	204.727,77	-206.403,58
VSHO11	24.620,96	1.159,82	612,20	0,04%	12.310,48	-12.310,48	3.609,43	-3.638,98
VVMR11	3.991.110,50	204.279,63	43.792,39	3,12%	0,00	0,00	585.096,80	-589.886,13
XPNI11	2.752.134,00	179.369,29	84.871,81	6,05%	1.376.067,00	-1.376.067,00	403.462,84	-406.765,41
XPPR11	2.005.361,10	109.129,88	33.601,10	2,39%	1.002.680,55	-1.002.680,55	293.985,94	-296.392,37
Total Var:	66.473.732,18	4.302.901,02	1.403.312,98	100,00%	31.064.052,70	-31.063.252,84	8.100.112,53	-8.166.452,81

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2024



Data: 31/12/2024

## Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIA RVA EMB II CNPJ: 13294268000125

Dados Gerais		Limite Fundo:		ENQUADRADO		0,00% Dutation DC:		2,00	
PL:	89.516.138,69	VAR / PL:	3,6047%	Status:		Dutation DU:			
VAR:	3.226.785,26	ETL / PL:	4,5204%	Benchmark:					1,00
ETL:	4.046.518,89	VAR / CDI:	0,04%						

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	21.832.145,56	Cenário Baixa - 10000 (+):	171.845,02	CENÁRIO BRADESCO 1 (+):	12.544.025,21	CENÁRIO BRADESCO 2 (+):	78.340,70
Cenário Alta - 09999 (-):	-104.530,79	Cenário Baixa - 10000 (-):	-21.662.374,82	CENÁRIO BRADESCO 1 (-):	-57.716,48	CENÁRIO BRADESCO 2 (-):	-12.646.852,87
Cenário Alta - 09999:	21.727.614,77	Cenário Baixa - 10000:	-21.490.529,80	CENÁRIO BRADESCO 1:	12.486.308,72	CENÁRIO BRADESCO 2:	-12.568.512,17

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENÁRIO BRADESCO 1	CENÁRIO BRADESCO 2
ABEV3	2.389.148,70	201.192,00	8.993,44	0,25%	334.480,82	-716.744,51	350.249,20	-353.116,18
B3SA3	2.255.219,28	317.828,88	-148.140,54	-4,59%	563.804,82	-563.804,82	330.615,15	-333.321,41
BBAS3	3.267.784,00	90.870,21	38.155,22	1,18%	816.946,00	-816.946,00	479.057,13	-482.978,48
BBDC4	1.755.732,80	188.035,96	134.664,46	4,17%	438.933,20	-438.933,20	257.390,43	-259.497,31
BBSE3	991.332,00	106.663,18	-60.020,84	-1,86%	198.263,66	-198.266,40	145.329,27	-146.518,87
BPAC11	2.110.720,00	278.355,78	230.052,07	7,13%	633.216,00	-738.752,00	309.431,55	-311.964,42
BRFS3	245.992,00	29.504,24	-882,81	-0,03%	61.498,00	-61.498,00	36.062,43	-36.357,62
CAIXA	10.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CMG4	726.927,30	50.075,20	40.307,27	1,25%	181.731,83	-218.084,73	106.567,54	-107.439,86
COMPROMISSADA_PRE	2.474.818,53	69,38	51,94	0,00%	-69,80	71,19	288,14	-438,56
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	1.435.107,31	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPFE3	559.143,00	21.604,59	15.581,72	0,48%	111.828,60	-111.828,60	81.970,36	-82.641,34
CPLE6	1.489.620,00	79.037,54	21.290,78	0,66%	327.716,40	-327.716,40	218.378,29	-220.165,84
CXSE3	537.225,00	55.510,12	4.116,18	0,13%	107.441,23	-107.445,00	78.757,19	-79.401,86
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DIRR3	986.860,00	126.909,80	108.120,43	3,35%	296.058,00	-296.058,00	144.673,68	-145.857,91
ELET3	3.703.855,86	251.699,55	-55.117,66	-1,71%	1.232.484,35	-1.045.826,51	542.985,27	-547.429,90
ENEV3	336.960,00	30.761,08	9.563,13	0,30%	124.675,20	-171.849,60	49.399,34	-49.802,69
ENGI11	687.584,00	39.019,29	33.447,11	1,04%	113.489,28	-146.868,48	97.867,81	-98.868,92
EOTL3	2.011.160,00	218.209,01	196.478,06	6,09%	402.232,00	-402.232,00	294.836,06	-297.249,45
GGBR4	1.446.120,80	200.989,66	123.752,52	3,84%	361.530,20	-361.530,20	212.001,31	-213.736,65
GMAT3	708.651,00	45.288,31	24.791,50	0,77%	127.557,18	-113.384,16	103.888,24	-104.738,62
ITSA4	2.501.856,88	194.264,73	116.691,95	3,62%	475.352,81	-475.352,81	366.772,22	-369.774,45
ITUB4	7.791.192,01	506.923,97	371.591,96	11,52%	1.558.238,40	-1.480.326,48	1.142.188,75	-1.151.538,18
JBSS3	2.276.010,00	242.620,68	-17.310,94	-0,54%	796.603,50	-796.603,50	333.663,07	-336.394,28
LREN3	781.921,80	128.072,44	75.218,23	2,33%	167.990,61	-148.642,56	114.629,74	-115.568,04
LWSA3	310.088,00	56.187,81	42.100,62	1,30%	124.035,20	-124.035,20	45.458,90	-45.831,01
MRF3	1.970.371,00	334.829,51	98.959,12	3,07%	788.148,40	-591.111,30	288.856,39	-291.220,83
MRFMG200	115.774,57	81.551,59	-24.069,36	-0,75%	-104.460,99	171.773,83	-57.716,48	78.340,70
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PETR3	1.915.326,00	188.015,94	59.374,22	1,84%	478.831,50	-574.597,80	280.786,79	-283.085,18
PETR4	9.274.013,21	872.988,33	248.499,24	7,70%	2.318.503,30	-2.782.229,59	1.359.570,34	-1.370.699,15
PRI03	1.160.335,00	94.401,47	-26.450,25	-0,82%	614.977,55	-382.910,55	170.105,11	-171.497,51
RADL3	1.040.512,00	99.054,94	82.073,15	2,54%	208.102,40	-208.102,40	152.539,06	-153.787,67
RAIL3	1.118.568,00	108.355,05	86.217,61	2,67%	503.355,60	-369.133,71	163.982,07	-165.324,35
RDOR3	1.753.980,00	103.166,77	80.372,81	2,49%	526.194,00	-526.194,00	257.133,47	-259.236,24
RENT3	2.665.160,00	755.693,46	488.169,74	15,13%	879.832,80	-693.201,60	390.859,06	-394.055,45
SBS3	2.725.800,00	276.431,24	229.681,92	7,12%	681.450,00	-681.450,00	399.602,28	-402.873,24
SRNA3	436.150,00	68.292,06	44.527,95	1,38%	0,00	0,00	63.939,59	-64.462,97
SUZB3	3.675.910,00	193.196,09	16.839,94	0,52%	918.977,50	-735.182,00	538.888,41	-543.299,50
TIMS3	616.848,00	38.073,35	25.250,58	0,78%	197.391,36	-141.875,04	90.429,92	-91.170,13
TOTS3	666.075,00	82.395,95	42.130,93	1,31%	133.215,00	-133.215,00	97.646,60	-98.445,89
VALE3	10.593.337,25	818.026,41	365.940,21	11,34%	2.648.334,31	-2.648.334,31	1.552.983,24	-1.565.695,25
VBBR3	881.296,00	89.955,88	76.053,51	2,36%	220.324,00	-220.324,00	129.197,99	-130.255,55
VIVT3	1.730.490,00	94.391,57	59.292,74	1,84%	286.376,30	-239.760,00	253.689,83	-255.766,42
WEGE3	3.488.097,00	200.298,59	-38.664,57	-1,20%	872.024,25	-872.024,25	511.355,02	-515.540,74
<b>Total Var:</b>	<b>89.600.073,30</b>	<b>7.958.831,59</b>	<b>3.226.785,26</b>	<b>100,00%</b>	<b>21.727.614,77</b>	<b>-21.490.529,80</b>	<b>12.486.308,72</b>	<b>-12.568.512,17</b>

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2024

## Relatório de Risco de Mercado



Data: 31/12/2024

FUNDO: FIA RVA EMB III  
CNPJ: 38452593000108

Dados Gerais			
PL:	95.536.259,77	VAR / PL:	7,5607%
VAR:	7.223.223,88	ETL / PL:	9,4814%
ETL:	9.058.214,16	VAR / CDI:	0,084%
Limite Fundo:		Status:	ENQUADRADO
Benchmark:		Dutacion DC:	0,00%
		Dutacion DU:	2,00

Cenários de STRESS			
Cenário Alta - 09999 (+):	24.994.899,13	Cenário Baixa - 10000 (-):	692.674,12
Cenário Alta - 09999 (-):	-696.730,72	Cenário Baixa - 10000 (-):	-22.872.235,86
Cenário Alta - 09999:	24.298.168,40	Cenário Baixa - 10000:	-22.179.561,75
CENARIO BRADESCO 1 (+):	13.555.060,82	CENARIO BRADESCO 2 (+):	900.569,83
CENARIO BRADESCO 1 (-):	-896.073,71	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-13.664.527,99
CENARIO BRADESCO 1:	12.658.987,11	CENARIO BRADESCO 2:	-12.763.958,16

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

Produto	Mm	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
ALOS3	4.542.965,94	538.434,08	514.908,73	7,13%	0,00	0,00	666.998,81	-671.450,37
ALPA4	1.230.024,00	132.230,55	66.611,59	0,92%	307.506,00	-307.506,00	190.321,52	-181.797,55
ASA3	1.309.538,00	244.476,65	201.702,84	2,79%	366.670,64	-340.479,88	191.978,27	-193.549,72
AZZA3	2.926.852,26	642.897,68	608.455,45	8,42%	0,00	0,00	0,00	0,00
BBAS3	1.584.246,82	44.054,58	12.849,18	0,18%	396.061,71	-396.061,71	232.250,58	-234.151,68
BBSE3	589.734,00	63.452,91	-49.955,03	-0,69%	117.945,17	-117.946,80	86.455,00	-87.162,69
BPAC11	2.539.691,20	334.927,29	316.325,19	4,38%	761.907,36	-888.891,92	372.318,73	-375.366,36
CAIXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	3.118.128,21	87,41	73,17	0,00%	-87,95	89,69	363,04	-552,56
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	629.135,01	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPLE3	2.682.210,64	151.682,74	-44.671,94	-0,62%	590.086,34	-590.086,34	393.212,08	-396.430,73
CPLE6	3.689.893,05	195.781,52	-4.255,32	-0,06%	811.776,47	-811.776,47	540.938,32	-545.366,19
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DOLG25	8.072,04	326.886,66	238.469,11	3,30%	-696.642,77	692.584,42	-896.073,71	900.569,83
ELET3	4.060.002,41	275.901,88	-113.898,53	-1,58%	1.350.994,65	-1.146.388,61	595.196,35	-600.068,36
ENEV3	1.549.120,95	141.419,27	48.741,15	0,67%	573.174,75	-790.051,68	227.101,13	-228.960,08
ENGH1	4.104.000,00	239.872,66	209.279,91	2,90%	697.680,00	-902.880,00	601.646,40	-606.571,20
EQTL3	8.502.192,60	922.480,08	845.914,06	11,71%	1.700.438,52	-1.700.438,52	1.246.421,44	-1.256.624,07
FLRY3	1.239.589,00	65.970,64	40.234,86	0,56%	247.917,60	-247.917,60	181.723,75	-183.211,25
GGPS3	1.118.400,00	185.531,20	166.827,02	2,31%	503.280,00	-503.280,00	163.957,44	-165.299,52
HAPV3	4.485.274,82	683.846,61	561.618,41	7,78%	1.524.993,44	-1.525.194,57	657.541,29	-662.923,62
IGT11	6.519.545,89	626.515,42	594.372,21	8,23%	1.303.909,18	-1.303.909,18	955.765,43	-963.588,88
ITSA4	4.657.780,85	361.668,38	310.529,88	4,30%	884.978,36	-884.978,36	682.830,67	-688.420,01
NTCO3	2.746.832,44	309.363,73	234.385,80	3,24%	686.708,11	-686.708,11	402.685,64	-405.981,84
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PETRA	481.327,00	45.308,63	-5.682,26	-0,08%	120.331,75	-144.399,43	70.562,54	-71.140,13
PRI03	4.244.216,35	345.297,07	-199.732,87	-2,77%	2.249.434,67	-1.400.591,40	622.202,12	-627.295,18
RAIL3	5.685.500,96	550.751,28	409.968,14	5,68%	2.558.475,43	-1.876.247,19	833.494,44	-840.317,04
RECV3	198.086,20	18.617,05	4.597,17	0,06%	118.851,72	-118.851,72	29.039,44	-29.277,14
RENT3	6.556.306,40	1.858.312,29	1.694.340,59	23,46%	2.163.581,11	-1.704.639,66	961.154,52	-969.022,09
SCAR3	118.160,00	8.537,37	299,43	0,00%	70.896,00	-70.896,00	17.322,26	-17.464,05
SMFT1	7.018,96	36.060,94	-29.293,54	-0,41%	0,00	0,00	0,00	0,00
SMFT3	4.686.048,00	461.358,40	317.936,28	4,40%	1.874.419,20	-1.874.419,20	686.974,64	-692.597,89
SUZB3	6.085.762,46	319.851,55	-66.380,27	-0,92%	1.521.440,62	-1.217.152,49	892.172,78	-899.475,69
VBBR3	2.444.080,00	249.472,79	237.840,80	3,29%	611.020,00	-611.020,00	358.302,13	-361.235,02
WDOF25	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
WDOG25	-4.762,50	192.863,13	-140.696,77	-1,95%	411.019,24	-408.624,81	528.683,49	-531.336,20
YDUQ3	1.203.592,05	266.366,99	241.509,46	3,34%	469.400,90	-300.898,01	176.446,60	-177.890,91
<b>Total Var:</b>	<b>95.539.566,01</b>	<b>10.840.279,47</b>	<b>7.223.223,88</b>	<b>99,97%</b>	<b>24.298.168,40</b>	<b>-22.179.561,75</b>	<b>12.658.987,11</b>	<b>-12.763.958,16</b>



# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2024



Data: 31/12/2024

## Relatório de Risco de Mercado

FUNDO: FIA RVA EMB IV  
CNPJ: 38452613000132

Dados Gerais							
PL:	86.311.912,41	VAR / PL:	6,6387%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	2,00
VAR:	5.730.031,25	ETL / PL:	8,3253%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1,00
ETL:	7.185.690,36	VAR / CDI:	0,0737%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	24.387.168,67	Cenário Baixa - 10000 (+):	121,76	CENARIO BRADESCO 1 (+):	12.054.912,72	CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00
Cenário Alta - 09999 (-):	-119,40	Cenário Baixa - 10000 (-):	-20.976.274,65	CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-12.153.841,92
Cenário Alta - 09999:	24.387.049,28	Cenário Baixa - 10000:	-20.976.152,89	CENARIO BRADESCO 1:	12.054.912,72	CENARIO BRADESCO 2:	-12.153.841,92

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

Produto	Mm	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
AURE3	413.663,36	39.140,03	35.934,75	0,63%	124.099,01	-128.240,36	60.643,05	-61.139,45
CAXA	1.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA_PRE	4.233.003,19	118,66	100,22	0,00%	-119,40	121,76	492,84	-750,12
CONTAS_A_PAGAR_RECEBER	-148.697,41	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPLE3	1.409.542,64	79.711,60	-18.252,72	-0,32%	310.099,38	-310.099,38	206.638,95	-208.330,40
CPLE6	1.004.441,25	53.294,51	2.438,86	0,04%	220.977,08	-220.977,08	147.251,09	-148.456,42
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
ENG11	10.304.943,36	602.308,53	551.213,51	9,62%	1.751.840,37	-2.267.087,54	1.510.704,70	-1.523.070,63
ENG14	13,30	0,62	0,40	0,00%	10,64	-10,64	1,95	-1,97
EQTL3	12.411.569,80	1.346.643,91	1.277.295,97	22,29%	2.482.313,96	-2.482.313,96	1.819.536,13	-1.834.430,02
GGPS3	4.296.641,16	712.769,14	646.520,50	11,28%	1.933.488,52	-1.933.488,52	629.887,59	-635.043,56
GMAT3	4.526.279,82	289.264,50	185.990,19	3,25%	814.730,37	-724.204,77	663.552,62	-668.984,16
HAPV3	4.000.711,43	609.967,74	473.983,29	8,27%	1.360.241,89	-1.360.421,29	586.504,30	-591.305,15
ITUB4	6.156.263,82	400.549,45	357.126,27	6,23%	1.231.252,76	-1.169.690,13	902.508,28	-909.895,79
MATD3	551.802,16	60.330,09	52.762,20	0,92%	165.540,65	-165.540,65	80.894,20	-81.556,36
MULT3	5.650.789,12	748.841,14	723.407,61	12,62%	1.695.236,74	-1.412.697,28	828.405,69	-835.186,63
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PRIO3	10.769.073,15	876.140,40	-470.286,33	-8,21%	5.707.608,77	-3.553.794,14	1.578.746,12	-1.591.669,01
RAIL3	6.103.563,52	591.248,77	466.256,88	8,14%	2.746.603,58	-2.014.210,17	894.782,41	-902.106,69
RENT3	2.328.736,20	660.054,43	580.206,11	10,13%	768.482,95	-605.471,41	341.392,73	-344.187,21
SBSF3	3.366.274,50	341.383,61	282.498,62	4,93%	841.568,63	-841.568,63	493.495,84	-497.535,37
UGPA3	8.932.293,56	882.491,71	582.834,93	10,17%	2.233.073,39	-1.786.458,71	1.309.474,24	-1.320.192,99
<b>Total Var:</b>	<b>86.311.907,93</b>	<b>8.294.258,83</b>	<b>5.730.031,25</b>	<b>99,99%</b>	<b>24.387.049,28</b>	<b>-20.976.152,89</b>	<b>12.054.912,72</b>	<b>-12.153.841,92</b>

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2024



Data: 31/12/2024

## Relatório de Risco de Mercado

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

Dados Gerais		Limite Fundo:	Status:	ENQUADRADO	0,00%	Dutacion DC:	4,04
PL:	110.789.173,29	VAR / PL:	3,6887%			Dutacion DU:	2,40
VAR:	4.086.704,36	ETL / PL:	4,6258%				
ETL:	5.124.692,14	VAR / CDI:	0,041%				

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	27.803.728,42	Cenário Baixa - 10000 (+):	1.857,24	CENARIO BRADESCO 1 (+):	15.891.761,14	CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00
Cenário Alta - 09999 (-):	-1.586,73	Cenário Baixa - 10000 (-):	-27.835.538,31	CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-16.020.060,56
Cenário Alta - 09999:	27.802.141,69	Cenário Baixa - 10000:	-27.833.681,06	CENARIO BRADESCO 1:	15.891.761,14	CENARIO BRADESCO 2:	-16.020.060,56

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
ABEV3	2.817.623,48	237.274,18	13.311,58	0,33%	394.467,29	-645.287,04	413.063,60	-416.444,75
ALOS3	496.232,11	58.813,62	40.881,20	1,00%	0,00	0,00	72.747,63	-73.343,11
ALPA4	57.507,12	6.182,15	1.919,33	0,05%	14.376,78	-14.376,78	8.430,54	-8.499,55
AMOB3	10.317,30	37.537,25	-28.820,96	-0,71%	0,00	0,00	0,00	0,00
ASA3	414.351,11	77.354,89	52.112,73	1,28%	116.018,31	-107.731,29	60.743,87	-61.241,09
AURE3	139.022,04	13.154,00	10.838,94	0,27%	41.706,61	-43.098,42	20.380,63	-20.547,46
AZUL4	63.146,52	21.496,15	16.761,16	0,41%	37.887,91	-22.101,28	9.257,28	-9.333,06
AZZA3	205.610,58	45.163,39	34.770,24	0,85%	0,00	0,00	0,00	0,00
B3SA3	3.106.144,56	437.750,09	-195.812,02	-4,79%	776.536,14	-776.536,14	455.360,79	-459.088,17
B3AS3	3.752.150,80	104.339,43	46.462,00	1,14%	938.037,70	-938.037,70	550.065,31	-554.567,89
BBDG3	862.594,80	64.623,71	37.164,99	0,91%	215.646,20	-215.646,20	126.454,93	-127.490,03
BBDCA	3.238.522,44	346.840,18	247.437,57	6,05%	809.630,61	-809.630,61	474.767,39	-478.653,62
BBSÉ3	1.259.208,72	135.485,59	-72.577,99	-1,78%	251.838,26	-251.841,74	184.600,00	-186.111,05
BEF3	72.267,82	10.601,99	1.537,93	0,04%	18.066,96	-18.066,96	10.594,46	-10.681,18
BPAC11	1.912.132,80	252.166,66	199.871,90	4,89%	573.639,84	-669.246,48	280.318,67	-282.613,23
BRAP4	227.228,90	17.047,16	11.450,57	0,28%	56.807,23	-56.807,23	33.311,76	-33.584,43
BRAP3	595.056,00	173.731,76	-11.832,34	-0,29%	0,00	0,00	0,00	0,00
BRFS3	1.127.987,44	135.290,61	-2.744,08	-0,07%	281.996,86	-281.996,86	165.362,96	-166.716,54
BRKM5	167.875,26	31.506,81	21.806,82	0,53%	92.331,39	-50.362,58	24.610,51	-24.811,96
CAIXA	9.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CCRO3	550.034,28	58.406,29	47.024,31	1,15%	137.508,57	-137.508,57	80.635,03	-81.295,07
CMG4	1.127.731,66	77.685,06	60.884,36	1,49%	281.932,92	-338.329,65	165.325,46	-166.678,74
CMN3	311.878,85	44.820,14	312,42	0,01%	109.157,60	-109.157,60	45.721,44	-46.095,69
COGN3	110.872,62	29.889,99	21.935,99	0,54%	27.718,16	-38.805,42	16.253,93	-16.386,97
COMPROMISSADA PRE	1.993.231,57	55,88	40,41	0,00%	-56,22	57,34	232,07	-383,22
CONTAS_A PAGAR_RECEBER	1.690.434,43	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
CPFE3	323.260,47	12.490,38	9.112,13	0,22%	64.652,09	-64.652,09	47.389,99	-47.777,90
CPLÉ6	839.082,45	44.520,76	13.388,50	0,33%	184.598,14	-184.598,14	123.009,49	-124.016,39
CRFB3	156.899,85	17.084,08	7.146,76	0,17%	39.224,96	-39.224,96	23.001,52	-23.189,80
CSAN3	519.269,76	98.415,97	67.731,74	1,66%	129.817,44	-129.817,44	76.124,95	-76.748,07
CSNA3	355.658,12	75.608,71	63.187,14	1,55%	142.259,23	-106.701,45	52.139,48	-52.566,27
CVCB3	39.421,08	23.601,25	19.781,40	0,48%	19.710,54	-19.710,54	5.779,13	-5.826,44
CXSE3	402.078,00	41.545,72	3.985,35	0,10%	80.412,78	-80.415,60	58.944,64	-59.427,13
CYRE3	244.622,40	40.751,70	26.588,68	0,65%	78.279,17	-70.940,50	35.861,64	-36.155,19
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
EGIE3	493.947,00	17.290,03	9.300,52	0,23%	88.910,46	-88.910,46	72.412,63	-73.005,37
ELET3	3.317.674,91	225.456,21	-42.140,22	-1,03%	1.103.979,90	-936.783,86	486.371,14	-490.352,35
ELET6	554.393,84	31.363,50	-6.507,09	-0,16%	200.982,42	-147.652,78	81.274,14	-81.939,41
EMBR3	2.254.061,85	278.455,50	147.707,91	3,61%	563.515,46	-563.515,46	330.445,47	-333.150,34
ENEV3	1.039.953,33	94.937,35	32.621,91	0,80%	384.762,73	-530.376,20	152.457,16	-153.705,10
ENGI11	649.854,72	37.983,04	32.254,72	0,73%	110.475,30	-142.988,04	95.268,70	-96.048,53
EQTL3	1.862.268,40	202.054,41	178.708,58	4,37%	372.453,68	-372.453,68	273.008,55	-275.243,27
EZIC3	57.442,32	14.031,74	9.133,84	0,22%	11.488,46	-17.232,70	8.421,04	-8.489,98
FLRY3	305.696,89	16.269,12	10.234,18	0,25%	61.139,38	-61.139,38	44.815,16	-45.182,00
GGBR4	1.230.998,54	171.090,81	103.353,95	2,53%	307.749,64	-307.749,64	180.464,39	-181.941,58
GOAU4	369.748,25	46.462,88	23.219,17	0,57%	110.924,48	-92.437,06	54.205,09	-54.648,79
HAPV3	582.045,61	88.741,48	52.642,51	1,29%	197.895,51	-197.921,61	85.327,89	-86.026,34
HYPE3	403.804,98	46.845,94	-9.704,48	-0,24%	100.288,28	-80.037,76	59.197,81	-59.682,38
IGTI11	199.382,15	19.160,23	16.335,31	0,40%	39.876,43	-39.876,43	29.229,42	-29.468,68
IRBR3	189.878,85	18.677,58	-8.365,41	-0,20%	123.421,25	-104.433,37	27.836,24	-28.064,09
ISAE4	496.647,84	25.820,16	23.027,80	0,56%	0,00	0,00	0,00	0,00
ITSA4	2.787.101,20	216.413,44	125.228,89	3,06%	529.549,23	-529.549,23	408.589,04	-411.933,56
ITUB4	7.476.639,73	486.458,02	346.199,23	8,47%	1.495.327,95	-1.420.561,55	1.096.075,38	-1.105.047,35
JBS3	2.265.301,50	241.479,16	-16.467,59	-0,40%	792.855,53	-792.855,53	332.093,20	-334.811,56
KLBN11	970.283,60	116.664,20	-50.759,90	-1,24%	242.573,40	-194.088,72	142.245,04	-143.409,39
LFT20250901 - 210100	932.785,46	267,08	194,14	0,00%	-1.530,51	1.799,91	49,66	-75,61
LRNS3	693.470,04	113.584,76	66.882,12	1,64%	148.987,35	-131.827,97	101.662,71	-102.494,87
LWSA3	75.868,64	13.747,37	10.046,11	0,25%	30.347,46	-30.347,46	11.122,34	-11.213,39
MGLU3	124.787,00	33.408,60	28.287,54	0,69%	64.889,24	-56.154,15	18.293,77	-18.443,52
MRF3	280.858,76	47.726,95	13.783,14	0,34%	112.343,50	-84.257,63	41.173,89	-41.510,93
MRVE3	108.265,59	23.803,72	3.541,00	0,09%	32.479,68	-32.479,68	15.871,74	-16.001,65
MULT3	365.506,12	48.436,78	40.056,23	0,98%	109.651,84	-91.376,53	53.583,20	-54.021,81
NTCO3	591.821,56	66.654,27	44.710,88	1,09%	147.955,39	-147.955,39	86.761,04	-87.471,23
OUTRAS DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
PCAR3	52.583,55	8.892,40	910,93	0,02%	19.035,25	-19.035,25	7.708,75	-7.771,85
PETR3	5.269.353,46	517.260,47	178.545,79	4,37%	1.317.338,37	-1.580.806,04	772.487,22	-778.810,44
PETR4	8.757.437,15	824.361,61	257.688,88	6,31%	2.189.359,29	-2.627.255,34	1.283.840,29	-1.294.349,21
PETZ3	68.034,12	10.684,00	3.502,21	0,09%	25.852,97	-34.697,40	9.973,80	-10.055,44
PRIO3	1.751.624,05	142.507,03	-31.971,10	-0,78%	926.360,75	-976.035,94	256.788,09	-258.890,04
RADL3	1.537.536,00	146.370,76	117.711,74	2,89%	307.507,20	-307.507,20	225.402,78	-227.247,82
RAIL3	1.184.754,40	114.766,49	88.241,57	2,43%	533.139,48	-390.975,59	173.685,00	-175.106,70
RAZ4	139.987,44	17.355,58	12.672,81	0,31%	48.995,60	-48.995,60	20.522,16	-20.690,14
RDR3	1.589.817,64	93.529,08	71.577,57	1,75%	476.945,29	-476.945,29	233.067,27	-234.975,05
RECV3	243.603,88	22.895,01	8.847,15	0,22%	146.162,33	-146.162,33	35.712,33	-36.004,65
RENT3	1.719.158,00	487.276,26	299.166,17	7,32%	567.322,14	-446.981,08	252.028,56	-254.091,55
SANB11	463.108,44	23.650,42	12.699,03	0,31%	92.621,69	-92.621,69	67.891,70	-68.447,43
SBS3	3.303.085,50	334.975,43	269.038,61	6,58%	825.771,38	-825.771,38	484.232,33	-488.196,04
SLECE3	185.727,50	17.056,65	-5.083,51	-0,12%	55.718,25	-55.718,25	27.227,65	-27.450,53
SMT03	179.939,36	11.082,86	676,20	0,02%	53.981,81	-53.981,81	26.379,11	-26.595,04
STBP3	612.580,15	50.226,36	-11.298,01	-0,28%	216.922,42	-213.190,02	89.804,25	-90.539,35
SUZB3	2.128.568,12	111.871,90	5.645,36	0,14%	532.142,03	-425.713,62	312.048,09	-314.602,37
TAE11	391.559,76	14.928,27	12.375,36	0,30%	97.889,94	-97.889,94	57.402,66	-57.872,53
TIMS3	638.524,56	39.411,28	26.292,15	0,64%	204.327,86	-146.860,65	93.607,70	-94.373,93
TOTS3	789.232,00	97.630,92	47.681,79	1,17%	157.846,40	-157.846,40	115.701,41	-116.648,49

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2024

## Relatório de Risco de Mercado



Data: 31/12/2024

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

Dados Gerais							
PL:	110.789.173,29	VAR / PL:	3,6887%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	4,04
VAR:	4.066.704,36	ETL / PL:	4,6258%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	2,40
ETL:	5.124.692,14	VAR / CDI:	0,041%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	27.803.728,42	Cenário Baixa - 10000 (+):	1.857,24	CENARIO BRADESCO 1 (+):	15.891.761,14	CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00
Cenário Alta - 09999 (-):	-1.586,73	Cenário Baixa - 10000 (-):	-27.835.538,31	CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-16.020.060,56
Cenário Alta - 09999:	27.802.141,69	Cenário Baixa - 10000:	-27.833.681,06	CENARIO BRADESCO 1:	15.891.761,14	CENARIO BRADESCO 2:	-16.020.060,56

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
UGPA3	945.336,40	93.397,24	38.190,18	0,93%	236.334,10	-189.067,28	138.586,32	-139.720,72
USIM5	148.896,16	22.127,57	18.176,35	0,44%	58.069,50	-32.757,16	21.828,18	-22.006,85
VALE3	12.723.351,10	982.507,86	448.862,23	10,98%	3.180.837,78	-3.180.837,78	1.865.243,27	-1.880.511,29
VAO03	125.214,75	19.402,52	13.016,74	0,32%	43.825,16	-50.085,90	18.356,48	-18.506,74
VBBR3	997.006,24	101.766,69	83.584,49	2,05%	249.251,56	-249.251,56	146.161,12	-147.357,52
VIV3	131.670,00	17.805,18	13.120,32	0,32%	39.501,00	-39.501,00	19.302,82	-19.460,83
VIVT3	1.040.258,34	56.742,09	35.689,97	0,87%	172.150,86	-144.128,16	152.501,87	-153.750,18
WEGE3	3.657.119,31	210.004,44	-36.621,01	-0,90%	914.279,83	-914.279,83	536.133,69	-540.522,23
WING25	-163,86	140.939,96	140.653,79	3,44%	660.606,22	-659.425,30	519.646,05	-521.971,64
YDUQ3	134.638,15	29.807,84	17.926,88	0,44%	52.528,38	-33.672,04	19.745,28	-19.906,91
<b>Total Var:</b>	<b>110.788.535,70</b>	<b>10.277.754,05</b>	<b>4.066.704,36</b>	<b>100,00%</b>	<b>27.802.141,69</b>	<b>-27.833.681,07</b>	<b>15.891.761,14</b>	<b>-16.020.060,56</b>

## Relatório de Risco de Mercado



Data: 31/12/2024

FUNDO: FIA EMB VIII ETF  
CNPJ: 45622039000189

Dados Gerais							
PL:	82.874.457,91	VAR / PL:	3,8228%	Limite Fundo:	0,00%	Dutacion DC:	2,00
VAR:	3.168.106,49	ETL / PL:	4,7939%	Status:	ENQUADRADO	Dutacion DU:	1,00
ETL:	3.972.933,35	VAR / CDI:	0,0425%	Benchmark:			

Cenários de STRESS							
Cenário Alta - 09999 (+):	7.431.350,83	Cenário Baixa - 10000 (+):	4,70	CENARIO BRADESCO 1 (+):	6.052.468,76	CENARIO BRADESCO 2 (+):	0,00
Cenário Alta - 09999 (-):	-4,60	Cenário Baixa - 10000 (-):	-7.431.384,42	CENARIO BRADESCO 1 (-):	0,00	CENARIO BRADESCO 2 (-):	-6.102.021,24
Cenário Alta - 09999:	7.431.346,23	Cenário Baixa - 10000:	-7.431.379,73	CENARIO BRADESCO 1:	6.052.468,76	CENARIO BRADESCO 2:	-6.102.021,24

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

Produto	MM	VAR Tot.	Comp. VAR	Comp. VAR (%)	Cenário Alta - 09999	Cenário Baixa - 10000	CENARIO BRADESCO 1	CENARIO BRADESCO 2
BOVA11	41.396.308,82	1.592.170,08	1.591.281,63	50,23%	0,00	0,00	0,00	0,00
BOVV11	41.285.469,00	1.577.718,11	1.576.821,54	49,77%	7.431.350,83	-7.431.384,42	6.052.449,76	-6.101.992,32
CAIXA	9.000,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
COMPROMISSADA PRE	163.209,11	4,58	3,32	0,00%	-4,60	4,70	19,00	-28,92
CONTAS_A PAGAR_RECEBER	20.469,64	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
OUTRAS_DESPESAS	0,00	0,00	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	0,00
<b>Total Var:</b>	<b>82.874.456,56</b>	<b>3.169.892,77</b>	<b>3.168.106,49</b>	<b>100,00%</b>	<b>7.431.346,23</b>	<b>-7.431.379,73</b>	<b>6.052.468,76</b>	<b>-6.102.021,24</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 – DEZEMBRO 2024



## RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/12/2024

Fundo	INFORMAÇÕES DOS ATIVOS				INFORMAÇÕES DE RATING			
	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	18/12/17	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	2.549.087,18	-	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	21/12/17	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	744.106,14	-	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	26/01/18	06/08/17	06/11/27	RB CAPIT	2.637.847,59	-	-	AAA(bra)
FIR F EMB II	19/02/18	19/02/18	15/02/25	SABESP	5.186.891,34	brAAA	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/02/18	19/02/18	15/02/25	SABESP	3.219.032,70	brAAA	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	13/03/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	12.982.468,65	brAA	-	AA(bra)
FIR F EMB II	23/05/18	23/05/18	15/05/28	COMGAS	27.619.461,34	-	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	639.473,24	brAA	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	639.473,24	brAA	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	639.473,24	brAA	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	638.396,36	brAA	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	15/06/18	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	639.473,24	brAA	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	04/07/18	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	6.604.976,41	brAAA	A2.br	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	26/07/18	26/07/18	15/07/25	AEGEA SA	7.611.557,19	brA	Aa1.br	AA(bra)
FIR F EMB II	26/07/18	26/07/18	15/07/25	CSMG	5.680.326,74	-	Aa3.br	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	07/08/18	15/02/13	15/02/25	CEMG	746.869,79	brA+	A1.br	AA-(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	592.558,84	-	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	3.751.923,04	-	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	2.136.630,43	-	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	6.459.746,02	-	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	758.000,02	-	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	6.132.909,28	-	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	9.096.000,28	-	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	937.163,67	-	-	AA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	19/08/20	24/05/19	15/05/26	OMEGA GE	648.111,23	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	30/09/20	28/09/20	22/09/25	HAPVIDA	87.056,06	-	-	AAA(bra)
FIR F EMB II	12/02/21	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	6.285.733,88	brAA	-	AA(bra)
FIR F EMB II	12/02/21	13/03/18	15/12/30	ENTREVIA	6.296.531,53	brAA	-	AA(bra)
FIR F EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	4.574.855,84	brAAA	-	-
FIR F EMB II	12/02/21	17/07/19	15/06/29	NEOENERG	668.402,48	brAA+	-	-
FIR F EMB II	12/02/21	17/07/19	15/06/29	NEOENERG	6.644.254,17	brAAA	-	-
FIR F EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	1.894.427,99	brAAA	-	-
FIR F EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	3.630.911,95	brAAA	-	-
FIR F EMB II	12/02/21	17/05/19	15/05/29	ELETROB	3.884.713,22	brAAA	-	-
FIR F EMB II	12/02/21	31/07/20	15/07/34	IGUA SAN	2.689.394,13	brAA	-	-
FIR F EMB II	12/02/21	23/05/18	15/05/28	COMGAS	24.053.923,97	-	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	26/10/16	27/01/25	BRADESCO	16.176.133,05	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	19/02/18	15/02/25	SABESP	755.994,66	brAAA	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	23/05/18	15/05/28	COMGAS	10.690.528,79	-	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	28/06/18	15/06/27	JAGUARA	1.145.574,31	-	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	28/06/18	15/06/27	ENERGMIR	765.854,29	-	-	AAA(bra)
FIR F EMB V CREDITO PRIVADO	14/05/21	31/07/18	01/08/25	BRADESCO	5.193.440,01	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	22/12/20	15/12/26	IRB	2.723.167,77	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/05/21	07/04/21	15/03/31	LOCALIZA	5.335.665,27	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	166.197,98	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	166.197,98	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	151.729,60	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	308.393,51	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	11/12/20	27/11/25	SANEAMEN	303.767,60	-	-	AA-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/06/21	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	498.251,96	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	14/06/21	19/06/19	16/06/25	BNBM	610.634,32	brAAA	AAb	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	14/06/21	12/06/19	09/06/25	BNBM	916.173,53	brAAA	AAb	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	16/06/21	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	380.713,37	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	17/06/21	18/03/21	15/02/26	CORSAN	525.508,62	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	25/06/21	25/06/21	20/06/26	OURO VER	1.421.414,21	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/06/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	1.676.184,68	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	01/07/21	12/02/21	15/12/35	MS 306	2.830.314,41	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/07/21	01/03/21	18/02/25	RENNER	573.739,88	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/07/21	01/03/21	18/02/25	RENNER	121.337,88	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	08/07/21	08/07/21	15/06/31	VAMOS	244.653,49	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	12/07/21	12/07/21	12/07/26	BRADESCO	4.888.988,86	brAAA	Aa1.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	2.138.933,39	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	1.038.910,50	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	540.233,46	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/07/21	22/12/20	15/12/26	IRB	4.277.866,79	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	15/07/21	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	829.256,21	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.058.053,58	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	897.205,64	-	-	AA-(bra)
FIM EMB I A	21/07/21	20/09/19	20/08/26	VAMOS	708.212,08	brAA+	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/07/21	23/12/20	15/12/26	RD COLIN	1.385.568,43	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	04/08/21	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	346.325,49	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	06/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	593.807,33	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	11/08/21	11/08/21	15/08/31	CSAN	1.049.893,09	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	11/08/21	19/11/19	15/06/27	AUTOPIST	876.238,47	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	17/08/21	02/06/20	15/05/30	NORTE EN	2.583.678,61	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	18/08/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	1.101.435,86	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	27/08/21	27/08/21	20/08/31	S LUZ A	1.054.200,89	-	-	AAA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	705.216,99	-	-	AA(bra)
FIM EMB I A	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	63.153,76	-	-	AA(bra)

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2024



## RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/12/2024

Fundo	INFORMAÇÕES DOS ATIVOS					INFORMAÇÕES DE RATING		
	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FIM EMB IA	16/09/21	17/07/19	15/07/26	GUARIROB	315.768,80	-	-	AA(bra)
FIM EMB IA	16/09/21	12/05/21	15/04/26	ELETROB	2.009.224,44	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/09/21	20/09/21	15/09/29	MOV_PART	975.780,21	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	855.227,40	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	855.227,40	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	1.098.974,25	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	426.909,23	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	22/09/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	426.909,23	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	23/09/21	23/09/21	15/09/31	LOCALZA	3.507.345,16	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	23/09/21	23/09/21	15/09/31	LOCALZA	4.251.327,46	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	30/09/21	30/09/21	15/09/31	SIMPBAR	842.183,42	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	04/10/21	10/02/21	15/12/31	METRORIO	583.182,55	brAA	-	AA-(bra)
FIM EMB IA	20/10/21	20/10/21	20/10/25	DAYCOVAL	3.115.451,12	brAA+	AA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	22/10/21	22/10/21	15/12/35	CART	847.923,27	brAA+	-	-
FIM EMB IA	27/10/21	27/10/21	15/10/29	CONT GLO	1.818.607,63	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	04/11/21	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	3.133.421,14	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/11/21	22/05/19	15/04/26	ECORODOV	2.434.650,65	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	03/12/21	11/06/19	06/06/25	BNBBM	610.100,93	brAAA	AA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/12/21	06/12/21	15/12/35	TESC	269.168,85	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/12/21	20/12/21	15/11/35	ORIZON	2.086.289,42	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	671.731,42	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	14/02/22	22/10/21	15/12/35	CART	627.683,46	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	12/05/22	12/05/22	15/04/27	BRKA	1.523.445,33	-	At.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/05/22	26/05/22	10/05/27	GUAR	1.015.465,83	-	-	A
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	30/05/22	31/07/20	15/07/30	PARANAGU	4.044,44	brAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	03/03/22	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	785.400,07	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/03/22	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	1.126.875,04	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/03/22	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	558.295,33	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/06/22	06/12/21	15/12/35	TESC	801.990,79	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	10/06/22	06/12/21	15/12/35	TESC	503.036,87	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	30/09/21	15/09/31	SIMPBAR	1.812.910,62	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	08/07/21	15/06/31	VAMOS	832.986,90	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	08/07/21	15/06/31	VAMOS	67.959,30	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	746.340,20	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/06/22	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	843.959,01	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	19/07/22	12/11/21	15/10/31	VAMOS	610.181,49	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/07/22	28/07/22	18/07/25	V111	1.728.975,06	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	29/07/22	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	1.692.871,11	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	07/04/21	15/03/29	CAGECE	1.256.209,47	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/22	07/04/21	15/03/29	CAGECE	2.642.735,99	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/09/22	02/09/22	02/09/29	AEGEA SA	1.784.050,60	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/09/22	28/09/22	28/09/27	B.BRASIL	4.505.286,92	-	AAA.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	08/11/22	08/11/22	15/06/42	BRK AMBI	2.535.718,37	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	11/11/22	11/11/22	15/10/40	RAHOLD	2.565.316,62	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	11/11/22	11/11/22	15/10/40	RAHOLD	4.462.550,78	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	3.622.418,38	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	1.741.097,87	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	1.425.596,91	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	28/11/22	02/10/20	15/09/34	BRKA	182.369,00	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/12/22	20/09/21	15/09/31	MOV_PART	499.461,77	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/12/22	10/02/22	15/12/35	IP SUL C	28.770,39	-	-	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/03/23	24/11/20	04/11/25	HAPVIDA	155.254,90	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	08/10/21	15/09/41	AESTUCAN	1.129.732,35	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/03/23	27/07/22	15/04/36	BRV_VDR	2.871.726,16	-	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/04/23	12/05/22	15/04/27	BRKA	1.156.747,19	-	A+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/04/23	12/05/22	15/04/27	BRKA	31.931,58	-	A+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	23/09/21	15/09/31	LOCALIZA	2.223.444,26	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	18/06/21	15/12/30	MG050	1.426.687,24	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/04/23	08/11/22	15/06/42	BRK AMBI	1.328.124,11	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	22/10/21	15/12/35	CART	781.851,33	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	02/10/20	15/09/34	BRKA	285.353,85	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	02/10/20	15/09/34	BRKA	2.723.734,69	-	Aa3.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	22/10/21	15/12/35	CART	627.683,46	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	05/05/23	10/02/21	15/12/31	METRORIO	1.985.653,93	brAA	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/05/23	08/11/22	15/06/42	BRK AMBI	2.323.356,26	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/05/23	22/10/21	15/12/35	CART	2.070.254,22	brAA+	-	-
FIM EMB IA	16/05/23	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.098.871,89	-	-	AAA(bra)
FIM EMB IA	16/05/23	23/12/20	15/12/27	SABESP	2.261.844,93	brAAA	-	-
FIM EMB IA	16/05/23	21/07/21	15/07/31	CACHOEIR	1.796.819,47	brAAA	-	-
FIM EMB IA	16/05/23	29/10/21	15/10/26	COELBA	1.844.601,78	brAAA	-	-
FIM EMB IA	16/05/23	04/05/22	15/04/27	LOCALIZA	2.891.682,76	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/05/23	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	55.659,45	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/06/23	25/06/21	20/06/26	OURO VER	285.085,90	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	23/06/23	23/06/23	15/05/43	IGUA RJ	1.306.076,12	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/06/23	08/07/21	15/06/31	VAMOS	960.167,88	brAA+	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/06/23	28/07/22	18/07/25	V111	392.324,00	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/07/23	28/07/22	18/07/25	V111	1.189.661,74	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	13/07/23	28/07/22	18/07/25	V111	290.806,20	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/07/23	23/12/20	15/12/26	RD COLIN	1.032.370,98	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	777.940,46	brAAA	A2.br	AA(bra)

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2024



## RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/12/2024

INFORMAÇÕES DOS ATIVOS						INFORMAÇÕES DE RATING		
Fundo	DataAquisição	DataEmissão	DataVencimento	Emissor	Financeiro	S&P	Moody's	Fitch
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	777.940,46	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	31/07/23	26/07/21	15/06/33	ASA BRAN	2.072.816,74	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	01/08/23	31/07/23	25/07/28	TIMSA	2.297.512,69	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/23	17/04/23	17/03/30	VERO	199.523,99	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/23	06/12/21	15/12/35	TESC	1.883.078,79	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/08/23	02/05/22	15/04/38	RDVE	2.062.140,66	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/08/23	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.179.434,35	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	10/08/23	05/06/18	05/06/28	BRADESCO	4.291.989,85	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	21/08/23	08/08/23	15/01/34	SPERIO4	2.387.296,82	brAA+	-	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	29/08/23	29/08/23	29/08/25	BRADESCO	11.677.343,06	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	30/08/23	30/08/23	01/09/25	VOLKSWAG	7.028.048,49	brAAA	AAA.br	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	08/09/23	08/09/23	08/09/25	B VOTORA	7.013.184,00	brAAA	AA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	19/09/23	13/09/23	15/09/25	PANAMERI	5.791.925,46	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/09/23	21/09/23	15/09/28	ELETROB	2.630.560,53	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	28/09/23	28/09/23	15/09/30	CSMG	2.502.904,13	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/09/23	19/05/21	10/05/30	RODO BR	2.554.253,63	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/09/23	06/09/21	20/08/31	S LUZ A	1.507.334,99	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	29/09/23	13/09/23	15/09/25	B VOTORA	5.777.382,47	brAAA	AA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	02/10/23	14/11/22	10/10/31	CORREDOR	2.304.385,31	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/10/23	20/10/23	20/10/28	SANTANDE	4.691.922,42	-	AAA.br	A-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/11/23	23/09/21	15/09/31	LOCALIZA	2.973.803,56	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	07/11/23	04/07/18	15/06/25	ECORODOV	1.560.288,52	brAAA	A2.br	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	16/11/23	18/06/21	15/12/30	MG050	854.697,43	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	23/11/23	29/09/22	15/09/28	VERT5	2.304.418,77	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/12/23	12/02/21	15/12/35	MS 306	1.009.593,86	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	04/12/23	02/10/20	15/09/34	BRKA	970.846,75	-	Aa3.br	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	26/12/23	27/12/22	02/06/26	BRADESCO	11.264.632,59	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	08/01/24	08/01/24	08/01/26	DAYCOVAL	11.191.607,77	brAA+	AA+.br	AA+(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	08/01/24	08/01/24	08/01/26	B.ALFA	11.176.579,99	-	AAA.br	AA+(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	08/01/24	08/01/24	08/01/26	ABC	11.216.606,64	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	17/04/23	17/03/30	VERO	2.892.013,53	brA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	25/03/22	15/03/44	GBS PART	1.091.479,98	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	25/03/22	15/03/44	GBS PART	1.851.617,82	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	50.505,80	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/01/24	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	1.800.686,43	brA	-	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	11/01/24	27/12/22	02/06/26	BRADESCO	11.842.434,76	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	18/01/24	18/01/24	04/01/27	TOYOTA	6.328.454,99	brAAA	-	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	24/01/24	24/01/24	26/01/26	ABC	11.157.269,21	brAAA	AA+.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	24/01/24	24/01/24	25/01/27	BTG PACT	4.782.770,96	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	25/01/24	25/01/24	26/01/26	BTG PACT	7.147.708,71	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/01/24	15/03/21	15/03/29	OMEGA GE	1.089.780,93	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/01/24	10/12/19	15/07/27	RT BANDE	1.223.475,16	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	30/01/24	01/06/23	25/05/26	LM TRANS	2.543.905,55	-	AA+.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	30/01/24	27/10/21	15/10/29	CONT GLO	2.307.409,86	-	-	AA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	31/01/24	31/01/24	02/02/26	B.ALFA	11.758.904,32	-	AAA.br	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	09/02/24	08/02/24	15/09/31	PLANALTO	2.114.281,01	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	15/02/24	15/02/24	15/12/43	AGUAS SE	1.833.580,28	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/02/24	12/11/21	30/04/29	HAPVIDA	546.886,62	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/02/24	18/03/21	15/02/26	CORSAN	1.319.026,63	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/02/24	07/04/21	15/03/26	CAGECE	1.898.697,26	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/02/24	24/03/22	11/03/27	ARTERIS	2.564.738,44	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	26/02/24	16/02/24	15/02/34	NTRASSUD	2.709.842,97	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	265.928,50	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	18/06/21	15/12/30	MG050	267.679,96	brAA+	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	02/05/22	15/04/38	RDVE	716.145,59	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	17/07/19	15/07/29	GUARIROB	782.909,78	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	04/08/21	15/07/39	UTE GNA	265.928,50	brA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	12/02/21	15/12/35	MS 306	296.622,13	-	A.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	39.819,52	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	22/07/21	15/12/36	VIA BRAS	459.820,61	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	26/02/24	10/02/21	15/12/31	METRORIO	448.601,96	brAA	-	AA-(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	26/02/24	26/02/24	01/03/27	BTG PACT	11.743.240,23	brAAA	AAA.br	AAA(bra)
FIRF EMB II A CRED PRIV	05/03/24	05/03/24	24/08/26	B VOTORA	7.172.174,20	brAAA	AA.br	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	12/03/24	23/09/21	15/09/31	LOCALIZA	1.983.244,26	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	21/03/24	23/06/23	15/05/43	IGUA RJ	1.158.054,16	brAA+	-	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	05/04/24	05/04/24	06/04/26	PSA	7.074.149,31	-	AAA.br	-
FIRF EMB II A CRED PRIV	16/05/24	16/05/24	18/05/26	BANSICRE	3.549.502,47	brAAA	AAA.br	AA+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/05/24	10/11/21	30/10/31	DASA	1.427.830,61	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	20/06/24	18/06/24	10/06/29	OURO VER	615.620,32	-	AA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	17/07/24	17/07/24	15/07/34	CSMG	2.900.275,24	-	AAA.br	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	05/08/24	01/08/24	15/07/27	CEA MODA	1.500.938,95	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	06/08/24	01/08/24	11/06/30	VIX LOGI	2.178.459,13	-	-	AA-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/08/24	05/06/24	15/05/34	JALLES M	548.807,02	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	08/08/24	06/08/24	15/03/43	BARUERI	1.210.264,34	brAA-	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	13/08/24	09/05/24	15/04/34	ENEVA	190.474,12	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	30/08/24	30/08/24	15/08/41	ROD TRIA	2.383.218,33	-	-	A+(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/10/24	02/05/22	15/04/38	RDVE	577.175,24	-	-	AA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	25/10/24	08/02/24	15/09/31	PLANALTO	498.717,45	brAAA	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	06/11/24	06/11/24	15/10/34	HIGHLINE	2.246.515,61	-	-	A-(bra)
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	11/11/24	12/08/22	15/12/30	SSIOO	1.771.694,21	-	A-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	12/11/24	27/07/22	15/04/36	BRV_VDR	1.473.928,12	-	A.br	-



## RELATÓRIO DE RISCO DE CRÉDITO-EMBRAER PREV

31/12/2024

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	12/11/24	15/02/24	15/12/43	AGUAS SE	1.649.203,60	-	AA-.br	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	12/11/24	24/06/24	15/06/34	QGEP	2.088.060,33	brAA-	-	-
FI RENDA FIXA EMB VII A CRED PRIV	17/12/24	17/12/24	15/12/38	VPORTS A	2.832.895,32	-	-	AAA(bra)
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	16/12/24	13/11/24	13/11/32	LIGHT	880.110,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	16/12/24	13/11/24	13/11/37	LIGHT	99.450,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	16/12/24	13/11/24	13/11/32	LIGHT	329.980,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	16/12/24	13/11/24	13/11/37	LIGHT	264.350,00	-	-	D
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	16/12/24	28/11/24	31/08/27	LIGHT S/	204.877,20	-	-	D
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	VERDECARD FIDC SN6	661.498,13	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	FIDC VERDECARD SN8	1.250.657,45	brAAA(sf)	-	-
FIM EMB VI A CRED PRIV	-	-	-	RB CAP CREDIT AL SN3	420.234,67	brAA-(sf)	-	-
FI RENDA FIXA EMB VI A CREDITO PRIVADO	-	-	-	DRIVER SIX FIDC SN	426.537,03	-	AAA.br	-

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



## 4. RISCO OPERACIONAL

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

## 5. RISCO DE LIQUIDEZ

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

## 6. RISCO LEGAL

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

### 6.1. Relatório de Enquadramentos Legais



## Relatório Resumo de Enquadramento

**Patrimônio Líquido da Fundação** **5.132.765.950,54**

Tópico do Enquadramento	Limite	Aplicação Atual	Valor Limite	% Aplicado	Status
% do Segmento RF/PL PLANO	100,00%	4.579.041.716,42	5.132.765.950,54	89,21%	Enquadrado
% do PL em Títulos de Emissão do Tesouro Nacional e/ou do BACEN	100,00%	3.953.213.195,11	5.132.765.950,54	77,02%	Enquadrado
% do PL em Títulos RF1, exceto títulos do Tesouro Nacional	80,00%	625.828.521,31	4.106.212.821,62	12,19%	Enquadrado
% do PL em FIDC	20,00%	Verificar Rel. de Diversificação de FIDC's	1.026.553.205,40	0,00%	Enquadrado
% do PL em uma mesma pessoa jurídica não-financeira	10,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Não Financ.	513.276.602,70	0,00%	Enquadrado
% do PL em Instituições Financeiras	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Inst. Financ.	1.283.191.487,64	0,00%	Enquadrado
% de uma mesma Série de Debêntures	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação Debêntures	1.283.191.487,64	0,00%	Enquadrado
% do PL em RV	70,00%	448.424.595,70	3.592.936.104,19	8,74%	Enquadrado
% do capital votante de uma empresa	25,00%	Verificar Rel. de Diversificação RV	1.283.191.487,64	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Imobiliários	20,00%	73.260.531,67	1.026.553.205,40	1,43%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Empréstimos	15,00%	29.259.846,22	769.914.923,17	0,57%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos Estruturados	20,00%	0,00	1.026.553.205,40	0,00%	Enquadrado
% do PL da Fundação em Investimentos no Exterior	10,00%	0,00	513.276.602,70	0,00%	Enquadrado

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

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2024

## 6.2. Relatório de Túnel de Preços

### RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV  
Período: 01 DE DEZEMBRO DE 2024 À 31 DE DEZEMBRO DE 2024



FI RF EMB II										FONTE ANBIMA		
DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
11/12/2024	FI RF EMB II	BB DTVM	BB DTVM	LFT	01/12/2030	Compra	0,1200%	0,1197%	0,1074%	0,1370%	0,0003%	NÃO

### RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV  
Período: 01 DE DEZEMBRO DE 2024 À 31 DE DEZEMBRO 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
02/12/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	6,7702%	6,8000%	6,6918%	6,9788%	-0,0298%	NÃO
04/12/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	6,8595%	6,8604%	6,7573%	7,0441%	-0,0009%	NÃO
05/12/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	6,8595%	6,8700%	6,7311%	7,0179%	-0,0105%	NÃO
09/12/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	6,9295%	6,9745%	6,7942%	7,0820%	-0,0450%	NÃO
10/12/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2025	Compra	4,8693%	4,7196%	4,1162%	5,2591%	0,1497%	NÃO
10/12/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2025	Compra	4,8693%	4,7196%	4,1162%	5,2591%	0,1497%	NÃO
10/12/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2025	Compra	4,8693%	4,7196%	4,1162%	5,2591%	0,1497%	NÃO
10/12/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	6,9995%	6,8763%	6,7466%	7,1325%	0,1232%	NÃO
12/12/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,7405%	6,8039%	6,5958%	6,9623%	-0,0634%	NÃO
12/12/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	6,7405%	6,8039%	6,5958%	6,9623%	-0,0634%	NÃO
16/12/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	6,9495%	7,1887%	6,8368%	7,3646%	-0,2392%	NÃO
17/12/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2025	Compra	4,9492%	4,9170%	4,3890%	5,3075%	0,0322%	NÃO
17/12/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/05/2025	Compra	4,9390%	4,9170%	4,3890%	5,3075%	0,0220%	NÃO
17/12/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	7,2005%	7,2635%	7,0492%	7,4441%	-0,0630%	NÃO
17/12/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	7,2005%	7,2635%	7,0492%	7,4441%	-0,0630%	NÃO
17/12/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	7,2005%	7,2635%	7,0492%	7,4441%	-0,0630%	NÃO
17/12/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	7,2005%	7,2635%	7,0492%	7,4441%	-0,0630%	NÃO
17/12/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	7,2005%	7,2635%	7,0492%	7,4441%	-0,0630%	NÃO
17/12/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	7,2005%	7,2635%	7,0492%	7,4441%	-0,0630%	NÃO
17/12/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	7,2005%	7,2635%	7,0492%	7,4441%	-0,0630%	NÃO
17/12/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	7,2005%	7,2635%	7,0492%	7,4441%	-0,0630%	NÃO
17/12/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	7,2005%	7,2635%	7,0492%	7,4441%	-0,0630%	NÃO
17/12/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	7,2005%	7,2635%	7,0492%	7,4441%	-0,0630%	NÃO
18/12/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	7,1895%	7,3830%	7,1238%	7,5601%	-0,1935%	NÃO
18/12/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Compra	7,2495%	7,3830%	7,1238%	7,5601%	-0,1335%	NÃO
19/12/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	7,3405%	7,2745%	7,1347%	7,5601%	0,0660%	NÃO
19/12/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	7,3405%	7,2745%	7,1347%	7,5601%	0,0660%	NÃO
19/12/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	7,3405%	7,2745%	7,1347%	7,5601%	0,0660%	NÃO
19/12/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	7,3405%	7,2745%	7,1347%	7,5601%	0,0660%	NÃO
19/12/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	7,3405%	7,2745%	7,1347%	7,5601%	0,0660%	NÃO
23/12/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	7,1505%	7,2327%	7,0560%	7,4588%	-0,0822%	NÃO
23/12/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	7,1505%	7,2327%	7,0560%	7,4588%	-0,0822%	NÃO
23/12/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	7,1505%	7,2327%	7,0560%	7,4588%	-0,0822%	NÃO
23/12/2024	FIM EMB I A	BTG ASSE	PACTUAL	NTN-B	15/08/2050	Venda	7,1505%	7,2327%	7,0560%	7,4588%	-0,0822%	NÃO

### RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV  
Período: 01 DE DEZEMBRO DE 2024 À 31 DE DEZEMBRO DE 2024



FIRF EMB II A CRED PRIV										FONTE ANBIMA		
DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	FORA DO TÚNEL
19/12/2024	FIRF EMB II A CRED PRIV	BNP	RENASCEN	NTN-B	15/08/2050	Compra	7,3695%	7,2745%	7,1347%	7,5601%	0,0950%	NÃO

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2024

## RELATÓRIO DE TÚNEL DE PREÇOS POR PERÍODO

Cliente: EMBRAER PREV

Período: 01 DE DEZEMBRO DE 2024 À 31 DE DEZEMBRO DE 2024



### EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA

DT	FUNDO	GESTOR	CORRETORA	TÍTULO	VENC.	C/V	TX. OPER.	FONTE ANBIMA				FORA DO TÚNEL
								TX. IND.	TX. MÍN.	TX. MÁX.	DIF. TX.	
05/12/2024	EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA	ITAU UNI	LIQUIDEZ	LFT	01/03/2027	Compra	0,0361%	0,0357%	0,0173%	0,0425%	0,0004%	NÃO
09/12/2024	EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA	ITAU UNI	LIQUIDEZ	LFT	01/03/2027	Compra	0,0356%	0,0355%	0,0176%	0,0421%	0,0001%	NÃO
10/12/2024	EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA	ITAU UNI	XP CCTVM	NTN-B	15/08/2028	Compra	7,5427%	7,5700%	7,4077%	7,8745%	-0,0273%	NÃO
11/12/2024	EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA	ITAU UNI	LIQUIDEZ	LFT	01/03/2027	Venda	0,0350%	0,0350%	0,0172%	0,0415%	0,0000%	NÃO
13/12/2024	EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA	ITAU UNI	LIQUIDEZ	LFT	01/09/2027	Compra	0,0431%	0,0430%	0,0363%	0,0672%	0,0001%	NÃO
16/12/2024	EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA	ITAU UNI	LIQUIDEZ	LFT	01/03/2027	Compra	0,0368%	0,0364%	0,0187%	0,0435%	0,0004%	NÃO
17/12/2024	EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA	ITAU UNI	LIQUIDEZ	LFT	01/03/2027	Compra	0,0364%	0,0383%	0,0183%	0,0483%	-0,0019%	NÃO
19/12/2024	EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA	ITAU UNI	RENASCEN	NTN-B	15/08/2028	Compra	8,1686%	8,1351%	7,9202%	8,7387%	0,0335%	NÃO
20/12/2024	EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA	ITAU UNI	LIQUIDEZ	LFT	01/03/2027	Venda	0,0526%	0,0691%	0,0397%	0,0795%	-0,0165%	NÃO
26/12/2024	EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA	ITAU UNI	LIQUIDEZ	LFT	01/03/2027	Compra	0,0762%	0,0776%	0,0477%	0,0865%	-0,0014%	NÃO
30/12/2024	EMB IX A FIF MULTIMERCADO RESP LTDA	ITAU UNI	LIQUIDEZ	LFT	01/03/2027	Compra	0,0731%	0,0719%	0,0534%	0,0836%	0,0012%	NÃO

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2024

## RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

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



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA				VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO		
02-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	ABEV3	13,16	19.700,00	259.289,20	12,60	13,05	13,27	85.952,00	
02-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	CXSE3	14,30	19.100,00	273.130,00	14,25	14,37	14,53	16.055,00	
02-12-24	FIA RVA EMB II	Venda	ENEV3	11,48	20.600,00	236.488,00	11,30	11,41	11,53	21.346,00	
02-12-24	FIA RVA EMB II	Venda	MULT3	23,46	11.400,00	267.463,38	23,30	23,47	23,69	16.704,00	
02-12-24	FIA RVA EMB II	Venda	SBFG3	12,14	4.800,00	58.272,00	11,88	12,09	12,35	5.629,00	
02-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	19,56	600,00	11.735,73	19,34	19,50	19,67	15.193,00	
02-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	6,12	9.300,00	56.940,31	6,04	6,12	6,31	14.901,00	
02-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	6,48	3.200,00	20.748,61	6,36	6,48	6,63	26.286,00	
02-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	24,60	700,00	17.216,59	24,46	24,62	24,92	45.179,00	
02-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	33,67	600,00	20.202,87	33,37	33,59	33,75	15.133,00	
02-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	30,14	800,00	24.110,14	29,90	30,09	30,47	28.662,00	
02-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPLE3	8,62	3.400,00	29.305,47	8,60	8,64	8,75	7.636,00	
02-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLE6	9,71	1.900,00	18.451,41	9,65	9,71	9,77	23.943,00	
02-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	34,47	2.000,00	68.935,84	34,26	34,52	34,82	26.045,00	
02-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	11,42	2.000,00	22.847,65	11,30	11,41	11,53	21.346,00	
02-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENGI11	39,70	1.300,00	51.604,00	39,44	39,83	40,40	12.932,00	
02-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	13,32	2.700,00	35.963,18	13,19	13,33	13,54	19.426,00	
02-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	GGPS3	16,06	900,00	14.452,00	16,00	16,08	16,33	7.060,00	
02-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	2,70	4.700,00	12.705,49	2,66	2,72	2,80	33.645,00	
02-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	18,71	2.800,00	52.381,63	18,63	18,77	19,19	11.618,00	
02-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	9,58	9.600,00	91.951,27	9,53	9,59	9,77	44.650,00	
02-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	14,01	2.000,00	28.023,98	13,74	14,00	14,24	29.967,00	
02-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRIO3	40,33	1.200,00	48.400,02	39,55	40,15	40,62	23.545,00	
02-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	19,03	8.700,00	165.518,51	18,86	19,14	19,51	33.940,00	
02-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	16,57	700,00	11.600,99	16,32	16,50	16,66	7.344,00	
02-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	36,75	3.700,00	135.963,83	36,40	36,79	37,28	63.907,00	
02-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	SCAR3	20,38	300,00	6.115,00	20,27	20,47	20,78	37,00	
02-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	18,29	1.000,00	18.294,12	17,83	18,25	18,43	12.941,00	
02-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	18,24	1.800,00	32.840,58	17,83	18,25	18,43	12.941,00	
02-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	61,85	1.500,00	92.779,34	61,53	62,11	62,93	32.789,00	
02-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	20,38	2.300,00	46.874,98	20,21	20,42	20,60	22.778,00	
02-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	YDUQ3	9,10	3.500,00	31.833,05	8,98	9,10	9,38	14.544,00	
02-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	9,58	19.002,00	182.028,92	9,52	9,66	9,94	19.246,00	
02-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLE3	8,65	4.223,00	36.508,89	8,60	8,64	8,75	7.636,00	
02-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLE6	9,71	1.077,00	10.456,43	9,65	9,71	9,77	23.943,00	
02-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLE6	9,71	33.054,00	321.061,97	9,65	9,71	9,77	23.943,00	
02-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLE6	9,69	1.870,00	18.117,81	9,65	9,71	9,77	23.943,00	
02-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLE6	9,73	1.077,00	10.479,06	9,65	9,71	9,77	23.943,00	
02-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	GMAT1	0,09	129,00	11,61	0,07	0,08	0,10	277,00	
02-12-24	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	36,74	11.161,00	410.107,48	36,40	36,79	37,28	63.907,00	
02-12-24	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	36,81	4.899,00	180.334,20	36,40	36,79	37,28	63.907,00	
02-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	20,54	458,00	9.407,32	20,21	20,42	20,60	22.778,00	
02-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	20,53	358,00	7.351,36	20,21	20,42	20,60	22.778,00	
02-12-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ABEV3	13,25	370,00	4.902,50	12,60	13,05	13,27	85.952,00	
02-12-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	AZZA3	36,89	30,00	1.106,64	35,38	36,48	37,05	8.697,00	
02-12-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	B3SA3	9,37	470,00	4.404,18	9,14	9,31	9,42	57.633,00	
02-12-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBAS3	24,57	240,00	5.896,82	24,46	24,62	24,92	45.179,00	
02-12-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBDC3	10,98	130,00	1.427,68	10,91	10,98	11,16	16.451,00	
02-12-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBDC4	12,36	430,00	5.314,88	12,30	12,39	12,64	85.839,00	
02-12-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BBSE3	33,63	50,00	1.681,46	33,37	33,59	33,75	15.133,00	
02-12-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BPAC11	30,01	110,00	3.301,10	29,90	30,09	30,47	28.662,00	
02-12-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRAP4	18,38	70,00	1.286,84	18,33	18,39	18,52	8.840,00	
02-12-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRFS3	25,20	70,00	1.764,02	24,46	24,97	25,20	19.716,00	
02-12-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	BRKM5	15,33	80,00	1.226,32	14,83	15,16	15,40	7.938,00	
02-12-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CMIG4	11,65	160,00	1.864,10	11,56	11,70	11,97	25.333,00	
02-12-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CPLE6	9,70	140,00	1.358,00	9,65	9,71	9,77	23.943,00	
02-12-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	CSAN3	9,99	100,00	998,99	9,78	10,02	10,21	24.687,00	
02-12-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ELET3	34,52	150,00	5.178,30	34,26	34,52	34,82	26.045,00	
02-12-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	EMBR3	57,60	60,00	3.456,16	57,53	58,02	58,82	17.989,00	
02-12-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ENEV3	11,48	160,00	1.836,70	11,30	11,41	11,53	21.346,00	
02-12-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ENGI11	39,43	30,00	1.182,95	39,44	39,83	40,40	12.932,00	
02-12-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	EQTL3	30,12	100,00	3.011,68	30,08	30,32	30,61	25.425,00	
02-12-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	GGBR4	20,48	100,00	2.048,21	20,15	20,42	20,55	26.834,00	
02-12-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	HAPV3	2,67	410,00	1.094,70	2,66	2,72	2,80	33.645,00	
02-12-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	IGTI11	18,76	60,00	1.125,36	18,63	18,77	19,19	11.618,00	
02-12-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	IRBR3	40,41	30,00	1.212,30	39,56	40,13	41,21	4.393,00	
02-12-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ITSA4	9,60	470,00	4.511,97	9,53	9,59	9,77	44.650,00	
02-12-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	ITUB4	32,12	380,00	12.205,68	32,00	32,22	32,65	40.221,00	
02-12-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	JBSS3	37,63	100,00	3.762,92	36,87	37,50	37,89	29.192,00	
02-12-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	KLBN11	22,37	70,00	1.565,93	21,96	22,33	22,57	20.663,00	
02-12-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	LREN3	14,99	80,00	1.199,25	14,73	15,01	15,28	33.529,00	
02-12-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	MRF33	18,92	80,00	1.513,64	18,57	18,89	19,05	20.229,00	
02-12-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	NTCO3	13,99	70,00	979,60	13,74	14,00	14,24	29.967,00	
02-12-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PETR3	42,73	210,00	8.973,10	42,39	42,78	43,08	19.229,00	
02-12-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PETR4	39,15	380,00	14.877,11	38,77	39,14	39,40	53.695,00	
02-12-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	PRIO3	40,00	70,00	2.799,70	39,55	40,15	40,62	23.545,00	
02-12-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RADL3	24,06	110,00	2.646,35	23,81	24,14	24,40	22.673,00	
02-12-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RAIL3	18,87	110,00	2.075,23	18,86	19,14	19,51	33.940,00	
02-12-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RDOR3	27,01	90,00	2.431,00	26,53	26,97	27,32	38.443,00	
02-12-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	RENT3	36,63	80,00	2.930,26	36,40	36,79	37,28	63.907,00	
02-12-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SBS33	91,56	50,00	4.577,98	91,33	91,97	92,94	17.467,00	
02-12-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SUZE3	18,00	60,00	1.079,89	17,87	18,28	18,79	18.284,00	
02-12-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	SUZB3	62,07	60,00	3.724,38	61,53	62,11	62,93	32.789,00	
02-12-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	TIMS3	15,63	70,00	1.094,18	15,60	15,72	15,98	19.606,00	
02-12-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	TOTS3	26,88	50,00	1.343,89	26,86	27,00	27,56	14.249,00	
02-12-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	UGPA3	17,76	90,00	1.598,61	17,23	17,68	18,00	24.291,00	
02-12-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VALE3	58,92	370,00	21.800,60	58,69	59,06	59,38	45.056,00	
02-12-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VBBR3	20,46	80,00	1.636,89	20,21	20,42	20,60	22.778,00	
02-12-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	VIVT3	49,57	30,00	1.487,00	48,70	49,53	50,01	21.705,00	
02-12-24	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES RVA EMB VI	Compra	WEGE3	53,85	110,00	5.923,92	53,21	53,90	54,34	25.929,00	
03-12-24	FIA RVA EMB II	Venda	BBDC4	12,29	3.653,00	44.895,37	12,24	12,31	12,47	37.612,00	
03-12-24	FIA RVA EMB II	Venda	BBDC4	12,28	5.299,00	65.071,72	12,24	12,31	12,47	37.612,00	

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2024

## RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE DEZEMBRO DE 2024 À 31 DE DEZEMBRO 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
03-12-24	FIA RVA EMB II	Venda	8BDC4	12,27	2.100,00	25.767,00	12,24	12,31	12,47	37.612,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Venda	8BDC4	12,26	3.748,00	45.950,48	12,24	12,31	12,47	37.612,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	8BSE3	35,10	700,00	24.570,00	33,69	34,80	35,36	25.239,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	8BSE3	34,97	100,00	3.497,00	33,69	34,80	35,36	25.239,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	8BSE3	35,09	200,00	7.018,00	33,69	34,80	35,36	25.239,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	8BSE3	35,20	66,00	2.323,20	33,69	34,80	35,36	25.239,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	8BSE3	34,87	499,00	17.400,13	33,69	34,80	35,36	25.239,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	8BSE3	35,13	801,00	28.139,13	33,69	34,80	35,36	25.239,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	8BSE3	34,98	333,00	11.648,34	33,69	34,80	35,36	25.239,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	8BSE3	35,14	1.466,00	51.515,24	33,69	34,80	35,36	25.239,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	8BSE3	35,17	328,00	11.535,76	33,69	34,80	35,36	25.239,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	8BSE3	35,15	1.833,00	64.429,95	33,69	34,80	35,36	25.239,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	8BSE3	35,22	36,00	1.267,92	33,69	34,80	35,36	25.239,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	8BSE3	35,06	100,00	3.506,00	33,69	34,80	35,36	25.239,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	8BSE3	35,02	133,00	4.657,66	33,69	34,80	35,36	25.239,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	8BSE3	35,07	133,00	4.664,31	33,69	34,80	35,36	25.239,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	8BSE3	35,08	34,00	1.192,72	33,69	34,80	35,36	25.239,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	8BSE3	35,04	400,00	14.016,00	33,69	34,80	35,36	25.239,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	8BSE3	35,01	200,00	7.002,00	33,69	34,80	35,36	25.239,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	8BSE3	34,89	200,00	6.978,00	33,69	34,80	35,36	25.239,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	8BSE3	35,05	234,00	8.201,70	33,69	34,80	35,36	25.239,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	8BSE3	35,18	496,00	17.449,28	33,69	34,80	35,36	25.239,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	8BSE3	34,88	367,00	12.800,96	33,69	34,80	35,36	25.239,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	8BSE3	35,16	548,00	19.267,68	33,69	34,80	35,36	25.239,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	8BSE3	35,21	310,00	10.915,10	33,69	34,80	35,36	25.239,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	8BSE3	34,96	67,00	2.342,32	33,69	34,80	35,36	25.239,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	8BSE3	35,23	6,00	211,38	33,69	34,80	35,36	25.239,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	8BSE3	34,95	67,00	2.341,65	33,69	34,80	35,36	25.239,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	8BSE3	35,24	8,00	281,92	33,69	34,80	35,36	25.239,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	8BSE3	35,12	734,00	25.778,08	33,69	34,80	35,36	25.239,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	8BSE3	35,11	66,00	2.317,26	33,69	34,80	35,36	25.239,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	8BSE3	35,19	268,00	9.430,92	33,69	34,80	35,36	25.239,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	8BSE3	34,75	1,00	34,75	33,69	34,80	35,36	25.239,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	8BSE3	34,92	266,00	9.288,72	33,69	34,80	35,36	25.239,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	CXSE3	14,79	300,00	4.437,00	14,33	14,91	15,22	26.246,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	CXSE3	14,80	100,00	1.480,00	14,33	14,91	15,22	26.246,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	CXSE3	15,03	200,00	3.006,00	14,33	14,91	15,22	26.246,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	CXSE3	14,81	400,00	5.924,00	14,33	14,91	15,22	26.246,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	CXSE3	14,78	100,00	1.478,00	14,33	14,91	15,22	26.246,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	CXSE3	15,02	100,00	1.502,00	14,33	14,91	15,22	26.246,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	CXSE3	14,87	500,00	7.435,00	14,33	14,91	15,22	26.246,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	CXSE3	14,89	300,00	4.467,00	14,33	14,91	15,22	26.246,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	CXSE3	14,86	700,00	10.402,00	14,33	14,91	15,22	26.246,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	CXSE3	14,94	400,00	5.976,00	14,33	14,91	15,22	26.246,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	CXSE3	14,88	100,00	1.488,00	14,33	14,91	15,22	26.246,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	CXSE3	14,98	200,00	2.996,00	14,33	14,91	15,22	26.246,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	CXSE3	14,92	400,00	5.968,00	14,33	14,91	15,22	26.246,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	CXSE3	14,83	300,00	4.449,00	14,33	14,91	15,22	26.246,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	CXSE3	14,84	500,00	7.420,00	14,33	14,91	15,22	26.246,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	CXSE3	14,85	400,00	5.940,00	14,33	14,91	15,22	26.246,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	CXSE3	14,93	300,00	4.479,00	14,33	14,91	15,22	26.246,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	CXSE3	14,91	300,00	4.473,00	14,33	14,91	15,22	26.246,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	CXSE3	14,82	200,00	2.964,00	14,33	14,91	15,22	26.246,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	CXSE3	14,95	100,00	1.495,00	14,33	14,91	15,22	26.246,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	CXSE3	14,90	700,00	10.430,00	14,33	14,91	15,22	26.246,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Venda	EQTL3	30,02	450,00	13.509,00	29,81	29,99	30,45	29.101,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Venda	EQTL3	30,03	500,00	15.015,00	29,81	29,99	30,45	29.101,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Venda	EQTL3	30,04	450,00	13.518,00	29,81	29,99	30,45	29.101,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Venda	EQTL3	29,96	850,00	25.466,00	29,81	29,99	30,45	29.101,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Venda	EQTL3	29,97	551,00	16.513,47	29,81	29,99	30,45	29.101,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Venda	EQTL3	30,07	317,00	9.532,19	29,81	29,99	30,45	29.101,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Venda	EQTL3	29,95	232,00	6.948,40	29,81	29,99	30,45	29.101,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Venda	EQTL3	29,99	100,00	2.999,00	29,81	29,99	30,45	29.101,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Venda	EQTL3	30,06	600,00	18.036,00	29,81	29,99	30,45	29.101,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Venda	EQTL3	30,00	650,00	19.500,00	29,81	29,99	30,45	29.101,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Venda	EQTL3	30,01	500,00	15.005,00	29,81	29,99	30,45	29.101,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Venda	EQTL3	29,98	350,00	10.493,00	29,81	29,99	30,45	29.101,00
03-12-24	FIA RVA EMB II	Venda	EQTL3	30,05	250,00	7.512,50	29,81	29,99	30,45	29.101,00
03-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	19,30	2.500,00	48.250,71	19,24	19,34	19,69	17.893,00
03-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	6,10	2.500,00	15.250,00	6,04	6,12	6,26	7.393,00
03-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	6,10	6.200,00	37.847,30	6,04	6,12	6,26	7.393,00
03-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	8BSE3	35,01	5.000,00	175.066,91	33,69	34,80	35,36	25.239,00
03-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	30,02	3.800,00	114.057,44	29,81	29,99	30,45	29.101,00
03-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	13,35	7.100,00	94.796,29	13,20	13,40	13,52	12.569,00
03-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	13,27	200,00	2.653,35	13,20	13,40	13,52	12.569,00
03-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	9,17	10.700,00	98.088,19	9,11	9,16	9,24	32.392,00
03-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	18,35	1.500,00	27.527,18	18,10	18,38	18,57	9.882,00
03-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	GMAT1	0,05	389,00	20,11	0,04	0,05	0,06	639,00
03-12-24	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	36,87	614,00	22.637,74	36,12	36,92	37,47	29.510,00
03-12-24	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	36,92	1.650,00	60.918,39	36,12	36,92	37,47	29.510,00
03-12-24	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	37,18	1.600,00	59.489,27	36,12	36,92	37,47	29.510,00
03-12-24	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	36,67	2.767,00	101.455,12	36,12	36,92	37,47	29.510,00
03-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	20,47	260,00	5.323,35	20,20	20,46	20,79	24.529,00
03-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	20,50	3.320,00	68.057,61	20,20	20,46	20,79	24.529,00
04-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	BBAS3	25,20	26.400,00	665.325,63	24,80	25,17	25,33	35.729,00
04-12-24	FIA RVA EMB II	Venda	8BDC4	12,34	27.100,00	334.332,88	12,27	12,41	12,51	50.488,00
04-12-24	FIA RVA EMB II	Venda	BPAC11	30,22	8.200,00	247.798,00	29,92	30,45	30,74	28.302,00
04-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	19,38	900,00	17.442,07	19,16	19,34	19,49	15.297,00
04-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	6,05	300,00	1.815,02	6,04	6,12	6,25	5.866,00
04-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	6,05	13.300,00	80.465,00	6,04	6,12	6,25	5.866,00
04-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	39,49	800,00	31.588,15	39,26	39,45	39,80	13.548,00
04-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	29,89	1.100,00	32.883,10	29,57	29,81	30,03	21.734,00

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2024

## RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

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



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
04-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	2,66	24.700,00	65.677,56	2,62	2,65	2,73	40.801,00
04-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	18,56	600,00	11.133,31	18,30	18,51	18,73	18.236,00
04-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	18,46	700,00	12.924,00	18,30	18,51	18,73	18.236,00
04-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	14,37	5.700,00	81.897,81	13,92	14,37	14,68	18.349,00
04-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	36,71	1.300,00	47.722,05	36,19	36,64	37,47	21.972,00
04-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	36,83	1.900,00	69.977,00	36,19	36,64	37,47	21.972,00
04-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	18,08	2.700,00	48.810,45	17,88	18,13	18,64	10.609,00
04-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	64,79	3.800,00	246.183,72	64,13	64,76	65,35	44.690,00
04-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	9,53	4.610,00	43.920,42	9,46	9,62	10,05	17.539,00
04-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	9,62	2.187,00	21.047,49	9,46	9,62	10,05	17.539,00
04-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLE3	8,62	3.845,00	33.140,30	8,58	8,62	8,68	6.139,00
04-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLE6	9,71	1.671,00	16.219,67	9,67	9,73	9,80	17.769,00
04-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLE6	9,76	7.152,00	69.819,80	9,67	9,73	9,80	17.769,00
04-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLE6	9,72	6.353,00	61.727,87	9,67	9,73	9,80	17.769,00
04-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	GMAT1	0,04	323,00	12,92	0,03	0,04	0,06	207,00
04-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	20,27	2.594,00	52.591,50	20,15	20,30	20,48	21.424,00
04-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	20,30	4.292,00	87.121,97	20,15	20,30	20,48	21.424,00
04-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	20,28	6.798,00	137.873,54	20,15	20,30	20,48	21.424,00
05-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	CXSE3	15,07	5.700,00	85.895,00	14,87	15,08	15,16	9.868,00
05-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	CYRE3	18,87	15.200,00	286.838,05	18,64	18,94	19,29	20.570,00
05-12-24	FIA RVA EMB II	Venda	VALE3	57,00	4.900,00	279.300,00	56,87	57,37	57,80	31.071,00
05-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	19,65	600,00	11.790,88	19,52	19,63	19,75	11.101,00
05-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	36,81	14.100,00	519.019,77	36,17	36,77	37,48	43.037,00
05-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	39,74	300,00	11.920,58	39,43	39,79	40,21	14.517,00
05-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQT3	30,34	700,00	21.235,37	29,94	30,39	30,74	26.588,00
05-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	13,38	1.200,00	16.057,76	13,19	13,33	13,52	7.356,00
05-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	2,65	45.100,00	119.685,01	2,59	2,66	2,75	19.072,00
05-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	2,64	10.900,00	28.827,14	2,59	2,66	2,75	19.072,00
05-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	19,08	1.000,00	19.084,82	18,55	19,04	19,22	14.499,00
05-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	9,45	1.600,00	15.114,25	9,35	9,43	9,47	31.221,00
05-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	9,44	5.600,00	52.867,98	9,35	9,43	9,47	31.221,00
05-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	14,69	1.200,00	17.632,85	14,18	14,46	14,91	17.743,00
05-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRIO3	40,80	300,00	12.239,78	39,70	40,56	41,05	21.812,00
05-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	19,83	500,00	9.914,03	19,52	19,79	20,04	29.639,00
05-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	19,82	5.100,00	101.077,43	19,52	19,79	20,04	29.639,00
05-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	36,99	4.400,00	162.769,44	36,58	37,02	37,29	26.679,00
05-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	37,03	300,00	11.109,85	36,58	37,02	37,29	26.679,00
05-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	18,86	600,00	11.315,32	18,20	18,85	19,13	9.728,00
05-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	65,11	300,00	19.532,96	63,66	64,63	65,47	35.320,00
05-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	20,69	4.700,00	97.235,58	20,50	20,69	20,82	19.386,00
05-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	9,59	3.975,00	38.112,73	9,53	9,61	9,71	8.006,00
05-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	9,64	1.841,00	17.740,62	9,53	9,61	9,71	8.006,00
05-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLE3	8,57	439,00	3.763,14	8,56	8,62	8,76	7.257,00
05-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLE3	8,60	1.716,00	14.751,18	8,56	8,62	8,76	7.257,00
05-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLE6	9,69	6.009,00	58.199,65	9,64	9,71	9,84	20.733,00
05-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLE6	9,69	1.159,00	11.228,86	9,64	9,71	9,84	20.733,00
05-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLE6	9,65	579,00	5.588,49	9,64	9,71	9,84	20.733,00
05-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	GMAT1	0,07	994,00	69,06	0,03	0,05	0,15	403,00
06-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	CPFE3	32,10	14.700,00	471.810,74	31,92	32,07	32,37	7.199,00
06-12-24	FIA RVA EMB II	Venda	CURY3	20,77	28.000,00	581.601,82	20,67	20,87	21,29	6.620,00
06-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	CXSE3	15,33	6.300,00	96.561,00	15,07	15,32	15,50	14.431,00
06-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	33,68	2.100,00	70.731,14	33,04	33,90	35,57	11.957,00
06-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	35,42	2.500,00	88.542,83	35,18	35,43	35,60	11.820,00
06-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLE3	8,52	2.300,00	19.606,47	8,46	8,53	8,60	5.606,00
06-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLE6	9,59	7.300,00	70.011,59	9,48	9,56	9,67	21.280,00
06-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	36,55	11.300,00	413.005,07	36,22	36,57	36,85	39.873,00
06-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQT3	29,86	11.500,00	343.418,83	29,65	29,83	30,25	33.348,00
06-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	2,47	6.700,00	16.549,00	2,46	2,50	2,63	41.004,00
06-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	2,51	106.400,00	266.696,62	2,46	2,50	2,63	41.004,00
06-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	14,32	8.200,00	117.424,00	13,97	14,13	14,36	22.551,00
06-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRIO3	40,06	500,00	20.028,31	39,67	39,96	40,42	22.568,00
06-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	19,45	4.300,00	83.626,35	19,11	19,34	19,91	24.948,00
06-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	15,93	1.000,00	15.933,97	15,68	15,86	16,25	8.386,00
06-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	35,00	11.800,00	412.973,55	34,41	35,07	36,91	41.502,00
06-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	18,45	1.000,00	18.450,84	18,21	18,41	18,87	13.180,00
06-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	65,28	5.100,00	332.949,10	64,60	65,29	65,86	32.006,00
06-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	GMAT1	0,03	64,00	1,92	0,01	0,03	0,11	337,00
06-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	GMAT1	0,04	2.264,00	90,56	0,01	0,03	0,11	337,00
09-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	CPLE6	9,55	12.300,00	117.497,00	9,48	9,54	9,64	19.119,00
09-12-24	FIA RVA EMB II	Venda	SBRG3	10,80	12.200,00	131.712,28	10,54	10,76	11,19	8.248,00
09-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	19,29	2.300,00	44.376,74	19,13	19,29	19,47	10.617,00
09-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	6,10	3.100,00	18.896,23	6,00	6,11	6,22	8.357,00
09-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	AZZA3	32,80	800,00	26.243,33	32,46	32,95	34,38	11.017,00
09-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	30,37	400,00	12.149,72	30,22	30,49	31,09	13.441,00
09-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPLE3	8,57	2.000,00	17.131,17	8,49	8,56	8,65	7.432,00
09-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLE6	9,57	1.700,00	16.261,20	9,48	9,54	9,64	19.119,00
09-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	36,01	4.000,00	144.023,71	35,38	35,88	36,78	32.120,00
09-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	35,85	1.300,00	46.601,56	35,38	35,88	36,78	32.120,00
09-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	38,84	1.300,00	50.497,32	38,44	38,74	39,45	14.144,00
09-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQT3	29,61	1.100,00	32.568,42	29,34	29,60	30,02	26.393,00
09-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	13,07	2.600,00	33.982,00	13,00	13,09	13,20	6.407,00
09-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	13,12	2.600,00	34.112,00	13,00	13,09	13,20	6.407,00
09-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	13,07	1.300,00	16.995,65	13,00	13,09	13,20	6.407,00
09-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	13,07	2.200,00	28.763,48	13,00	13,09	13,20	6.407,00
09-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	2,45	22.500,00	55.119,84	2,40	2,44	2,53	56.323,00
09-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	2,45	89.700,00	219.806,13	2,40	2,44	2,53	56.323,00
09-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGT11	18,83	3.200,00	60.262,74	18,75	18,84	19,02	8.897,00
09-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	9,29	14.100,00	130.938,44	9,25	9,28	9,35	37.417,00
09-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	14,24	1.500,00	21.363,06	14,13	14,23	14,41	11.821,00
09-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRIO3	40,13	500,00	20.065,87	39,80	40,07	40,41	15.942,00
09-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	19,13	4.000,00	76.513,96	19,05	19,17	19,45	14.721,00
09-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	19,13	1.900,00	36.347,00	19,05	19,17	19,45	14.721,00

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2024

## RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

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



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
09-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	19,12	3.200,00	61.191,84	19,05	19,17	19,45	14.721,00
09-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	15,78	2.900,00	45.747,86	15,59	15,76	16,03	8.496,00
09-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	33,61	900,00	30.249,71	33,29	33,81	35,22	32.586,00
09-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	33,58	6.100,00	204.854,71	33,29	33,81	35,22	32.586,00
09-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	18,27	2.200,00	40.193,55	18,14	18,28	18,69	8.323,00
09-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	66,03	2.400,00	158.472,44	65,20	66,07	66,81	23.133,00
09-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	66,27	1.000,00	66.266,97	65,20	66,07	66,81	23.133,00
09-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	VBRB3	20,36	600,00	12.213,08	20,19	20,36	20,64	17.082,00
10-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPFE3	32,19	3.000,00	96.559,00	31,98	32,15	32,28	4.580,00
10-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	DIRR3	30,71	4.500,00	138.177,96	30,30	30,88	31,62	19.735,00
10-12-24	FIA RVA EMB II	Venda	SBFG3	10,88	25.300,00	275.384,14	10,54	10,81	11,01	7.109,00
10-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	13,28	6.300,00	83.694,88	13,16	13,30	13,41	6.632,00
10-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	13,28	1.000,00	13.283,21	13,16	13,30	13,41	6.632,00
10-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	2,52	1.600,00	4.032,00	2,43	2,50	2,55	35.663,00
10-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	2,51	58.600,00	146.892,83	2,43	2,50	2,55	35.663,00
10-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	9,36	10.400,00	97.374,65	9,32	9,38	9,45	21.449,00
10-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRIO3	40,34	800,00	32.274,11	40,03	40,26	40,74	18.380,00
10-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	19,48	3.300,00	64.280,87	19,24	19,51	19,84	18.533,00
10-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	15,78	2.000,00	31.569,12	15,62	15,80	16,07	7.813,00
10-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	33,95	4.700,00	159.546,74	33,50	34,02	34,95	36.226,00
10-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	64,84	5.000,00	324.223,32	64,51	65,12	66,82	22.711,00
11-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	19,78	900,00	17.803,43	19,44	19,88	20,38	15.157,00
11-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLE3	8,63	1.300,00	11.224,61	8,52	8,65	8,88	17.250,00
11-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLE6	9,65	2.000,00	19.307,22	9,52	9,67	9,90	35.141,00
11-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	36,20	2.000,00	72.396,58	35,78	36,54	37,55	28.366,00
11-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	39,21	400,00	15.685,03	38,51	39,60	40,79	15.633,00
11-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	38,98	1.700,00	66.259,25	38,51	39,60	40,79	15.633,00
11-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	30,13	1.100,00	33.139,98	29,59	30,51	31,34	33.285,00
11-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	13,58	3.400,00	46.168,14	13,27	13,58	13,81	15.258,00
11-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	13,70	4.400,00	60.258,00	13,27	13,58	13,81	15.258,00
11-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	13,52	200,00	2.664,97	13,27	13,58	13,81	15.258,00
11-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	2,69	73.700,00	198.327,14	2,53	2,67	2,80	43.346,00
11-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	2,68	36.400,00	97.370,00	2,53	2,67	2,80	43.346,00
11-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	19,17	1.500,00	28.749,43	18,85	19,26	19,80	12.780,00
11-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	9,45	1.800,00	17.009,70	9,30	9,47	9,68	45.966,00
11-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	9,40	8.700,00	81.808,29	9,30	9,47	9,68	45.966,00
11-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRIO3	41,42	800,00	33.134,09	40,20	41,51	42,48	51.482,00
11-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	19,81	1.400,00	27.736,20	19,49	19,86	20,40	34.539,00
11-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	16,11	2.000,00	32.220,44	15,86	16,24	16,64	11.718,00
11-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	35,67	2.200,00	78.474,00	34,37	35,39	36,87	46.952,00
11-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	64,37	2.100,00	135.173,87	63,40	64,28	64,91	39.578,00
11-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	VBRB3	20,75	500,00	10.373,00	20,39	20,88	21,33	25.827,00
11-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	9,45	9.859,00	93.128,72	9,32	9,47	9,64	12.258,00
11-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLE3	8,81	582,00	5.127,57	8,52	8,65	8,88	17.250,00
11-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLE3	8,60	9.550,00	82.122,43	8,52	8,65	8,88	17.250,00
11-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLE6	9,65	10.642,00	102.680,39	9,52	9,67	9,90	35.141,00
12-12-24	FIA RVA EMB II	Venda	CYRE3	18,37	15.200,00	279.265,68	18,01	18,26	19,00	27.905,00
12-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	DIRR3	30,54	2.000,00	61.083,96	28,93	29,39	31,29	13.802,00
12-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	MRF3	20,92	4.800,00	100.413,00	19,70	20,38	21,10	37.623,00
12-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	PETRA	38,44	2.700,00	103.791,61	38,12	38,46	38,89	55.984,00
12-12-24	FIA RVA EMB II	Venda	TOTS3	30,33	7.900,00	239.572,24	30,01	30,45	31,19	22.714,00
12-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	VIVT3	51,26	2.000,00	102.522,00	49,08	50,38	52,24	21.402,00
12-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	WEGE3	57,59	1.700,00	97.897,00	57,13	57,74	58,52	36.985,00
12-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	19,43	600,00	11.659,64	19,30	19,43	19,77	16.654,00
12-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	19,41	3.400,00	66.006,82	19,30	19,43	19,77	16.654,00
12-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALPA4	6,29	2.900,00	18.250,89	6,20	6,27	6,39	7.790,00
12-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	32,15	3.200,00	102.893,63	31,86	32,42	33,88	13.839,00
12-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	32,08	500,00	16.042,38	31,86	32,42	33,88	13.839,00
12-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSCE	36,57	3.100,00	113.369,49	36,34	36,66	37,04	21.364,00
12-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	30,93	400,00	12.371,93	30,40	30,87	31,20	28.963,00
12-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLE6	9,25	7.300,00	67.507,17	9,20	9,29	9,60	28.118,00
12-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLE6	9,25	1.000,00	9.251,56	9,20	9,29	9,60	28.118,00
12-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	35,78	1.300,00	46.516,12	35,50	35,77	36,38	24.079,00
12-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	38,83	200,00	7.765,65	38,58	38,93	39,80	18.683,00
12-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	38,88	1.700,00	66.091,76	38,58	38,93	39,80	18.683,00
12-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	29,83	2.900,00	86.486,60	29,67	29,91	30,84	39.578,00
12-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	29,83	1.000,00	29.834,52	29,67	29,91	30,84	39.578,00
12-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	13,54	800,00	10.834,94	13,30	13,44	13,67	12.268,00
12-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	13,53	800,00	10.824,00	13,30	13,44	13,67	12.268,00
12-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	13,50	1.300,00	17.555,35	13,30	13,44	13,67	12.268,00
12-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	13,49	2.500,00	33.725,00	13,30	13,44	13,67	12.268,00
12-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	13,53	300,00	4.060,41	13,30	13,44	13,67	12.268,00
12-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	13,50	1.300,00	17.554,42	13,30	13,44	13,67	12.268,00
12-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	2,77	118.200,00	327.832,07	2,58	2,70	2,82	41.518,00
12-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	HAPV3	2,80	34.100,00	95.480,00	2,58	2,70	2,82	41.518,00
12-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	IGTI11	18,91	1.000,00	18.914,66	18,79	18,90	19,28	13.401,00
12-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	9,24	5.700,00	52.687,82	9,18	9,27	9,45	38.392,00
12-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	9,24	1.100,00	10.163,71	9,18	9,27	9,45	38.392,00
12-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	9,25	6.900,00	63.830,40	9,18	9,27	9,45	38.392,00
12-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	13,53	10.000,00	135.272,11	13,29	13,66	14,39	35.355,00
12-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	13,50	1.100,00	14.848,42	13,29	13,66	14,39	35.355,00
12-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRIO3	41,26	400,00	16.505,80	40,95	41,24	42,14	36.446,00
12-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	19,36	900,00	17.425,17	19,26	19,40	19,73	31.832,00
12-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	33,84	6.500,00	219.954,30	33,53	33,93	34,69	42.441,00
12-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	33,78	500,00	16.887,54	33,53	33,93	34,69	42.441,00
12-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	18,86	2.600,00	49.048,13	18,64	18,81	19,30	11.441,00
12-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	63,06	2.300,00	145.040,16	62,36	63,03	63,79	42.710,00
12-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	VBRB3	20,32	2.400,00	48.757,85	20,05	20,37	20,85	24.616,00
12-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	9,22	5.829,00	53.740,81	9,15	9,22	9,51	15.947,00
12-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLE3	8,32	5.401,00	44.914,83	8,27	8,34	8,52	11.885,00
12-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLE3	8,36	2.156,00	18.034,40	8,27	8,34	8,52	11.885,00
12-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPLE6	9,23	10.147,00	93.660,36	9,20	9,29	9,60	28.118,00



# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2024

## RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE DEZEMBRO DE 2024 À 31 DE DEZEMBRO 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
12-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPL66	9,32	8.603,00	80.204,27	9,20	9,29	9,60	28.118,00
12-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPL66	9,24	467,00	4.313,07	9,20	9,29	9,60	28.118,00
12-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	HAPV3	2,79	4.529,00	12.617,15	2,58	2,70	2,82	41.518,00
12-12-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	22,61	2.358,00	53.318,35	22,48	22,72	23,56	31.857,00
12-12-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	22,65	1.751,00	39.667,30	22,48	22,72	23,56	31.857,00
12-12-24	FIA RVA EMB IV	Compra	SBSP3	89,74	1.436,00	128.871,33	89,23	90,27	92,43	19.154,00
12-12-24	FIA RVA EMB IV	Compra	SBSP3	89,88	114,00	10.246,83	89,23	90,27	92,43	19.154,00
12-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	20,17	1.493,00	30.113,81	20,05	20,37	20,85	24.616,00
12-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	20,27	401,00	8.126,52	20,05	20,37	20,85	24.616,00
12-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	20,26	2.638,00	53.451,65	20,05	20,37	20,85	24.616,00
13-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	31,32	2.600,00	81.426,85	30,66	31,26	32,38	17.754,00
13-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	36,74	7.600,00	279.244,22	36,21	36,73	36,92	15.207,00
13-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	35,71	1.800,00	64.280,95	35,38	35,67	35,90	22.371,00
13-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	38,67	1.900,00	73.473,31	38,19	38,66	39,39	15.948,00
13-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	13,20	1.400,00	18.476,07	13,12	13,25	13,38	8.558,00
13-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	2,62	39.300,00	102.859,30	2,59	2,65	2,71	50.189,00
13-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	13,04	5.200,00	67.824,49	12,78	13,03	13,31	41.023,00
13-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	13,03	2.600,00	33.878,00	12,78	13,03	13,31	41.023,00
13-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	13,15	2.100,00	27.615,00	12,78	13,03	13,31	41.023,00
13-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	19,24	2.500,00	48.107,23	19,01	19,21	19,53	31.214,00
13-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	19,25	2.500,00	48.125,00	19,01	19,21	19,53	31.214,00
13-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	19,25	9.600,00	184.835,91	19,01	19,21	19,53	31.214,00
13-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	19,22	6.600,00	126.876,75	19,01	19,21	19,53	31.214,00
13-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	32,52	14.500,00	471.568,33	32,06	32,65	34,00	48.612,00
13-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	32,65	1.100,00	35.912,12	32,06	32,65	34,00	48.612,00
13-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	19,30	400,00	7.720,00	18,53	18,81	19,40	15.973,00
13-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	VBRR3	20,18	2.700,00	54.475,89	20,06	20,17	20,37	22.906,00
13-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	9,14	2.765,00	25.272,10	9,10	9,14	9,22	13.852,00
13-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	9,15	4.382,00	40.095,30	9,10	9,14	9,22	13.852,00
13-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPL66	8,34	2.637,00	21.992,58	8,22	8,30	8,36	5.066,00
13-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPL66	8,31	9.094,00	75.601,51	8,22	8,30	8,36	5.066,00
13-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPL66	8,30	2.194,00	18.215,82	8,22	8,30	8,36	5.066,00
13-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPL66	9,19	2.211,00	20.315,86	9,16	9,23	9,29	25.303,00
13-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPL66	9,25	585,00	5.408,47	9,16	9,23	9,29	25.303,00
13-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPL66	9,24	4.122,00	38.094,88	9,16	9,23	9,29	25.303,00
13-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPL66	9,26	9.234,00	85.504,28	9,16	9,23	9,29	25.303,00
13-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPL66	9,24	6.708,00	61.963,99	9,16	9,23	9,29	25.303,00
13-12-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	38,76	6.121,00	237.272,96	38,19	38,66	39,39	15.948,00
13-12-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	38,70	4.596,00	177.844,09	38,19	38,66	39,39	15.948,00
13-12-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ENGI11	38,70	1.166,00	45.124,66	38,19	38,66	39,39	15.948,00
13-12-24	FIA RVA EMB IV	Compra	ITUB4	32,19	14.243,00	458.500,28	32,05	32,24	32,63	35.102,00
13-12-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	22,70	4.696,00	106.582,49	22,42	22,67	22,86	17.071,00
13-12-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	22,69	3.346,00	75.933,17	22,42	22,67	22,86	17.071,00
13-12-24	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	32,18	304,00	9.782,06	32,06	32,65	34,00	48.612,00
13-12-24	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	32,61	463,00	15.098,43	32,06	32,65	34,00	48.612,00
13-12-24	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	32,53	3.000,00	97.583,70	32,06	32,65	34,00	48.612,00
13-12-24	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	32,74	363,00	11.886,43	32,06	32,65	34,00	48.612,00
13-12-24	FIA RVA EMB IV	Compra	SBSP3	89,13	5.200,00	463.461,00	88,78	89,34	90,34	19.698,00
13-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	20,17	3.410,00	68.785,73	20,06	20,17	20,37	22.906,00
13-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	20,21	1.108,00	22.392,68	20,06	20,17	20,37	22.906,00
13-12-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	AIEC11	42,87	7.928,00	339.853,73	42,46	42,82	43,30	1.362,00
16-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	18,99	1.600,00	30.388,16	18,70	18,90	19,10	13.572,00
16-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	30,55	1.600,00	48.886,96	30,11	30,57	31,15	16.094,00
16-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	36,53	2.700,00	98.639,65	36,12	36,44	36,98	13.755,00
16-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	29,01	3.300,00	95.721,26	28,86	29,29	30,36	45.492,00
16-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	35,47	8.200,00	290.836,35	35,02	35,23	36,08	21.034,00
16-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	38,11	2.500,00	95.287,05	37,43	37,95	38,61	15.456,00
16-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	FQTL3	29,41	2.200,00	64.694,94	29,06	29,32	29,70	28.439,00
16-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	12,94	2.400,00	31.050,17	12,76	12,91	13,03	9.501,00
16-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	2,61	13.300,00	34.668,85	2,55	2,62	2,73	37.867,00
16-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	HTSA4	9,05	5.300,00	47.966,88	8,99	9,04	9,20	42.038,00
16-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	13,45	2.500,00	33.614,46	12,84	13,28	13,61	24.327,00
16-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	13,41	3.900,00	52.291,24	12,84	13,28	13,61	24.327,00
16-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	18,65	6.900,00	128.666,67	18,44	18,62	19,09	28.758,00
16-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	16,04	1.900,00	30.475,29	15,86	16,01	16,25	7.610,00
16-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	31,28	18.500,00	578.760,35	30,64	31,42	32,46	41.245,00
16-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	30,94	1.200,00	37.124,87	30,64	31,42	32,46	41.245,00
16-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	63,76	2.700,00	172.151,81	62,42	63,64	64,21	32.535,00
16-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	VBRR3	19,42	6.600,00	128.192,77	19,11	19,39	20,09	36.863,00
16-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	9,07	2.020,00	18.317,22	8,99	9,06	9,15	8.497,00
16-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	9,08	1.732,00	15.732,26	8,99	9,06	9,15	8.497,00
16-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	9,04	1.082,00	9.786,10	8,99	9,06	9,15	8.497,00
16-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPL66	8,16	2.259,00	18.428,25	8,10	8,18	8,33	7.964,00
16-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPL66	8,20	10.483,00	85.926,25	8,10	8,18	8,33	7.964,00
16-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPL66	9,15	12.514,00	114.505,49	9,07	9,14	9,24	26.268,00
16-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPL66	9,15	2.891,00	26.452,65	9,07	9,14	9,24	26.268,00
16-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	CPL66	9,13	2.358,00	21.530,47	9,07	9,14	9,24	26.268,00
16-12-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	22,11	20.500,00	453.279,00	21,95	22,16	22,58	21.253,00
16-12-24	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	31,49	2.875,00	90.544,96	30,64	31,42	32,46	41.245,00
16-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	19,40	6.377,00	123.722,44	19,11	19,39	20,09	36.863,00
16-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	19,15	1.480,00	28.340,75	19,11	19,39	20,09	36.863,00
16-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	19,61	740,00	14.508,28	19,11	19,39	20,09	36.863,00
16-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBRR3	19,46	666,00	12.958,55	19,11	19,39	20,09	36.863,00
17-12-24	FIA RVA EMB II	Venda	BRFS3	28,28	13.900,00	393.071,96	27,87	28,32	28,57	30.022,00
17-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	VALE3	56,13	3.400,00	190.838,31	55,65	56,14	56,40	60.134,00
17-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	30,28	1.200,00	36.337,84	29,90	30,49	31,16	11.536,00
17-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBSE3	36,98	2.600,00	96.137,74	36,25	36,95	37,23	27.759,00
17-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	35,19	4.500,00	158.376,73	34,77	35,21	35,68	37.738,00
17-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	38,02	2.100,00	79.839,84	37,44	38,14	38,53	27.878,00
17-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	12,68	1.700,00	21.556,32	12,55	12,65	12,84	18.414,00
17-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	12,62	3.400,00	42.923,71	12,55	12,65	12,84	18.414,00
17-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	2,26	123.000,00	278.504,36	2,17	2,26	2,44	86.125,00

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2024

## RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

Mês de Referência: 01 DE DEZEMBRO DE 2024 À 31 DE DEZEMBRO 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
17-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	13,38	300,00	4.013,44	13,05	13,19	13,59	32.760,00
17-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	18,83	10.100,00	190.167,41	18,59	18,83	19,02	45.008,00
17-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	30,72	3.500,00	107.529,91	29,91	30,81	31,49	46.777,00
17-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	30,69	3.900,00	119.697,46	29,91	30,81	31,49	46.777,00
17-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	62,72	800,00	50.178,28	62,05	62,47	63,30	37.294,00
17-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	9,10	5.569,00	50.680,39	9,00	9,09	9,17	14.262,00
17-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	9,12	804,00	7.330,53	9,00	9,09	9,17	14.262,00
17-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	9,08	1.133,00	10.283,40	9,00	9,09	9,17	14.262,00
17-12-24	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	2,22	77.702,00	172.263,69	2,17	2,26	2,44	86.125,00
17-12-24	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	2,23	2.276,00	5.067,26	2,17	2,26	2,44	86.125,00
17-12-24	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	2,24	3.093,00	6.928,32	2,17	2,26	2,44	86.125,00
17-12-24	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	2,22	6.795,00	15.068,06	2,17	2,26	2,44	86.125,00
17-12-24	FIA RVA EMB IV	Compra	HAPV3	2,24	3.746,00	8.390,41	2,17	2,26	2,44	86.125,00
17-12-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	22,05	19.788,00	436.311,84	21,95	22,13	22,33	27.386,00
17-12-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	22,17	10.541,00	233.719,86	21,95	22,13	22,33	27.386,00
17-12-24	FIA RVA EMB IV	Compra	RENT3	31,17	15.700,00	489.403,00	29,91	30,81	31,49	46.777,00
17-12-24	FIA RVA EMB IV	Compra	SBSB3	89,85	7.400,00	664.910,00	88,77	90,18	91,13	51.676,00
17-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	19,13	3.709,00	70.943,22	19,00	19,17	19,34	38.875,00
17-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	19,16	5.607,00	107.420,69	19,00	19,17	19,34	38.875,00
18-12-24	FIA RVA EMB II	Venda	JNTB3	13,14	12.000,00	157.724,80	12,98	13,16	13,62	10.200,00
18-12-24	FIA RVA EMB II	Compra	SUZB3	61,83	2.000,00	123.659,46	61,22	61,81	62,61	37.313,00
18-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	18,41	2.600,00	47.855,57	18,09	18,41	18,79	34.301,00
18-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	29,10	2.100,00	61.119,56	28,69	29,38	30,91	14.812,00
18-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	BSEB3	37,03	2.500,00	92.576,12	36,65	37,14	37,67	30.704,00
18-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	28,23	6.100,00	172.217,13	27,45	28,19	29,22	42.824,00
18-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPLE6	9,07	2.500,00	22.686,16	8,97	9,12	9,30	35.427,00
18-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	34,78	5.600,00	194.746,99	34,20	34,83	35,32	50.264,00
18-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	34,78	900,00	31.303,07	34,20	34,83	35,32	50.264,00
18-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	37,43	700,00	26.202,43	36,81	37,89	38,45	23.753,00
18-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	2,17	49.800,00	108.205,26	2,11	2,24	2,43	111.188,00
18-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	2,23	146.700,00	327.329,63	2,11	2,24	2,43	111.188,00
18-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	17,98	2.300,00	41.346,45	17,67	17,97	18,23	15.153,00
18-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	8,78	3.900,00	34.232,42	8,69	8,81	9,03	49.544,00
18-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	12,58	6.300,00	79.248,63	12,40	12,72	13,09	37.735,00
18-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRIO3	39,97	500,00	19.987,00	39,38	40,22	41,53	45.274,00
18-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	18,21	1.700,00	30.949,93	18,04	18,40	18,93	42.795,00
18-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	30,17	2.100,00	63.364,24	29,72	30,19	30,88	52.644,00
18-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	RENT3	30,01	200,00	6.002,00	29,72	30,19	30,88	52.644,00
18-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	17,25	1.800,00	31.044,84	16,93	17,36	17,89	8.576,00
18-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	62,04	700,00	43.428,00	61,22	61,81	62,61	37.313,00
18-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	18,28	2.100,00	38.390,28	17,85	18,36	19,21	43.957,00
18-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	9,00	3.658,00	32.922,00	8,75	8,90	9,08	11.238,00
18-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	18,36	2.048,00	37.608,57	17,85	18,36	19,21	43.957,00
18-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	18,41	1.340,00	24.668,24	17,85	18,36	19,21	43.957,00
18-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	VBBR3	18,31	174,00	3.185,79	17,85	18,36	19,21	43.957,00
19-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	18,13	200,00	3.626,00	17,99	18,23	18,41	18,41
19-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	18,24	3.400,00	62.006,22	17,99	18,23	18,41	18,41
19-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	18,28	2.000,00	36.564,84	17,99	18,23	18,41	18,41
19-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALPA4	6,30	1.900,00	11.966,12	6,05	6,24	6,37	6,37
19-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ASAI3	5,30	11.300,00	59.845,85	5,11	5,33	5,52	5,52
19-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	29,16	2.700,00	78.742,67	28,81	29,20	29,72	29,72
19-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	BBAS3	23,88	1.000,00	23.879,38	23,75	23,90	24,05	24,05
19-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	BPAC11	28,58	800,00	22.865,94	27,59	28,45	28,78	28,78
19-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPLE6	8,29	4.200,00	34.797,05	8,09	8,24	8,38	8,38
19-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	CPLE6	9,23	3.700,00	34.168,51	8,98	9,19	9,30	9,30
19-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	34,91	1.300,00	45.383,50	34,26	34,73	35,12	35,12
19-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	ENEV3	11,11	2.100,00	23.324,48	10,77	11,05	11,21	11,21
19-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	37,68	600,00	22.608,00	36,81	37,62	38,06	38,06
19-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	37,81	2.000,00	75.629,14	36,81	37,62	38,06	38,06
19-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	28,91	2.700,00	78.062,21	28,25	28,75	29,15	29,15
19-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	28,93	2.600,00	75.210,49	28,25	28,75	29,15	29,15
19-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	28,80	1.000,00	28.800,00	28,25	28,75	29,15	29,15
19-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	12,41	1.800,00	22.341,28	12,17	12,38	12,48	12,48
19-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	GGPS3	14,55	1.200,00	17.465,53	14,22	14,52	14,67	14,67
19-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	2,26	17.300,00	39.046,92	2,14	2,28	2,36	2,36
19-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	17,68	3.700,00	65.411,90	17,00	17,60	17,86	17,86
19-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	17,57	200,00	3.513,26	17,00	17,60	17,86	17,86
19-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	17,63	3.300,00	58.183,13	17,00	17,60	17,86	17,86
19-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	8,81	23.300,00	205.326,74	8,71	8,81	8,89	8,89
19-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	NTCO3	12,71	1.200,00	15.253,73	12,36	13,00	13,29	13,29
19-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRIO3	39,95	1.000,00	39.946,86	39,68	39,94	40,46	40,46
19-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	18,51	3.000,00	55.522,88	17,97	18,43	18,70	18,70
19-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	RECV3	15,93	2.900,00	46.208,01	15,63	15,90	16,20	16,20
19-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	32,80	6.500,00	213.200,00	30,00	31,99	32,86	32,86
19-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	32,47	700,00	22.731,10	30,00	31,99	32,86	32,86
19-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	32,39	9.700,00	314.136,27	30,00	31,99	32,86	32,86
19-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	SMFT3	17,69	2.500,00	44.231,89	16,84	17,59	17,82	17,82
19-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	60,66	900,00	54.597,55	60,32	60,93	61,96	61,96
19-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	VBBR3	18,43	1.300,00	23.957,19	18,04	18,35	18,55	18,55
19-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	8,09	2.100,00	16.989,42	7,89	8,03	8,34	8,34
19-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	8,98	6.072,00	54.506,12	8,78	8,95	9,10	9,10
19-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	9,03	10.325,00	93.186,24	8,78	8,95	9,10	9,10
20-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	18,76	5.000,00	93.802,62	18,10	18,76	19,04	16.788,00
20-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ALOS3	18,83	2.900,00	54.608,23	18,10	18,76	19,04	16.788,00
20-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALPA4	6,49	5.100,00	33.120,60	6,29	6,51	6,67	11.466,00
20-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	ASAI3	5,79	6.600,00	38.188,73	5,33	5,69	5,84	51.644,00
20-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	30,71	700,00	21.496,74	29,30	30,71	31,35	12.194,00
20-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	28,78	600,00	17.268,79	28,06	28,67	29,31	24.672,00
20-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLE6	8,35	2.300,00	19.199,12	8,22	8,32	8,43	8.764,00
20-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLE6	9,26	3.500,00	32.408,04	9,12	9,26	9,33	15.196,00
20-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ELET3	35,24	1.100,00	38.759,85	34,91	35,17	35,54	27.140,00
20-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	11,18	1.000,00	11.178,96	10,92	11,15	11,29	19.750,00

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTO E CONTROLE DE RISCO – DEZEMBRO 2024

## RELATÓRIO DE MOVIMENTAÇÃO DIÁRIA DE RENDA VARIÁVEL

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



DATA	FUNDO	TIPO OPERAÇÃO	PAPEL	PREÇO	QT OPERADA	FINANCEIRO R\$	DADOS BM&FBOVESPA			
							PREÇO MÍNIMO	PREÇO MÉDIO	PREÇO MÁXIMO	VOLUME TOTAL NEG. BOLSA
20-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	38,37	2.000,00	76.733,04	37,70	38,51	38,84	14.405,00
20-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	38,35	900,00	19.175,73	37,70	38,51	38,84	14.405,00
20-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	FLRY3	12,55	800,00	10.040,79	12,36	12,55	12,66	9.609,00
20-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	2,40	15.100,00	36.259,60	2,23	2,39	2,47	59.408,00
20-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	2,29	32.400,00	74.042,81	2,23	2,39	2,47	59.408,00
20-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	17,95	300,00	5.385,41	17,61	18,01	18,37	15.783,00
20-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	8,88	4.600,00	40.857,82	8,77	8,88	8,95	35.830,00
20-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	13,53	900,00	12.178,95	12,95	13,42	13,77	25.053,00
20-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	PRIO3	40,21	900,00	36.189,10	39,43	40,21	40,44	24.578,00
20-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	18,72	2.900,00	54.288,48	18,33	18,67	18,93	33.545,00
20-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	33,57	7.500,00	251.784,04	32,27	33,40	34,08	45.168,00
20-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	32,61	1.000,00	32.605,09	32,27	33,40	34,08	45.168,00
20-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	18,05	1.900,00	34.291,86	17,36	18,02	18,33	10.530,00
20-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	17,84	800,00	14.274,49	17,36	18,02	18,33	10.530,00
20-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	SUZB3	59,60	700,00	41.717,66	59,17	59,62	60,05	31.257,00
20-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	VBBR3	18,74	1.000,00	18.736,58	18,30	18,70	18,90	28.139,00
20-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	8,99	3.231,00	29.041,09	8,86	8,93	8,99	11.406,00
20-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	AURE3	8,90	6.669,00	59.375,84	8,86	8,93	8,99	11.406,00
20-12-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Venda	GARE11	8,03	78.897,00	633.829,62	7,94	8,02	8,08	25.812,00
20-12-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	HSRE11	101,84	181,00	18.432,47	99,50	101,80	102,00	16,00
20-12-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	MALL11	91,03	77,00	7.009,31	89,50	90,53	91,49	4.588,00
20-12-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	NEWL11	97,00	10,00	970,00	91,01	96,50	98,09	193,00
20-12-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	OULG11	31,01	130,00	4.031,30	31,01	31,08	31,50	16,00
20-12-24	FIM EMB III A IMOBILIÁRIO	Compra	SARE11	3,47	75.776,00	262.797,55	3,36	3,47	3,52	3.386,00
23-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALPA4	6,48	800,00	5.187,39	6,14	6,29	6,69	7.071,00
23-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	AZZA3	29,58	2.500,00	73.941,46	29,32	29,60	30,56	9.314,00
23-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	37,57	800,00	30.056,82	37,24	37,62	38,50	10.822,00
23-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	EQTL3	28,05	1.100,00	30.852,18	27,80	28,23	29,17	43.100,00
23-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	17,59	300,00	5.277,05	17,19	17,37	18,09	9.364,00
26-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	27,86	3.400,00	94.725,32	27,58	27,81	28,08	14.571,00
26-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ6	9,10	3.600,00	32.771,63	8,96	9,08	9,15	16.108,00
26-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	35,09	2.800,00	98.255,04	34,70	35,03	35,30	17.864,00
26-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	37,44	700,00	26.205,13	37,10	37,36	37,70	13.283,00
26-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	27,77	1.400,00	38.879,29	27,56	27,79	28,07	33.576,00
26-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	2,23	35.700,00	79.613,43	2,18	2,23	2,26	35.202,00
26-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ITSA4	8,88	10.200,00	90.597,75	8,75	8,86	8,90	28.926,00
26-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	16,97	2.000,00	33.930,45	16,85	17,07	17,36	9.395,00
26-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	17,12	1.300,00	22.257,78	16,85	17,07	17,36	9.395,00
26-12-24	FIA RVA EMB IV	Venda	PRIO3	40,16	4.351,00	174.748,75	39,25	40,00	40,45	20.642,00
27-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALOS3	18,18	1.500,00	27.269,43	18,12	18,21	18,44	11.153,00
27-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	ALPA4	6,28	2.300,00	14.433,72	6,22	6,29	6,43	6.773,00
27-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	AZZA3	29,22	400,00	11.686,81	28,94	29,39	30,04	10.441,00
27-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	27,65	6.500,00	179.706,79	27,40	27,64	28,18	16.094,00
27-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	27,67	1.600,00	44.272,00	27,40	27,64	28,18	16.094,00
27-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	CPLÉ6	9,19	3.400,00	31.255,39	9,10	9,18	9,26	25.999,00
27-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	35,02	5.400,00	189.131,32	34,92	35,02	35,36	22.209,00
27-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	35,02	500,00	17.508,01	34,92	35,02	35,36	22.209,00
27-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENGI11	36,94	1.300,00	48.026,47	36,68	36,98	37,71	9.469,00
27-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	27,71	1.100,00	30.485,33	27,52	27,72	28,26	18.888,00
27-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	12,30	3.100,00	38.130,00	12,19	12,28	12,40	7.592,00
27-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	FLRY3	12,29	1.900,00	23.359,22	12,19	12,28	12,40	7.592,00
27-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	HAPV3	2,22	26.100,00	57.924,09	2,17	2,21	2,29	29.076,00
27-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	IGTI11	17,44	3.100,00	54.065,61	17,38	17,48	17,64	10.462,00
27-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	NTCO3	12,77	600,00	7.662,58	12,54	12,83	13,35	23.480,00
27-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	ONCO3	2,33	16.900,00	37.971,89	2,08	2,32	2,47	13.044,00
27-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	PRIO3	39,97	500,00	19.987,44	39,82	40,06	40,61	19.549,00
27-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	RAIL3	17,87	1.900,00	33.953,49	17,78	17,91	18,26	21.124,00
27-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	32,60	1.100,00	35.864,30	32,48	32,68	33,00	19.584,00
27-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	17,05	1.900,00	32.394,40	16,87	17,03	17,40	7.965,00
27-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	SUZB3	61,68	300,00	18.502,50	61,05	61,65	62,32	23.097,00
27-12-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	21,25	613,00	13.026,23	21,09	21,25	21,39	15.648,00
27-12-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	21,25	281,00	5.972,58	21,09	21,25	21,39	15.648,00
27-12-24	FIA RVA EMB IV	Compra	MULT3	21,26	3.122,00	66.367,68	21,09	21,25	21,39	15.648,00
27-12-24	FIA RVA EMB IV	Compra	SBSPP3	89,13	569,00	50.717,09	88,29	88,87	89,64	15.942,00
27-12-24	FIA RVA EMB IV	Compra	SBSPP3	88,96	2.361,00	210.030,67	88,29	88,87	89,64	15.942,00
30-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	BPAC11	27,45	2.200,00	60.387,60	27,20	27,57	27,85	17.040,00
30-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	ELET3	33,99	6.800,00	231.135,28	33,60	34,03	34,24	18.024,00
30-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	ENEV3	10,49	7.500,00	78.698,20	10,37	10,47	10,61	16.637,00
30-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	EQTL3	27,26	7.400,00	201.720,92	26,99	27,44	27,86	33.319,00
30-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	RAIL3	17,86	6.500,00	116.094,49	17,67	17,84	17,97	15.990,00
30-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	RENT3	32,24	3.800,00	122.499,20	31,90	32,22	32,73	28.171,00
30-12-24	FIA RVA EMB III	Compra	SMFT3	16,90	2.200,00	37.177,41	16,65	16,97	17,22	10.850,00
30-12-24	FIA RVA EMB III	Venda	YDUQ3	8,55	1.600,00	13.680,00	8,11	8,33	8,55	10.710,00

## 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.